

# 汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 01 月 01 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 .....              | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 15 |
| 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 .....             | 16 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 17 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 18 |
| 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 .....       | 18 |
| § 5 托管人报告 .....                               | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 18 |
| 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 ..... | 18 |
| 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 .....       | 18 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....                     | 18 |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 18 |
| 6.2 利润表 .....                                 | 20 |
| 6.3 净资产变动表 .....                              | 21 |
| 6.4 报表附注 .....                                | 23 |
| § 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 .....         | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 64 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 65 |
| 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 .....      | 66 |
| 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 .....   | 66 |
| 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 .....   | 66 |
| 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 .....      | 66 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                 | 66 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....           | 66 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                       | 66 |
| § 8 基金份额持有人信息.....                       | 67 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 67 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 68 |
| 8.3 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.....    | 68 |
| § 9 开放式基金份额变动.....                       | 68 |
| § 10 重大事件揭示 .....                        | 68 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 68 |
| 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.....    | 68 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 69 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                      | 69 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 69 |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....        | 69 |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....    | 69 |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 72 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 73 |
| 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..... | 73 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 73 |
| § 12 备查文件目录 .....                        | 74 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 74 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 74 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 74 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|               |                       |
|---------------|-----------------------|
| 基金名称          | 汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称          | 汇添富上证综合 ETF           |
| 场内简称          | 上证综合                  |
| 基金主代码         | 510980                |
| 基金运作方式        | 交易型开放式                |
| 基金合同生效日       | 2023 年 11 月 22 日      |
| 基金管理人         | 汇添富基金管理股份有限公司         |
| 基金托管人         | 中国工商银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额（份） | 479,798,000.00        |
| 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          | 2023 年 12 月 01 日      |

注：扩位证券简称：上证指数 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   | 本基金的股票投资主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资方法，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。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。 |
| 业绩比较基准 | 上证综合指数收益率                                                                                                                                                                                                       |
| 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      | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李鹏                 | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-28932888       | (010) 66105799      |
|             | 电子邮箱 | service@99fund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-888-9918       | 95588               |

|       |                     |                   |
|-------|---------------------|-------------------|
| 传真    | 021-28932998        | (010) 66105798    |
| 注册地址  | 上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址  | 上海市黄浦区外马路 728 号     | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码  | 200010              | 100140            |
| 法定代表人 | 鲁伟铭                 | 廖林                |

2.4 信息披露方式

|                   |                               |
|-------------------|-------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 《中国证券报》                       |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.99fund.com                |
| 基金中期报告置备地点        | 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(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日) |
|---------------|------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 32,669,538.90                            |
| 本期利润          | 31,135,282.25                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0932                                   |
| 本期加权平均净值利润率   | 6.59%                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.26%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 06 月 30 日)                   |
| 期末可供分配利润      | 205,542,949.40                           |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4284                                   |
| 期末基金资产净值      | 685,340,949.40                           |
| 期末基金份额净值      | 1.4284                                   |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2026 年 06 月 30 日)                   |
| 基金份额累计净值增长率   | 42.84%                                   |

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。

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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①－③   | ②－④    |
|--------------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 过去三个<br>月          | 5.57%        | 0.93%               | 5.20%              | 0.94%                     | 0.37% | -0.01% |
| 过去六个<br>月          | 4.26%        | 0.95%               | 3.16%              | 0.95%                     | 1.10% | 0.00%  |
| 过去一年               | 20.62%       | 0.82%               | 18.87%             | 0.83%                     | 1.75% | -0.01% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 42.84%       | 1.02%               | 33.46%             | 1.04%                     | 9.38% | -0.02% |

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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023年11月22日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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、汇添富基金销售（上海）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、公募证券投资基金销售等业务资格。

汇添富基金自成立以来，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了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。

2026 上半年，汇添富基金新成立 30 只公开募集证券投资基金。截至 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 421 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 |           |                                                                                                                                                                     |
| 孙浩 | 本基金的基金经理 | 2023 年 12 月 12 日 | —    | 6         | 国籍：中国。学历：北京大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格, CFA。从业经历：2020 年 7 月起任汇添富基金管理股份有限公司数量分析师。2023 年 8 月 29 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至 2026 年 5 月 26 日任中证 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>上海国企交<br/>易型开放<br/>式指数证<br/>券投资基<br/>金联接基<br/>金的基金<br/>经理。2023<br/>年 8 月 29 日<br/>至 2025 年 3<br/>月 18 日任汇<br/>添富深证<br/>300 交易型<br/>开放式指<br/>数证券投资<br/>基金联接基<br/>金的基金经<br/>理。2023 年<br/>8 月 29 日至<br/>2026 年 6 月<br/>11 日任中证<br/>银行交易型<br/>开放式指<br/>数证券投资<br/>基金联接基<br/>金的基金经<br/>理。2023 年<br/>9 月 28 日至<br/>今任中证长<br/>三角一体化<br/>发展主题交<br/>易型开放<br/>式指数证<br/>券投资基<br/>金联接基<br/>金的基金经<br/>理。2023 年<br/>11 月 28 日<br/>至 2026 年<br/>5 月 26 日任<br/>汇添富 MSCI<br/>中国 A50 互<br/>联互通交<br/>易型开放<br/>式指数证<br/>券投资基<br/>金联接基<br/>金的基金经</p> |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>理。2023 年 11 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至 2026 年 6 月 11 日任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 日至</p> |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>2024 年 12 月 26 日任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 26 日至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p> <p>2024 年 4 月 19 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p> <p>2024 年 6 月 4 日至 2025 年 8 月 11 日任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发</p> |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 20 日至 2025 年 8 月 18 日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发起式联接基金的基金经理。2024 年 7 月 9 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2024 年 11 月 18 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 18 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 27 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指</p> |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                     |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 10 月 22 日至今任汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月 26 日至今任汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2026 年 5 月 26 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

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 1 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

2026 年上半年 A 股整体震荡上行，上证指数累计上涨 3.16%。分行业看，电子、通信、建材、基础化工板块涨幅领跑；消费者服务、农林牧渔、商贸零售、传媒板块表现垫底。中信一级行业涨跌幅首尾区间差值达 117.37%，市场结构性分化特征突出；风格维度成长风格显著占优，价值板块持续承压。

2026 年作为“十五五”规划开局之年，国内经济在政策红利释放、外部环境日趋复杂的双重背景下，呈现“总量增速边际走缓、行业结构分化持续加深”的运行特征。1—6 月规模以上工业增加值累计同比增长 5.4%，较一季度（1—3 月）6.1%的累计增速回落 0.7 个百分点，工业总量增速逐季走弱。高技术制造业是工业板块中唯一增速持续抬升的领域：一季度增加值累计同比增长 12.5%，上半年进一步升至 13.3%，累计增速提升 0.8 个百分点，产业升级动力充沛。6 月制造业 PMI 为 50.3%，较 5 月 50.0%小幅回升，与 4 月数值持平；指数连续三个月贴近荣枯线 50%，反映制造业仅处于弱修复区间。分项来看，新订单指数偏弱，意味着内需修复根基尚不稳固，企业生产主要依靠存量在手订单支撑。

需求端“三驾马车”走势大幅分化，出口是上半年经济的核心支撑，也是最大亮点。4、5、6 月单月出口同比增速分别达 14.0%、19.3%、27.0%，二季度出口持续高景气；1—6 月全国出口累计同比增长 17.6%，在全球外需整体疲软环境下充分彰显国内供应链韧性。本轮出口高增核心驱动为全球 AI 产业资本开支扩张，拉动国内科技产业链产品外需放量；半导体、通信设备、消费电子等高技术产品出口占比持续提升，出口结构正加速由劳动密集型向技术密集型转型。

消费修复力度持续偏弱。1—6 月社会消费品零售总额累计同比增长 1.3%，较一季度 2.4%的增速再度回落 1.1 个百分点。消费走弱核心原因是 2025 年以旧换新政策提前透支居民消费需求，2026 年上半年消费市场进入需求真空期。后续消费复苏节奏，将取决于居民收入预期改善与房地产市场企稳两大条件。

整体投资端持续承压，房地产投资为主要拖累项。1—6 月全国固定资产投资累计同比下降 5.7%，其中房地产开发投资累计同比下滑 18.0%，降幅较 1—5 月的 16.2%持续走阔。地产行业深度调整仍是压制整体投资的核心因素：虽然部分核心城市二手房量价边际回暖，但新房销售、投资数据依旧走弱，稳地产政策的托底成效尚未充分显现。制造业投资依托高技术产业拉动保持相对稳健，基建投资受益于财政前置发力与“十五五”储备项目落地具备一定韧性，但二者增长力度仍无法对冲地产下行带来的拖累。

物价层面，6 月 CPI 同比上涨 1.0%，上半年 CPI 累计同比约 1.0%，物价保持温和修复。PPI 二季度出现显著边际改善：6 月 PPI 同比升至 4.1%，较 3 月 0.5%大幅上行 3.6 个百分点，上半年 PPI 累计同比上涨 1.5%。PPI 快速上行，一方面源于中东地缘冲突推高国际油价带来的输入型成本压力，另一方面也佐证制造业内需边际回暖。

宏观基本面变化与 A 股市场走势形成清晰映射：高技术制造业长期高景气叠加政策支持持续加持，成为上半年市场核心主线，驱动电子、通信等成长赛道大幅走强。PPI 快速上行有望修复中游制造企业盈利预期，叠加“十五五”科技创新、产业升级政策持续落地，持续抬升市场对成长板块的风险偏好。反观传统制造、地产产业链，受投资下行、内需疲软制约，基本面修复动力不足，叠加消费复苏不及预期，价值板块整体表现疲软，最终造就市场极致的结构性分化行情。

上证指数 ETF 汇添富跟踪上证指数，上证指数是 A 股历史最悠久的股价指数，是宏观经济的晴雨表，经过 2020 年的修订，在新股延迟纳入、剔除风险警示股和纳入科创板证券三个方面进行了全新升级，具有更好的投资属性。本基金采用抽样复制方法，在严控跟踪误差的前提下，通过量化多因子和风险模型来追求稳健适度的超额收益。

#### 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 4.26%，同期业绩比较基准收益率为 3.16%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济结构性分化格局预计延续，A 股市场依旧以结构性机会为主。电子、通信等成长板块上半年累计涨幅较大，当前估值处于相对高位，短期资金博弈或将加剧板块波动；但高技术制造业产业升级中长期逻辑未发生改变，叠加 PPI 上行持续修复中游制造盈利，电子、通信、高端装备等成长赛道仍具备较强配置价值，后续业绩增长有望逐步消化当前高估值。消费、地产链板块则仍需等待内需回暖、稳增长托底政策显效的明确信号。

#### 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；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 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：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日         | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                 |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 4,921,666.21                    | 1,643,268.54                     |
| 结算备付金         |            | 328,489.93                      | 308,647.33                       |
| 存出保证金         |            | 4,885.03                        | 3,523.96                         |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 681,556,933.19                  | 392,859,263.81                   |
| 其中：股票投资       |            | 681,427,924.52                  | 392,859,263.81                   |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 129,008.67                      | -                                |
| 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         |            | -                               | -                                |
| 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          |            | 686,811,974.36                  | 394,814,703.64                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 06 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                 |                                  |
| 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         |            | 1,006,994.54                    | 64,897.34                        |
| 应付赎回款         |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 279,675.45                      | 200,323.80                       |
| 应付托管费         |            | 55,935.08                       | 40,064.77                        |
| 应付销售服务费       |            | -                               | -                                |
| 应付投资顾问费       |            | -                               | -                                |
| 应交税费          |            | 0.39                            | -                                |
| 应付利润          |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                               | -                                |

|          |         |                |                |
|----------|---------|----------------|----------------|
| 其他负债     | 6.4.7.7 | 128,419.50     | 220,255.82     |
| 负债合计     |         | 1,471,024.96   | 525,541.73     |
| 净资产：     |         |                |                |
| 实收基金     | 6.4.7.8 | 479,798,000.00 | 287,798,000.00 |
| 未分配利润    | 6.4.7.9 | 205,542,949.40 | 106,491,161.91 |
| 净资产合计    |         | 685,340,949.40 | 394,289,161.91 |
| 负债和净资产总计 |         | 686,811,974.36 | 394,814,703.64 |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4284 元，基金份额总额 479,798,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号        | 本期<br>2026 年 01 月 01 日<br>至 2026 年 06 月 30<br>日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日<br>至 2025 年 06 月 30<br>日 |
|----------------------------|------------|-------------------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 一、营业总收入                    |            | 32,610,346.53                                   | 21,298,029.40                                        |
| 1. 利息收入                    |            | 5,300.77                                        | 2,157.78                                             |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.10   | 5,300.77                                        | 2,157.78                                             |
| 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）          |            | 34,322,688.54                                   | 20,789,353.79                                        |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.11   | 29,025,713.80                                   | 16,286,440.81                                        |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.12   | -                                               | -                                                    |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13   | 8.32                                            | -                                                    |
| 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   | 5,296,966.42                                    | 4,502,912.98                                         |
| 以摊余成本计量的金融<br>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<br>“-”号填列） | 6.4.7.18   | -1,534,256.65                                   | 639,867.66                                           |
| 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   | -183,386.13                                     | -133,349.83                                          |
| 减：二、营业总支出                  |            | 1,475,064.28                                    | 1,162,308.28                                         |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,160,893.41                                    | 894,114.26                                           |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -                                               | -                                                    |

|                     |            |               |               |
|---------------------|------------|---------------|---------------|
| 2. 托管费              | 6.4.10.2.2 | 232,178.62    | 178,822.87    |
| 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            |            | 0.04          | -             |
| 8. 其他费用             | 6.4.7.21   | 81,992.21     | 89,371.15     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 31,135,282.25 | 20,135,721.12 |
| 减：所得税费用             |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 31,135,282.25 | 20,135,721.12 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -             | -             |
| 六、综合收益总额            |            | 31,135,282.25 | 20,135,721.12 |

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 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                           | 287,798,000.00                           | 106,491,161.91 | 394,289,161.91   |
| 加：会计政策变更                            | -                                        | -              | -                |
| 二、本期期初净资产                           | 287,798,000.00                           | 106,491,161.91 | 394,289,161.91   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | 192,000,000.00                           | 99,051,787.49  | 291,051,787.49   |
| （一）、综合收益总额                          | -                                        | 31,135,282.25  | 31,135,282.25    |
| （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） | 192,000,000.00                           | 67,916,505.24  | 259,916,505.24   |
| 其中：1. 基金申购款                         | 999,000,000.00                           | 399,463,475.79 | 1,398,463,475.79 |

|                                          |                                               |                 |                   |
|------------------------------------------|-----------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| 2. 基金赎回款                                 | -807,000,000.00                               | -331,546,970.55 | -1,138,546,970.55 |
| (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                                | 479,798,000.00                                | 205,542,949.40  | 685,340,949.40    |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 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                                | 383,798,000.00                                | 52,530,069.89   | 436,328,069.89    |
| 加：会计政策变更                                 | -                                             | -               | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 383,798,000.00                                | 52,530,069.89   | 436,328,069.89    |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -162,000,000.00                               | -11,679,138.69  | -173,679,138.69   |
| (一)、综合收益总额                               | -                                             | 20,135,721.12   | 20,135,721.12     |
| (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)      | -162,000,000.00                               | -31,814,859.81  | -193,814,859.81   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 312,000,000.00                                | 28,869,525.18   | 340,869,525.18    |
| 2. 基金赎回款                                 | -474,000,000.00                               | -60,684,384.99  | -534,684,384.99   |
| (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                                | 221,798,000.00                                | 40,850,931.20   | 262,648,931.20    |

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：

张晖

基金管理人负责人

李骁

主管会计工作负责人

雷青松

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〔2023〕1732号文《关于准予汇添富上证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。经向中国证监会备案，基金合同于2023年11月22日生效。首次设立基金募集规模为464,798,000.00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（2023）验字第70015647\_B10号验资报告予以验证。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，基金托管人为中国工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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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2026年06月30日的财务状况以及2026年01月01日至2026年06月30日的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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%；自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### 2. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策公告》的规定，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《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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

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

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<br>2026年06月30日 |
|--------|--------------------|
| 活期存款   | 4,921,666.21       |
| 等于：本金  | 4,921,173.45       |
| 加：应计利息 | 492.76             |

|                |              |
|----------------|--------------|
| 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           | -            |
| 等于：本金          | -            |
| 加：应计利息         | -            |
| 减：坏账准备         | -            |
| 合计             | 4,921,666.21 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 |      |                |              |
|---------------|-------|-------------------------|------|----------------|--------------|
|               |       | 成本                      | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 672,836,925.29          | -    | 681,427,924.52 | 8,590,999.23 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                       | -    | -              | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 129,000.00              | 8.67 | 129,008.67     | -            |
|               | 银行间市场 | -                       | -    | -              | -            |
|               | 其他    | -                       | -    | -              | -            |
|               | 合计    | 129,000.00              | 8.67 | 129,008.67     | -            |
| 资产支持证券        |       | -                       | -    | -              | -            |
| 基金            |       | -                       | -    | -              | -            |
| 其他            |       | -                       | -    | -              | -            |
| 合计            |       | 672,965,925.29          | 8.67 | 681,556,933.19 | 8,590,999.23 |

#### 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<br>2026 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         | 46,596.64               |
| 其中：交易所市场       | 46,596.64               |
| 银行间市场          | -                       |
| 应付利息           | -                       |
| 应付审计费          | 22,315.49               |
| 应付信息披露费        | 59,507.37               |
| 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             | 128,419.50              |

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|               | 基金份额（份）         | 账面金额            |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末          | 287,798,000.00  | 287,798,000.00  |
| 本期申购          | 999,000,000.00  | 999,000,000.00  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -807,000,000.00 | -807,000,000.00 |
| 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           | 479,798,000.00  | 479,798,000.00  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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         |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末           | 104,571,854.48  | 1,919,307.43   | 106,491,161.91  |
| 加：会计政策变更       | -               | -              | -               |
| 本期期初           | 104,571,854.48  | 1,919,307.43   | 106,491,161.91  |
| 本期利润           | 32,669,538.90   | -1,534,256.65  | 31,135,282.25   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 90,523,697.32   | -22,607,192.08 | 67,916,505.24   |
| 其中：基金申购款       | 435,654,305.85  | -36,190,830.06 | 399,463,475.79  |
| 基金赎回款          | -345,130,608.53 | 13,583,637.98  | -331,546,970.55 |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | 227,765,090.70  | -22,222,141.30 | 205,542,949.40  |

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 4,613.64                                 |
| 定期存款利息收入  | -                                        |
| 其他存款利息收入  | -                                        |
| 结算备付金利息收入 | 678.86                                   |
| 其他        | 8.27                                     |
| 合计        | 5,300.77                                 |

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 9,142,622.25                             |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 19,883,091.55                            |
| 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               | 29,025,713.80                            |

## 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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------|------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 191,508,326.26                           |
| 减：卖出股票成本总额 | 182,173,646.04                           |
| 减：交易费用     | 192,057.97                               |
| 买卖股票差价收入   | 9,142,622.25                             |

## 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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|-------------|------------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 1,138,546,970.55                         |
| 减：现金支付赎回款总额 | 3,702,346.03                             |
| 减：赎回股票成本总额  | 1,114,961,532.97                         |
| 减：交易费用      | —                                        |
| 赎回差价收入      | 19,883,091.55                            |

## 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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------------------------|------------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 8.32                                     |
| 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             | 8.32 |

#### 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。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

#### 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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 5,296,966.42                             |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                        |
| 基金投资产生的股利收益   | -                                        |
| 合计            | 5,296,966.42                             |

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------|------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -1,534,256.65                            |
| ——股票投资     | -1,534,256.65                            |

|                            |               |
|----------------------------|---------------|
| ——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<br>产生的预估增值税 | -             |
| 合计                         | -1,534,256.65 |

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---------|------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                        |
| 替代损益    | -183,386.13                              |
| 其他      | -                                        |
| 合计      | -183,386.13                              |

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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|-------------|------------------------------------------|
| 审计费用        | 22,315.49                                |
| 信息披露费       | 59,507.37                                |
| 证券出借违约金     | -                                        |
| 账户维护费       | -                                        |
| 银行费用        | 133.00                                   |
| 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    | 36.35     |
| 合计    | 81,992.21 |

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、关联关系

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 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 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      |

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

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<br>2026 年 01 月 01 日至<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至<br>2025 年 06 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,160,893.41                                | 894,114.26                                       |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 280,727.15                                  | 171,949.50                                       |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 880,166.26                                  | 722,164.76                                       |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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<br>2026 年 01 月 01 日至<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至<br>2025 年 06 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 232,178.62                                  | 178,822.87                                       |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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及上年度可比期间均未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 2026 年 06 月 30 日 |                             | 上年度末 2025 年 12 月 31 日 |                             |
|---------|----------------------|-----------------------------|-----------------------|-----------------------------|
|         | 持有的基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例（%） | 持有的基金份额               | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例（%） |
| 东方证券股份有 | 1,669,000.00         | 0.35                        | 1,669,000.00          | 0.58                        |

|     |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|
| 限公司 |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |          | 上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |          |
|-------|---------------------------------------|----------|--------------------------------------------|----------|
|       | 期末余额                                  | 当期利息收入   | 期末余额                                       | 当期利息收入   |
| 工商银行  | 4,921,666.21                          | 4,613.64 | 931,645.31                                 | 1,525.72 |

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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（2026 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 |
| 603293               | 埃泰克汽车电子 | 2026 年 04 月 09 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 33.49 | 33.93  | 25       | 837.25 | 848.25   |    |
| 603407               | 长裕集团    | 2026 年 04 月 29 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 13.86 | 73.46  | 72       | 997.92 | 5,289.12 |    |

|                      |        |             |        |        |        |        |          |           |           |    |
|----------------------|--------|-------------|--------|--------|--------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 603435               | 嘉德利    | 2026年05月15日 | 6个月    | 新股流通受限 | 15.76  | 46.71  | 61       | 961.36    | 2,849.31  |    |
| 688797               | 臻宝科技   | 2026年06月16日 | 6个月    | 新股流通受限 | 44.56  | 468.67 | 99       | 4,411.44  | 46,398.33 |    |
| 688811               | 有研金属复材 | 2026年04月01日 | 6个月    | 新股流通受限 | 6.41   | 24.13  | 480      | 3,076.80  | 11,582.40 |    |
| 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 |
| 113706               | 金帝转债   | 2026年06月16日 | 17个交易日 | 新债流通受限 | 100.00 | 100.01 | 400      | 40,000.00 | 40,002.81 |    |
| 118069               | 爱科转债   | 2026年06月12日 | 18个交易日 | 新债流通受限 | 100.00 | 100.01 | 550      | 55,000.00 | 55,004.82 |    |
| 118072               | 鼎通转债   | 2026年06月25日 | 16个交易日 | 新债流通受限 | 100.00 | 100.00 | 340      | 34,000.00 | 34,001.04 |    |

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 |
| 688072 | 拓荆科技 | 2026年06月29日 | 重大事项停牌 | 832.00 | 2026年07月13日 | 890.99 | 2,480 | 1,207,921.85 | 2,063,360.00 |    |

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 2026 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 2026 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 2026 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，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<br>2026 年<br>06 月 30 | 1 个月以<br>内 | 1-3 个月 | 3 个月-1<br>年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|------------|--------|-------------|-------|-------|-----|----|

| 日                 |                  |   |                |   |   |                    |                    |
|-------------------|------------------|---|----------------|---|---|--------------------|--------------------|
| 资产                |                  |   |                |   |   |                    |                    |
| 货币资金              | 4,921,66<br>6.21 | - | -              | - | - | -                  | 4,921,66<br>6.21   |
| 结算备付<br>金         | 328,489.<br>93   | - | -              | - | - | -                  | 328,489.<br>93     |
| 存出保证<br>金         | 4,885.03         | - | -              | - | - | -                  | 4,885.03           |
| 交易性金<br>融资产       | -                | - | 129,008.<br>67 | - | - | 681,427,<br>924.52 | 681,556,<br>933.19 |
| 衍生金融<br>资产        | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 买入返售<br>金融资产      | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 债权投资              | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 应收清算<br>款         | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 应收股利              | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 应收申购<br>款         | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 递延所得<br>税资产       | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 其他资产              | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 资产总计              | 5,255,04<br>1.17 | - | 129,008.<br>67 | - | - | 681,427,<br>924.52 | 686,811,<br>974.36 |
| 负债                |                  |   |                |   |   |                    |                    |
| 短期借款              | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 交易性金<br>融负债       | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 衍生金融<br>负债        | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 卖出回购<br>金融资产<br>款 | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 应付清算<br>款         | -                | - | -              | - | - | 1,006,99<br>4.54   | 1,006,99<br>4.54   |
| 应付赎回<br>款         | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |
| 应付管理<br>人报酬       | -                | - | -              | - | - | 279,675.<br>45     | 279,675.<br>45     |
| 应付托管<br>费         | -                | - | -              | - | - | 55,935.0<br>8      | 55,935.0<br>8      |
| 应付销售              | -                | - | -              | - | - | -                  | -                  |

|                                |                  |        |                |       |       |                    |                    |
|--------------------------------|------------------|--------|----------------|-------|-------|--------------------|--------------------|
| 服务费                            |                  |        |                |       |       |                    |                    |
| 应付投资<br>顾问费                    | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 应交税费                           | -                | -      | -              | -     | -     | 0.39               | 0.39               |
| 应付利润                           | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 递延所得<br>税负债                    | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 其他负债                           | -                | -      | -              | -     | -     | 128,419.<br>50     | 128,419.<br>50     |
| 负债总计                           | -                | -      | -              | -     | -     | 1,471,02<br>4.96   | 1,471,02<br>4.96   |
| 利率敏感<br>度缺口                    | 5,255,04<br>1.17 | -      | 129,008.<br>67 | -     | -     | 679,956,<br>899.56 | 685,340,<br>949.40 |
| 上年度末<br>2025 年<br>12 月 31<br>日 | 1 个月以<br>内       | 1-3 个月 | 3 个月-1<br>年    | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息                | 合计                 |
| 资产                             |                  |        |                |       |       |                    |                    |
| 货币资金                           | 1,643,26<br>8.54 | -      | -              | -     | -     | -                  | 1,643,26<br>8.54   |
| 结算备付<br>金                      | 308,647.<br>33   | -      | -              | -     | -     | -                  | 308,647.<br>33     |
| 存出保证<br>金                      | 3,523.96         | -      | -              | -     | -     | -                  | 3,523.96           |
| 交易性金<br>融资产                    | -                | -      | -              | -     | -     | 392,859,<br>263.81 | 392,859,<br>263.81 |
| 衍生金融<br>资产                     | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 买入返售<br>金融资产                   | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 债权投资                           | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 应收清算<br>款                      | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 应收股利                           | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 应收申购<br>款                      | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 递延所得<br>税资产                    | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 其他资产                           | -                | -      | -              | -     | -     | -                  | -                  |
| 资产总计                           | 1,955,43<br>9.83 | -      | -              | -     | -     | 392,859,<br>263.81 | 394,814,<br>703.64 |
| 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     | -            | - | - | - | - | 64,897.34      | 64,897.34      |
| 应付赎回款     | -            | - | - | - | - | -              | -              |
| 应付管理人报酬   | -            | - | - | - | - | 200,323.80     | 200,323.80     |
| 应付托管费     | -            | - | - | - | - | 40,064.77      | 40,064.77      |
| 应付销售服务费   | -            | - | - | - | - | -              | -              |
| 应付投资顾问费   | -            | - | - | - | - | -              | -              |
| 应交税费      | -            | - | - | - | - | -              | -              |
| 应付利润      | -            | - | - | - | - | -              | -              |
| 递延所得税负债   | -            | - | - | - | - | -              | -              |
| 其他负债      | -            | - | - | - | - | 220,255.82     | 220,255.82     |
| 负债总计      | -            | - | - | - | - | 525,541.73     | 525,541.73     |
| 利率敏感度缺口   | 1,955,439.83 | - | - | - | - | 392,333,722.08 | 394,289,161.91 |

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

本基金本报告期末及上年度末均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 2026 年 06 月 30 日 |               | 上年度末 2025 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|----------------------|---------------|-----------------------|---------------|
|               | 公允价值                 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                  | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 681,427,924.52       | 99.43         | 392,859,263.81        | 99.64         |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                    | —             | —                     | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 129,008.67           | 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            | 681,556,933.19       | 99.45         | 392,859,263.81        | 99.64         |

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；<br>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<br>(单位：人民币元) |                       |
|    |                                                                                                                                   | 本期末 2026 年 06 月 30 日            | 上年度末 2025 年 12 月 31 日 |
|    | 上证综合指数上涨 5%                                                                                                                       | 33,948,110.46                   | 19,201,267.91         |
|    | 上证综合指数下跌 5%                                                                                                                       | -33,948,110.46                  | -19,201,267.91        |

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<br>2026 年 06 月 30 日 |
|---------------|-------------------------|
| 第一层次          | 679,297,597.11          |
| 第二层次          | 2,192,368.67            |
| 第三层次          | 66,967.41               |
| 合计            | 681,556,933.19          |

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业务等情况，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              | 681,427,924.52 | 99.22        |
|    | 其中：股票             | 681,427,924.52 | 99.22        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 129,008.67     | 0.02         |
|    | 其中：债券             | 129,008.67     | 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      | 5,250,156.14   | 0.76         |
| 8  | 其他各项资产            | 4,885.03       | 0.00         |
| 9  | 合计                | 686,811,974.36 | 100.00       |

注：此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”章节的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

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         | 925,892.00     | 0.14         |
| B  | 采矿业              | 52,312,672.15  | 7.63         |
| C  | 制造业              | 339,535,164.36 | 49.54        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 26,893,982.89  | 3.92         |
| E  | 建筑业              | 7,828,294.00   | 1.14         |
| F  | 批发和零售业           | 8,042,624.34   | 1.17         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 21,003,856.00  | 3.06         |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| H | 住宿和餐饮业          | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 52,914,676.24  | 7.72  |
| J | 金融业             | 144,534,829.49 | 21.09 |
| K | 房地产业            | 6,625,508.00   | 0.97  |
| L | 租赁和商务服务业        | 2,432,610.80   | 0.35  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 10,162,621.04  | 1.48  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 5,315,533.44   | 0.78  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -              | -     |
| P | 教育              | 679,574.00     | 0.10  |
| Q | 卫生和社会工作         | 502,169.36     | 0.07  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 1,323,157.00   | 0.19  |
| S | 综合              | 329,000.00     | 0.05  |
|   | 合计              | 681,362,165.11 | 99.42 |

### 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

| 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              | 66,967.41 | 0.01         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -         | -            |
| E  | 建筑业              | -         | -            |
| F  | 批发和零售业           | -         | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -         | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -         | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -         | -            |
| J  | 金融业              | -         | -            |
| K  | 房地产业             | -         | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -         | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -         | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -         | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -         | -            |
| P  | 教育               | -         | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -         | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -         | -            |
| S  | 综合               | -         | -            |
|    | 合计               | 66,967.41 | 0.01         |

### 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<br>（元）   | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|-------------|-----------|---------------|----------------------|
| 1  | 601288 | 农业银行        | 4,293,700 | 26,062,759.00 | 3.80                 |
| 2  | 601988 | 中国银行        | 3,662,200 | 20,947,784.00 | 3.06                 |
| 3  | 601857 | 中国石油        | 1,854,200 | 16,094,456.00 | 2.35                 |
| 4  | 600519 | 贵州茅台        | 13,400    | 15,885,566.00 | 2.32                 |
| 5  | 601138 | 工业富联        | 211,600   | 15,266,940.00 | 2.23                 |
| 6  | 688256 | 寒武纪科技       | 8,235     | 13,139,354.25 | 1.92                 |
| 7  | 688041 | 海光信息        | 24,516    | 9,078,274.80  | 1.32                 |
| 8  | 600036 | 招商银行        | 234,400   | 8,321,200.00  | 1.21                 |
| 9  | 601628 | 中国人寿        | 233,900   | 8,268,365.00  | 1.21                 |
| 10 | 601088 | 中国神华        | 192,000   | 7,495,680.00  | 1.09                 |
| 11 | 603629 | 利通电子        | 41,900    | 7,492,139.00  | 1.09                 |
| 12 | 600183 | 生益科技        | 42,300    | 7,334,820.00  | 1.07                 |
| 13 | 600900 | 长江电力        | 275,600   | 7,295,132.00  | 1.06                 |
| 14 | 605376 | 博迁新材        | 24,500    | 6,646,850.00  | 0.97                 |
| 15 | 601318 | 中国平安        | 125,500   | 5,991,370.00  | 0.87                 |
| 16 | 688172 | 燕东微电子<br>股份 | 69,611    | 5,823,656.26  | 0.85                 |
| 17 | 601899 | 紫金矿业        | 227,100   | 5,709,294.00  | 0.83                 |

|    |        |              |           |                  |      |
|----|--------|--------------|-----------|------------------|------|
|    |        |              |           | 0                |      |
| 18 | 601658 | 邮储银行         | 1,058,500 | 5,218,405.0<br>0 | 0.76 |
| 19 | 603259 | 药明康德         | 41,200    | 5,129,812.0<br>0 | 0.75 |
| 20 | 601328 | 交通银行         | 785,400   | 5,050,122.0<br>0 | 0.74 |
| 21 | 688012 | 中微半导体<br>设备  | 10,338    | 4,843,353.0<br>0 | 0.71 |
| 22 | 600028 | 中国石化         | 1,085,500 | 4,841,330.0<br>0 | 0.71 |
| 23 | 601728 | 中国电信         | 904,300   | 4,693,317.0<br>0 | 0.68 |
| 24 | 688549 | 中巨芯科技        | 123,501   | 4,546,071.8<br>1 | 0.66 |
| 25 | 688008 | 澜起科技         | 14,238    | 4,412,356.2<br>0 | 0.64 |
| 26 | 688200 | 华峰测控         | 8,194     | 4,302,669.4<br>0 | 0.63 |
| 27 | 600030 | 中信证券         | 145,000   | 4,165,850.0<br>0 | 0.61 |
| 28 | 601166 | 兴业银行         | 249,300   | 4,128,408.0<br>0 | 0.60 |
| 29 | 688521 | 芯原微电子        | 10,412    | 3,864,309.6<br>8 | 0.56 |
| 30 | 600276 | 恒瑞医药         | 69,700    | 3,627,188.0<br>0 | 0.53 |
| 31 | 600549 | 厦门钨业         | 42,300    | 3,603,960.0<br>0 | 0.53 |
| 32 | 603993 | 洛阳钼业         | 198,473   | 3,483,201.1<br>5 | 0.51 |
| 33 | 688001 | 苏州华兴源<br>创科技 | 39,509    | 3,385,921.3<br>0 | 0.49 |
| 34 | 600989 | 宝丰能源         | 164,500   | 3,344,285.0<br>0 | 0.49 |
| 35 | 688519 | 南亚新材料        | 8,555     | 3,251,242.2<br>0 | 0.47 |
| 36 | 600522 | 中天科技         | 53,500    | 3,246,380.0<br>0 | 0.47 |
| 37 | 603986 | 兆易创新         | 3,900     | 3,178,500.0<br>0 | 0.46 |
| 38 | 601998 | 中信银行         | 456,900   | 3,166,317.0<br>0 | 0.46 |

|    |        |         |         |                  |      |
|----|--------|---------|---------|------------------|------|
| 39 | 603989 | 艾华集团    | 58,900  | 3,092,250.0<br>0 | 0.45 |
| 40 | 600160 | 巨化股份    | 56,200  | 2,979,162.0<br>0 | 0.43 |
| 41 | 601066 | 中信建投    | 101,700 | 2,956,419.0<br>0 | 0.43 |
| 42 | 600406 | 国电南瑞    | 127,500 | 2,913,375.0<br>0 | 0.43 |
| 43 | 688515 | 裕太微电子   | 11,349  | 2,823,177.2<br>4 | 0.41 |
| 44 | 600000 | 浦发银行    | 319,900 | 2,754,339.0<br>0 | 0.40 |
| 45 | 601211 | 国泰海通    | 151,102 | 2,750,056.4<br>0 | 0.40 |
| 46 | 600584 | 长电科技    | 25,900  | 2,681,945.0<br>0 | 0.39 |
| 47 | 688419 | 耐科装备    | 33,378  | 2,625,179.7<br>0 | 0.38 |
| 48 | 688380 | 中微半导    | 39,254  | 2,587,231.1<br>4 | 0.38 |
| 49 | 601319 | 中国人保    | 380,300 | 2,570,828.0<br>0 | 0.38 |
| 50 | 601601 | 中国太保    | 89,100  | 2,541,132.0<br>0 | 0.37 |
| 51 | 605118 | 力鼎光电    | 68,400  | 2,386,476.0<br>0 | 0.35 |
| 52 | 688002 | 睿创微纳    | 15,418  | 2,385,010.4<br>2 | 0.35 |
| 53 | 688677 | 青岛海泰新光  | 23,561  | 2,382,723.9<br>3 | 0.35 |
| 54 | 600309 | 万华化学    | 34,600  | 2,366,986.0<br>0 | 0.35 |
| 55 | 601225 | 陕西煤业    | 115,564 | 2,351,727.4<br>0 | 0.34 |
| 56 | 688295 | 中复神鹰碳纤维 | 37,972  | 2,298,824.8<br>8 | 0.34 |
| 57 | 601816 | 京沪高铁    | 503,300 | 2,279,949.0<br>0 | 0.33 |
| 58 | 600919 | 江苏银行    | 209,500 | 2,258,410.0<br>0 | 0.33 |
| 59 | 601939 | 建设银行    | 231,700 | 2,231,271.0<br>0 | 0.33 |
| 60 | 603380 | 易德龙     | 48,700  | 2,195,883.0<br>0 | 0.32 |

|    |        |       |           |                  |      |
|----|--------|-------|-----------|------------------|------|
| 61 | 688103 | 国力电子  | 28,791    | 2,142,338.3<br>1 | 0.31 |
| 62 | 603288 | 海天味业  | 63,600    | 2,108,976.0<br>0 | 0.31 |
| 63 | 688072 | 拓荆科技  | 2,480     | 2,063,360.0<br>0 | 0.30 |
| 64 | 688069 | 德林海环保 | 54,904    | 2,051,213.4<br>4 | 0.30 |
| 65 | 688668 | 鼎通科技  | 5,486     | 2,047,923.8<br>0 | 0.30 |
| 66 | 601919 | 中远海控  | 154,400   | 2,047,344.0<br>0 | 0.30 |
| 67 | 601668 | 中国建筑  | 467,900   | 2,030,686.0<br>0 | 0.30 |
| 68 | 601985 | 中国核电  | 224,700   | 2,029,041.0<br>0 | 0.30 |
| 69 | 600909 | 华安证券  | 180,200   | 2,002,022.0<br>0 | 0.29 |
| 70 | 603267 | 鸿远电子  | 25,600    | 1,983,488.0<br>0 | 0.29 |
| 71 | 601336 | 新华保险  | 32,100    | 1,915,086.0<br>0 | 0.28 |
| 72 | 600641 | 先导基电  | 47,900    | 1,909,294.0<br>0 | 0.28 |
| 73 | 600999 | 招商证券  | 88,700    | 1,871,570.0<br>0 | 0.27 |
| 74 | 688512 | 慧智微电子 | 116,973   | 1,868,058.8<br>1 | 0.27 |
| 75 | 600176 | 中国巨石  | 25,300    | 1,843,864.0<br>0 | 0.27 |
| 76 | 688207 | 格灵深瞳  | 91,286    | 1,834,848.6<br>0 | 0.27 |
| 77 | 603678 | 火炬电子  | 22,100    | 1,834,300.0<br>0 | 0.27 |
| 78 | 601818 | 光大银行  | 634,100   | 1,832,549.0<br>0 | 0.27 |
| 79 | 601005 | 重庆钢铁  | 1,573,000 | 1,824,680.0<br>0 | 0.27 |
| 80 | 600025 | 华能水电  | 204,200   | 1,815,338.0<br>0 | 0.26 |
| 81 | 600887 | 伊利股份  | 75,200    | 1,801,792.0<br>0 | 0.26 |
| 82 | 688052 | 纳芯微电子 | 6,139     | 1,769,935.0<br>9 | 0.26 |

|     |        |              |         |                  |      |
|-----|--------|--------------|---------|------------------|------|
| 83  | 600497 | 驰宏锌锗         | 143,400 | 1,736,574.0<br>0 | 0.25 |
| 84  | 601012 | 隆基绿能         | 129,600 | 1,700,352.0<br>0 | 0.25 |
| 85  | 688261 | 东微半导体        | 15,733  | 1,650,863.6<br>9 | 0.24 |
| 86  | 601009 | 南京银行         | 164,300 | 1,624,927.0<br>0 | 0.24 |
| 87  | 601168 | 西部矿业         | 59,600  | 1,617,544.0<br>0 | 0.24 |
| 88  | 688981 | 中芯国际         | 10,162  | 1,613,928.8<br>4 | 0.24 |
| 89  | 688020 | 方邦股份         | 6,460   | 1,612,416.0<br>0 | 0.24 |
| 90  | 688702 | 盛科通信         | 4,074   | 1,588,819.2<br>6 | 0.23 |
| 91  | 600031 | 三一重工         | 90,300  | 1,560,384.0<br>0 | 0.23 |
| 92  | 600186 | 莲花控股         | 110,900 | 1,552,600.0<br>0 | 0.23 |
| 93  | 600690 | 海尔智家         | 75,700  | 1,545,037.0<br>0 | 0.23 |
| 94  | 688188 | 上海柏楚电<br>子科技 | 14,457  | 1,542,561.9<br>0 | 0.23 |
| 95  | 600739 | 辽宁成大         | 150,700 | 1,523,577.0<br>0 | 0.22 |
| 96  | 600547 | 山东黄金         | 65,500  | 1,512,395.0<br>0 | 0.22 |
| 97  | 600936 | 北投科技         | 349,100 | 1,501,130.0<br>0 | 0.22 |
| 98  | 600150 | 中国船舶         | 44,414  | 1,500,749.0<br>6 | 0.22 |
| 99  | 603050 | 科林电气         | 76,200  | 1,490,472.0<br>0 | 0.22 |
| 100 | 601065 | 江西省盐业<br>集团  | 221,281 | 1,484,795.5<br>1 | 0.22 |
| 101 | 600875 | 东方电气         | 51,300  | 1,475,901.0<br>0 | 0.22 |
| 102 | 603501 | 豪威集团         | 15,300  | 1,451,205.0<br>0 | 0.21 |
| 103 | 688158 | 优刻得科技        | 39,278  | 1,443,859.2<br>8 | 0.21 |
| 104 | 600809 | 山西汾酒         | 13,200  | 1,443,684.0<br>0 | 0.21 |

|     |        |         |         |                  |      |
|-----|--------|---------|---------|------------------|------|
| 105 | 601229 | 上海银行    | 165,900 | 1,440,012.0<br>0 | 0.21 |
| 106 | 688027 | 科大国盾量子  | 2,855   | 1,438,948.5<br>5 | 0.21 |
| 107 | 601898 | 中煤能源    | 117,700 | 1,433,586.0<br>0 | 0.21 |
| 108 | 601366 | 利群股份    | 443,500 | 1,432,505.0<br>0 | 0.21 |
| 109 | 601766 | 中国中车    | 272,300 | 1,415,960.0<br>0 | 0.21 |
| 110 | 601633 | 长城汽车    | 92,400  | 1,394,316.0<br>0 | 0.20 |
| 111 | 600050 | 中国联通    | 347,400 | 1,389,600.0<br>0 | 0.20 |
| 112 | 601958 | 金钼股份    | 48,900  | 1,374,579.0<br>0 | 0.20 |
| 113 | 600038 | 中直股份    | 54,000  | 1,365,660.0<br>0 | 0.20 |
| 114 | 600019 | 宝钢股份    | 250,900 | 1,362,387.0<br>0 | 0.20 |
| 115 | 603256 | 宏和科技    | 5,100   | 1,353,183.0<br>0 | 0.20 |
| 116 | 603519 | 立霸股份    | 88,100  | 1,347,930.0<br>0 | 0.20 |
| 117 | 688182 | 灿勤科技    | 31,013  | 1,335,729.9<br>1 | 0.19 |
| 118 | 688506 | 百利天恒药业  | 4,508   | 1,325,487.2<br>4 | 0.19 |
| 119 | 688183 | 生益电子    | 10,006  | 1,324,794.4<br>0 | 0.19 |
| 120 | 600089 | 特变电工    | 58,400  | 1,314,000.0<br>0 | 0.19 |
| 121 | 688681 | 科汇电力自动化 | 92,993  | 1,300,042.1<br>4 | 0.19 |
| 122 | 603328 | 依顿电子    | 102,800 | 1,288,084.0<br>0 | 0.19 |
| 123 | 600104 | 上汽集团    | 131,200 | 1,280,512.0<br>0 | 0.19 |
| 124 | 600075 | 新疆天业    | 315,300 | 1,273,812.0<br>0 | 0.19 |
| 125 | 688629 | 四川华丰科技  | 6,695   | 1,255,379.4<br>5 | 0.18 |
| 126 | 688508 | 芯朋微电子   | 13,440  | 1,249,382.4<br>0 | 0.18 |

|     |        |         |         |                  |      |
|-----|--------|---------|---------|------------------|------|
| 127 | 603893 | 瑞芯微     | 6,600   | 1,243,176.0<br>0 | 0.18 |
| 128 | 600029 | 南方航空    | 239,500 | 1,240,610.0<br>0 | 0.18 |
| 129 | 688259 | 创耀通信科技  | 31,684  | 1,239,478.0<br>8 | 0.18 |
| 130 | 688213 | 思特威电子科技 | 11,524  | 1,233,874.6<br>8 | 0.18 |
| 131 | 600330 | 天通股份    | 39,920  | 1,231,132.8<br>0 | 0.18 |
| 132 | 600926 | 杭州银行    | 85,000  | 1,228,250.0<br>0 | 0.18 |
| 133 | 600699 | 均胜电子    | 56,700  | 1,225,287.0<br>0 | 0.18 |
| 134 | 603085 | 天成自控    | 112,200 | 1,219,614.0<br>0 | 0.18 |
| 135 | 600018 | 上港集团    | 258,200 | 1,218,704.0<br>0 | 0.18 |
| 136 | 603936 | 博敏电子    | 45,400  | 1,212,634.0<br>0 | 0.18 |
| 137 | 600760 | 中航沈飞    | 29,500  | 1,212,450.0<br>0 | 0.18 |
| 137 | 601600 | 中国铝业    | 147,500 | 1,212,450.0<br>0 | 0.18 |
| 139 | 603019 | 中科曙光    | 11,300  | 1,211,699.0<br>0 | 0.18 |
| 140 | 603661 | 恒林股份    | 29,800  | 1,192,000.0<br>0 | 0.17 |
| 141 | 600115 | 中国东航    | 309,400 | 1,178,814.0<br>0 | 0.17 |
| 142 | 600116 | 三峡水利    | 208,700 | 1,168,720.0<br>0 | 0.17 |
| 143 | 600015 | 华夏银行    | 182,400 | 1,165,536.0<br>0 | 0.17 |
| 144 | 600660 | 福耀玻璃    | 23,000  | 1,160,120.0<br>0 | 0.17 |
| 145 | 601169 | 北京银行    | 236,200 | 1,157,380.0<br>0 | 0.17 |
| 146 | 600886 | 国投电力    | 86,700  | 1,153,977.0<br>0 | 0.17 |
| 147 | 600905 | 三峡能源    | 310,700 | 1,152,697.0<br>0 | 0.17 |
| 148 | 601727 | 上海电气    | 164,100 | 1,148,700.0<br>0 | 0.17 |

|     |        |             |         |                  |      |
|-----|--------|-------------|---------|------------------|------|
| 149 | 600590 | 泰豪科技        | 113,400 | 1,145,340.0<br>0 | 0.17 |
| 150 | 601375 | 中原证券        | 284,800 | 1,136,352.0<br>0 | 0.17 |
| 151 | 600642 | 申能股份        | 129,200 | 1,127,916.0<br>0 | 0.16 |
| 152 | 601991 | 大唐发电        | 158,500 | 1,122,180.0<br>0 | 0.16 |
| 153 | 600166 | 福田汽车        | 384,500 | 1,118,895.0<br>0 | 0.16 |
| 154 | 600346 | 恒力石化        | 62,700  | 1,110,417.0<br>0 | 0.16 |
| 155 | 600489 | 中金黄金        | 61,200  | 1,104,660.0<br>0 | 0.16 |
| 156 | 601528 | 瑞丰银行        | 249,000 | 1,100,580.0<br>0 | 0.16 |
| 157 | 603005 | 晶方科技        | 20,400  | 1,098,948.0<br>0 | 0.16 |
| 158 | 601607 | 上海医药        | 71,100  | 1,094,940.0<br>0 | 0.16 |
| 159 | 688025 | 杰普特光电       | 2,304   | 1,082,880.0<br>0 | 0.16 |
| 160 | 600512 | 腾达建设        | 578,500 | 1,081,795.0<br>0 | 0.16 |
| 161 | 603323 | 苏农银行        | 278,687 | 1,078,518.6<br>9 | 0.16 |
| 162 | 688093 | 世华科技        | 28,924  | 1,067,295.6<br>0 | 0.16 |
| 163 | 601688 | 华泰证券        | 51,500  | 1,061,930.0<br>0 | 0.15 |
| 164 | 688202 | 美迪西生物<br>医药 | 13,052  | 1,053,426.9<br>2 | 0.15 |
| 165 | 688566 | 吉贝尔药业       | 40,970  | 1,048,422.3<br>0 | 0.15 |
| 166 | 601877 | 正泰电器        | 41,800  | 1,047,926.0<br>0 | 0.15 |
| 167 | 600378 | 昊华科技        | 13,900  | 1,047,782.0<br>0 | 0.15 |
| 168 | 688063 | 派能科技        | 19,474  | 1,037,379.9<br>8 | 0.15 |
| 169 | 600893 | 航发动力        | 26,900  | 1,031,346.0<br>0 | 0.15 |
| 170 | 603916 | 苏博特         | 75,100  | 1,025,866.0<br>0 | 0.15 |

|     |        |        |         |                  |      |
|-----|--------|--------|---------|------------------|------|
| 171 | 688111 | 金山办公   | 4,801   | 1,022,853.0<br>5 | 0.15 |
| 172 | 600499 | 科达制造   | 73,900  | 1,019,820.0<br>0 | 0.15 |
| 173 | 603167 | 渤海轮渡   | 118,800 | 1,018,116.0<br>0 | 0.15 |
| 174 | 601995 | 中金公司   | 28,100  | 1,015,815.0<br>0 | 0.15 |
| 175 | 688550 | 瑞联新材料  | 17,512  | 1,013,069.2<br>0 | 0.15 |
| 176 | 600011 | 华能国际   | 133,000 | 1,009,470.0<br>0 | 0.15 |
| 177 | 600210 | 紫江企业   | 161,900 | 1,003,780.0<br>0 | 0.15 |
| 178 | 600415 | 小商品城   | 98,700  | 1,002,792.0<br>0 | 0.15 |
| 179 | 605499 | 东鹏饮料   | 8,106   | 1,000,523.5<br>8 | 0.15 |
| 180 | 601669 | 中国电建   | 212,700 | 999,690.00       | 0.15 |
| 181 | 688114 | 华大智造   | 19,570  | 999,635.60       | 0.15 |
| 182 | 688390 | 固德威电源  | 9,108   | 988,309.08       | 0.14 |
| 183 | 600500 | 中化国际   | 126,200 | 988,146.00       | 0.14 |
| 184 | 601881 | 中国银河   | 78,500  | 986,745.00       | 0.14 |
| 185 | 600177 | 雅戈尔    | 130,100 | 979,653.00       | 0.14 |
| 186 | 600064 | 南京高科   | 137,100 | 977,523.00       | 0.14 |
| 187 | 688113 | 联测科技   | 27,838  | 977,113.80       | 0.14 |
| 188 | 688123 | 聚辰半导体  | 4,564   | 970,306.40       | 0.14 |
| 189 | 600795 | 国电电力   | 207,200 | 967,624.00       | 0.14 |
| 190 | 688689 | 常州银河微电 | 14,938  | 966,787.36       | 0.14 |
| 191 | 600675 | 中华企业   | 469,100 | 966,346.00       | 0.14 |
| 192 | 600111 | 北方稀土   | 20,000  | 961,000.00       | 0.14 |
| 193 | 600716 | 凤凰股份   | 285,100 | 957,936.00       | 0.14 |
| 194 | 600098 | 广州发展   | 162,000 | 957,420.00       | 0.14 |
| 195 | 603317 | 天味食品   | 73,500  | 956,235.00       | 0.14 |
| 196 | 601127 | 赛力斯    | 15,600  | 955,500.00       | 0.14 |
| 197 | 600352 | 浙江龙盛   | 78,900  | 955,479.00       | 0.14 |
| 198 | 603160 | 汇顶科技   | 15,400  | 950,334.00       | 0.14 |
| 199 | 601677 | 明泰铝业   | 56,700  | 941,220.00       | 0.14 |
| 200 | 600332 | 白云山    | 46,900  | 939,876.00       | 0.14 |
| 201 | 601901 | 方正证券   | 130,100 | 936,720.00       | 0.14 |
| 202 | 603199 | 九华旅游   | 29,700  | 925,452.00       | 0.14 |
| 203 | 603797 | 联泰环保   | 246,600 | 924,750.00       | 0.13 |

|     |        |        |         |            |      |
|-----|--------|--------|---------|------------|------|
| 204 | 603071 | 物产环能   | 83,500  | 923,510.00 | 0.13 |
| 205 | 601577 | 长沙银行   | 105,800 | 921,518.00 | 0.13 |
| 206 | 688077 | 大地熊新材料 | 34,669  | 918,381.81 | 0.13 |
| 207 | 601108 | 财通证券   | 106,000 | 916,900.00 | 0.13 |
| 208 | 688533 | 上声电子股份 | 43,726  | 912,124.36 | 0.13 |
| 209 | 688558 | 国盛智科股份 | 27,489  | 903,288.54 | 0.13 |
| 210 | 600061 | 国投资本   | 137,800 | 902,590.00 | 0.13 |
| 211 | 688023 | 安恒信息   | 24,529  | 900,704.88 | 0.13 |
| 212 | 601868 | 中国能建   | 336,900 | 899,523.00 | 0.13 |
| 213 | 603166 | 福达股份   | 67,200  | 898,464.00 | 0.13 |
| 214 | 688080 | 映翰通网络  | 20,691  | 894,885.75 | 0.13 |
| 215 | 601018 | 宁波港    | 283,800 | 893,970.00 | 0.13 |
| 216 | 603195 | 公牛集团   | 22,675  | 887,726.25 | 0.13 |
| 217 | 600563 | 法拉电子   | 4,600   | 877,680.00 | 0.13 |
| 218 | 603920 | 世运电路   | 18,200  | 874,328.00 | 0.13 |
| 219 | 603057 | 上海紫燕食品 | 39,200  | 874,160.00 | 0.13 |
| 220 | 600496 | 精工钢构   | 281,200 | 871,720.00 | 0.13 |
| 221 | 601880 | 辽港股份   | 626,500 | 864,570.00 | 0.13 |
| 222 | 688015 | 交控科技   | 56,152  | 863,617.76 | 0.13 |
| 223 | 603444 | 吉比特    | 2,400   | 860,208.00 | 0.13 |
| 224 | 600585 | 海螺水泥   | 50,600  | 857,670.00 | 0.13 |
| 225 | 688616 | 西力科技   | 84,820  | 856,682.00 | 0.13 |
| 226 | 601226 | 华电科工   | 134,200 | 853,512.00 | 0.12 |
| 227 | 601555 | 东吴证券   | 107,700 | 852,984.00 | 0.12 |
| 228 | 605168 | 三人行    | 16,745  | 847,966.80 | 0.12 |
| 229 | 605020 | 永和股份   | 20,800  | 846,976.00 | 0.12 |
| 230 | 688106 | 金宏气体   | 20,412  | 846,689.76 | 0.12 |
| 231 | 601963 | 重庆银行   | 83,400  | 840,672.00 | 0.12 |
| 232 | 600282 | 南钢股份   | 182,900 | 839,511.00 | 0.12 |
| 233 | 600741 | 华域汽车   | 53,800  | 834,976.00 | 0.12 |
| 234 | 600310 | 广西能源   | 196,000 | 827,120.00 | 0.12 |
| 235 | 688799 | 华纳大药厂  | 18,318  | 821,928.66 | 0.12 |
| 236 | 600908 | 无锡银行   | 161,700 | 821,436.00 | 0.12 |
| 237 | 688686 | 奥普特科技  | 4,865   | 819,217.35 | 0.12 |
| 238 | 603663 | 三祥新材   | 8,500   | 818,550.00 | 0.12 |
| 239 | 605006 | 山东玻纤   | 38,600  | 814,074.00 | 0.12 |
| 240 | 600188 | 兖矿能源   | 45,480  | 808,179.60 | 0.12 |
| 241 | 601390 | 中国中铁   | 193,600 | 807,312.00 | 0.12 |
| 242 | 603038 | 华立股份   | 51,300  | 800,280.00 | 0.12 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 243 | 600020 | 中原高速  | 216,500 | 798,885.00 | 0.12 |
| 244 | 688112 | 鼎阳科技  | 10,745  | 789,327.70 | 0.12 |
| 245 | 600016 | 民生银行  | 244,700 | 787,934.00 | 0.11 |
| 246 | 603118 | 共进股份  | 65,009  | 787,258.99 | 0.11 |
| 247 | 600037 | 歌华有线  | 125,100 | 784,377.00 | 0.11 |
| 248 | 600109 | 国金证券  | 89,200  | 783,176.00 | 0.11 |
| 249 | 600269 | 赣粤高速  | 195,900 | 779,682.00 | 0.11 |
| 250 | 601128 | 常熟银行  | 131,070 | 762,827.40 | 0.11 |
| 251 | 600004 | 白云机场  | 104,800 | 760,848.00 | 0.11 |
| 252 | 603187 | 海容冷链  | 66,100  | 759,489.00 | 0.11 |
| 253 | 601117 | 中国化学  | 102,900 | 756,315.00 | 0.11 |
| 254 | 600048 | 保利发展  | 158,900 | 735,707.00 | 0.11 |
| 255 | 688428 | 诺诚健华  | 25,839  | 735,636.33 | 0.11 |
| 256 | 600035 | 楚天高速  | 217,600 | 733,312.00 | 0.11 |
| 257 | 603799 | 华友钴业  | 15,000  | 723,900.00 | 0.11 |
| 258 | 603379 | 三美股份  | 9,500   | 720,955.00 | 0.11 |
| 259 | 603927 | 中科软   | 56,280  | 715,318.80 | 0.10 |
| 260 | 603197 | 保隆科技  | 25,500  | 712,470.00 | 0.10 |
| 261 | 600776 | 东方通信  | 54,200  | 712,188.00 | 0.10 |
| 262 | 601006 | 大秦铁路  | 154,200 | 710,862.00 | 0.10 |
| 263 | 600339 | 中油工程  | 230,000 | 706,100.00 | 0.10 |
| 264 | 600420 | 国药现代  | 88,605  | 704,409.75 | 0.10 |
| 265 | 688100 | 威胜信息  | 22,873  | 699,685.07 | 0.10 |
| 266 | 688163 | 赛伦生物  | 14,185  | 692,369.85 | 0.10 |
| 267 | 601101 | 昊华能源  | 65,300  | 689,568.00 | 0.10 |
| 268 | 600469 | 风神股份  | 125,800 | 684,352.00 | 0.10 |
| 269 | 688105 | 诺唯赞生物 | 39,443  | 684,336.05 | 0.10 |
| 270 | 688208 | 道通科技  | 27,157  | 684,084.83 | 0.10 |
| 271 | 600863 | 华能蒙电  | 144,900 | 681,030.00 | 0.10 |
| 272 | 688416 | 恒烁股份  | 4,852   | 679,280.00 | 0.10 |
| 273 | 688557 | 兰剑智能  | 21,805  | 676,609.15 | 0.10 |
| 274 | 600988 | 赤峰黄金  | 25,500  | 671,160.00 | 0.10 |
| 275 | 688267 | 中触媒股份 | 33,540  | 660,738.00 | 0.10 |
| 276 | 688653 | 康希通信  | 37,888  | 658,493.44 | 0.10 |
| 277 | 600392 | 盛和资源  | 22,100  | 657,917.00 | 0.10 |
| 278 | 601860 | 紫金银行  | 271,200 | 656,304.00 | 0.10 |
| 279 | 603111 | 康尼机电  | 115,600 | 654,296.00 | 0.10 |
| 280 | 600803 | 新奥股份  | 41,400  | 654,120.00 | 0.10 |
| 281 | 600918 | 中泰证券  | 122,400 | 651,168.00 | 0.10 |
| 282 | 600961 | 株冶集团  | 20,100  | 651,039.00 | 0.09 |
| 283 | 600517 | 国网英大  | 138,800 | 649,584.00 | 0.09 |
| 284 | 600032 | 浙江新能  | 91,900  | 647,895.00 | 0.09 |
| 285 | 603297 | 永新光学  | 4,400   | 646,580.00 | 0.09 |

|     |        |         |         |            |      |
|-----|--------|---------|---------|------------|------|
| 286 | 601100 | 恒立液压    | 6,000   | 645,360.00 | 0.09 |
| 287 | 600997 | 开滦股份    | 134,000 | 636,500.00 | 0.09 |
| 288 | 688223 | 晶科能源    | 132,333 | 628,581.75 | 0.09 |
| 289 | 688355 | 明志科技    | 32,635  | 628,223.75 | 0.09 |
| 290 | 601825 | 沪农商行    | 83,700  | 626,913.00 | 0.09 |
| 291 | 601997 | 贵阳银行    | 122,000 | 625,860.00 | 0.09 |
| 292 | 603885 | 吉祥航空    | 60,700  | 624,603.00 | 0.09 |
| 293 | 603876 | 鼎胜新材    | 24,000  | 624,240.00 | 0.09 |
| 294 | 603311 | 金海高科    | 17,000  | 623,050.00 | 0.09 |
| 295 | 603310 | 巍华新材    | 42,300  | 621,387.00 | 0.09 |
| 296 | 603558 | 健盛集团    | 55,800  | 618,822.00 | 0.09 |
| 297 | 600995 | 南网储能    | 50,100  | 616,230.00 | 0.09 |
| 298 | 603105 | 芯能科技    | 90,200  | 614,262.00 | 0.09 |
| 299 | 603309 | 维力医疗    | 54,400  | 610,368.00 | 0.09 |
| 300 | 600623 | 华谊集团    | 75,400  | 608,478.00 | 0.09 |
| 301 | 603713 | 密尔克卫    | 8,500   | 604,945.00 | 0.09 |
| 302 | 688006 | 浙江杭可科技  | 16,470  | 601,978.50 | 0.09 |
| 303 | 600266 | 城建发展    | 153,800 | 601,358.00 | 0.09 |
| 304 | 688249 | 晶合集成    | 10,172  | 600,453.16 | 0.09 |
| 305 | 601827 | 三峰环境    | 82,200  | 597,594.00 | 0.09 |
| 306 | 688526 | 武汉科前生物  | 48,524  | 587,140.40 | 0.09 |
| 307 | 688185 | 康希诺生物   | 11,467  | 584,702.33 | 0.09 |
| 308 | 600867 | 通化东宝    | 72,400  | 582,096.00 | 0.08 |
| 309 | 600548 | 深高速     | 71,500  | 581,295.00 | 0.08 |
| 310 | 688439 | 振华风光    | 12,581  | 581,242.20 | 0.08 |
| 311 | 603368 | 柳药集团    | 39,400  | 577,998.00 | 0.08 |
| 312 | 603456 | 九洲药业    | 42,200  | 576,452.00 | 0.08 |
| 313 | 603416 | 信捷电气    | 10,900  | 576,283.00 | 0.08 |
| 314 | 688126 | 上海硅产业集团 | 14,443  | 576,131.27 | 0.08 |
| 315 | 603383 | 顶点软件    | 21,656  | 575,183.36 | 0.08 |
| 316 | 600261 | 阳光照明    | 186,700 | 575,036.00 | 0.08 |
| 317 | 600985 | 淮北矿业    | 40,600  | 570,430.00 | 0.08 |
| 318 | 600114 | 东睦股份    | 15,100  | 570,176.00 | 0.08 |
| 319 | 600998 | 九州通     | 120,786 | 566,486.34 | 0.08 |
| 320 | 601368 | 绿城水务    | 138,300 | 565,647.00 | 0.08 |
| 321 | 600598 | 北大荒     | 52,100  | 564,764.00 | 0.08 |
| 322 | 600885 | 宏发股份    | 16,280  | 561,497.20 | 0.08 |
| 323 | 688459 | 哈铁科技    | 67,252  | 560,209.16 | 0.08 |
| 324 | 600377 | 宁沪高速    | 48,000  | 555,360.00 | 0.08 |
| 325 | 600966 | 博汇纸业    | 115,800 | 553,524.00 | 0.08 |

|     |        |          |         |            |      |
|-----|--------|----------|---------|------------|------|
| 326 | 603788 | 宁波高发     | 40,100  | 553,380.00 | 0.08 |
| 327 | 603018 | 华设集团     | 107,060 | 550,288.40 | 0.08 |
| 328 | 603387 | 基蛋生物     | 72,600  | 548,856.00 | 0.08 |
| 329 | 601111 | 中国国航     | 90,400  | 546,920.00 | 0.08 |
| 330 | 603995 | 甬金股份     | 23,400  | 543,114.00 | 0.08 |
| 331 | 603578 | 三星新材     | 46,200  | 542,850.00 | 0.08 |
| 332 | 603390 | 通达电气     | 51,800  | 540,792.00 | 0.08 |
| 333 | 600009 | 上海机场     | 23,400  | 540,540.00 | 0.08 |
| 334 | 600655 | 豫园股份     | 129,800 | 533,478.00 | 0.08 |
| 335 | 603897 | 长城科技     | 16,400  | 532,344.00 | 0.08 |
| 336 | 603237 | 五芳斋实业    | 42,700  | 528,626.00 | 0.08 |
| 337 | 600583 | 海油工程     | 104,500 | 525,635.00 | 0.08 |
| 338 | 603345 | 安井食品     | 6,500   | 521,235.00 | 0.08 |
| 339 | 601882 | 海天精工     | 25,700  | 519,911.00 | 0.08 |
| 340 | 600845 | 宝信软件     | 31,140  | 517,858.20 | 0.08 |
| 341 | 603982 | 泉峰汽车     | 91,900  | 513,721.00 | 0.07 |
| 342 | 603025 | 大豪科技     | 37,500  | 511,500.00 | 0.07 |
| 343 | 688552 | 航天南湖     | 18,110  | 509,434.30 | 0.07 |
| 344 | 603500 | 祥和实业     | 43,800  | 508,956.00 | 0.07 |
| 345 | 688180 | 君实生物     | 15,025  | 508,145.50 | 0.07 |
| 346 | 600131 | 国网信通     | 34,700  | 506,620.00 | 0.07 |
| 347 | 688819 | 天能电池集团股份 | 22,810  | 506,382.00 | 0.07 |
| 348 | 600372 | 中航机载     | 46,600  | 505,610.00 | 0.07 |
| 349 | 600251 | 冠农股份     | 58,500  | 505,440.00 | 0.07 |
| 350 | 688222 | 成都先导     | 15,658  | 502,778.38 | 0.07 |
| 351 | 600763 | 通策医疗     | 14,822  | 502,169.36 | 0.07 |
| 352 | 688132 | 邦彦技术股份   | 37,854  | 497,780.10 | 0.07 |
| 353 | 688067 | 爱威科技     | 24,687  | 497,443.05 | 0.07 |
| 354 | 600600 | 青岛啤酒     | 9,500   | 496,185.00 | 0.07 |
| 355 | 600410 | 华胜天成     | 31,000  | 490,730.00 | 0.07 |
| 356 | 600449 | 宁夏建材     | 43,500  | 486,330.00 | 0.07 |
| 357 | 688029 | 南微医学科技   | 6,682   | 479,767.60 | 0.07 |
| 358 | 600132 | 重庆啤酒     | 11,600  | 479,080.00 | 0.07 |
| 359 | 688619 | 罗普特科技    | 29,486  | 478,557.78 | 0.07 |
| 360 | 688060 | 江苏云涌电子科技 | 14,539  | 478,187.71 | 0.07 |
| 361 | 688391 | 钜泉科技     | 13,284  | 476,497.08 | 0.07 |
| 362 | 603170 | 宝立食品科技   | 42,100  | 475,730.00 | 0.07 |
| 363 | 688187 | 时代电气     | 6,904   | 474,028.64 | 0.07 |

|     |        |          |         |            |      |
|-----|--------|----------|---------|------------|------|
| 364 | 601788 | 光大证券     | 32,700  | 471,861.00 | 0.07 |
| 365 | 688571 | 杭华油墨股份   | 53,915  | 471,756.25 | 0.07 |
| 366 | 688271 | 联影医疗     | 4,658   | 471,529.34 | 0.07 |
| 367 | 688591 | 泰凌微      | 13,629  | 468,565.02 | 0.07 |
| 368 | 601158 | 重庆水务     | 120,100 | 463,586.00 | 0.07 |
| 369 | 603330 | 天洋新材     | 59,800  | 462,852.00 | 0.07 |
| 370 | 600196 | 复星医药     | 20,500  | 460,635.00 | 0.07 |
| 371 | 600562 | 国睿科技     | 21,700  | 460,474.00 | 0.07 |
| 372 | 600307 | 酒钢宏兴     | 331,100 | 460,229.00 | 0.07 |
| 373 | 601163 | 三角轮胎     | 36,200  | 459,378.00 | 0.07 |
| 374 | 601808 | 中海油服     | 42,300  | 457,263.00 | 0.07 |
| 375 | 605123 | 派克新材     | 4,700   | 455,947.00 | 0.07 |
| 376 | 600780 | 通宝能源     | 77,600  | 454,736.00 | 0.07 |
| 377 | 603766 | 隆鑫通用     | 37,900  | 452,147.00 | 0.07 |
| 378 | 603899 | 晨光股份     | 21,900  | 451,797.00 | 0.07 |
| 379 | 600987 | 航民股份     | 74,600  | 451,330.00 | 0.07 |
| 380 | 600323 | 瀚蓝环境     | 16,400  | 450,344.00 | 0.07 |
| 381 | 603700 | 宁水集团     | 38,300  | 444,663.00 | 0.06 |
| 382 | 603213 | 镇洋发展     | 32,100  | 443,943.00 | 0.06 |
| 383 | 600827 | 百联股份     | 59,900  | 443,859.00 | 0.06 |
| 384 | 601198 | 东兴证券     | 32,600  | 443,034.00 | 0.06 |
| 385 | 603737 | 三棵树      | 18,220  | 439,102.00 | 0.06 |
| 386 | 600862 | 中航高科     | 24,300  | 438,129.00 | 0.06 |
| 387 | 603707 | 健友股份     | 61,700  | 436,219.00 | 0.06 |
| 388 | 600597 | 光明乳业     | 71,700  | 435,219.00 | 0.06 |
| 389 | 688538 | 和辉光电     | 167,151 | 434,592.60 | 0.06 |
| 390 | 688363 | 华熙生物     | 12,093  | 432,566.61 | 0.06 |
| 391 | 603867 | 新化股份     | 12,900  | 432,021.00 | 0.06 |
| 392 | 605258 | 协和电子     | 12,700  | 430,276.00 | 0.06 |
| 393 | 601866 | 中远海发     | 193,700 | 428,077.00 | 0.06 |
| 394 | 600436 | 片仔癀      | 3,900   | 426,192.00 | 0.06 |
| 395 | 603569 | 长久物流     | 80,000  | 424,000.00 | 0.06 |
| 396 | 601003 | 柳钢股份     | 125,700 | 423,609.00 | 0.06 |
| 397 | 688798 | 艾为电子     | 5,736   | 420,563.52 | 0.06 |
| 398 | 600643 | 爱建集团     | 113,300 | 420,343.00 | 0.06 |
| 399 | 601096 | 宏盛华源铁塔集团 | 96,500  | 418,810.00 | 0.06 |
| 400 | 603639 | 海利尔      | 40,687  | 403,615.04 | 0.06 |
| 401 | 688522 | 纳睿雷达科技   | 20,136  | 403,122.72 | 0.06 |
| 402 | 603728 | 鸣志电器     | 6,600   | 402,072.00 | 0.06 |
| 403 | 603006 | 联明股份     | 28,200  | 401,850.00 | 0.06 |

|     |        |         |         |            |      |
|-----|--------|---------|---------|------------|------|
| 404 | 600732 | 爱旭股份    | 29,000  | 401,650.00 | 0.06 |
| 405 | 688636 | 智明达电子   | 11,042  | 400,051.66 | 0.06 |
| 406 | 688429 | 时创能源    | 39,241  | 399,865.79 | 0.06 |
| 407 | 600935 | 华塑股份    | 169,500 | 398,325.00 | 0.06 |
| 408 | 600582 | 天地科技    | 89,000  | 396,050.00 | 0.06 |
| 409 | 688582 | 芯动联科    | 5,982   | 388,830.00 | 0.06 |
| 410 | 600854 | 春兰股份    | 95,000  | 386,650.00 | 0.06 |
| 411 | 688018 | 乐鑫科技    | 3,017   | 385,934.64 | 0.06 |
| 412 | 601083 | 锦江航运    | 38,700  | 384,678.00 | 0.06 |
| 413 | 600873 | 梅花生物    | 52,300  | 384,405.00 | 0.06 |
| 414 | 689009 | 九号公司    | 10,055  | 383,598.25 | 0.06 |
| 415 | 601518 | 吉林高速    | 135,900 | 380,520.00 | 0.06 |
| 416 | 603638 | 艾迪精密    | 16,200  | 379,890.00 | 0.06 |
| 417 | 603325 | 博隆技术    | 7,500   | 379,650.00 | 0.06 |
| 418 | 603043 | 广州酒家    | 30,600  | 379,440.00 | 0.06 |
| 419 | 603596 | 伯特利     | 15,254  | 378,909.36 | 0.06 |
| 420 | 600395 | 盘江股份    | 82,300  | 375,288.00 | 0.05 |
| 421 | 600821 | 金开新能    | 59,600  | 372,500.00 | 0.05 |
| 422 | 600906 | 财达证券    | 49,900  | 372,254.00 | 0.05 |
| 423 | 688443 | 智翔金泰    | 15,911  | 369,930.75 | 0.05 |
| 424 | 601990 | 南京证券    | 56,000  | 367,920.00 | 0.05 |
| 425 | 600054 | 黄山旅游    | 34,000  | 366,180.00 | 0.05 |
| 426 | 601966 | 玲珑轮胎    | 35,900  | 365,821.00 | 0.05 |
| 427 | 688321 | 微芯生物    | 13,856  | 364,828.48 | 0.05 |
| 428 | 600100 | 同方股份    | 53,200  | 364,420.00 | 0.05 |
| 429 | 603305 | 旭升集团    | 29,900  | 362,388.00 | 0.05 |
| 430 | 600380 | 健康元     | 38,400  | 361,728.00 | 0.05 |
| 431 | 601118 | 海南橡胶    | 73,400  | 361,128.00 | 0.05 |
| 432 | 603035 | 常熟汽饰    | 33,700  | 357,894.00 | 0.05 |
| 433 | 688238 | 和元生物    | 65,452  | 354,749.84 | 0.05 |
| 434 | 603699 | 纽威股份    | 7,000   | 352,100.00 | 0.05 |
| 435 | 605098 | 行动教育    | 6,500   | 352,040.00 | 0.05 |
| 436 | 688584 | 上海合晶硅材料 | 9,792   | 352,022.40 | 0.05 |
| 437 | 601717 | 中创智领    | 25,200  | 350,532.00 | 0.05 |
| 438 | 600820 | 隧道股份    | 66,600  | 346,986.00 | 0.05 |
| 439 | 601702 | 华峰铝业    | 24,562  | 346,324.20 | 0.05 |
| 440 | 600523 | 贵航股份    | 32,800  | 346,040.00 | 0.05 |
| 441 | 600125 | 铁龙物流    | 67,400  | 341,718.00 | 0.05 |
| 442 | 688133 | 泰坦股份    | 16,025  | 338,608.25 | 0.05 |
| 443 | 600391 | 航发科技    | 10,100  | 337,845.00 | 0.05 |
| 444 | 601900 | 南方传媒    | 31,100  | 337,746.00 | 0.05 |
| 445 | 603861 | 白云电器    | 26,100  | 336,951.00 | 0.05 |

|     |        |          |         |            |      |
|-----|--------|----------|---------|------------|------|
| 446 | 600023 | 浙能电力     | 63,900  | 336,114.00 | 0.05 |
| 447 | 600770 | 综艺股份     | 47,800  | 334,600.00 | 0.05 |
| 448 | 688389 | 深圳普门科技   | 33,855  | 331,440.45 | 0.05 |
| 449 | 688092 | 爱科科技股份   | 15,574  | 330,791.76 | 0.05 |
| 450 | 600834 | 申通地铁     | 50,000  | 329,000.00 | 0.05 |
| 451 | 600848 | 上海临港     | 43,900  | 328,811.00 | 0.05 |
| 452 | 600661 | 昂立教育     | 47,400  | 327,534.00 | 0.05 |
| 453 | 688050 | 爱博诺德医疗   | 8,873   | 323,420.85 | 0.05 |
| 454 | 688379 | 华光新材     | 3,843   | 322,927.29 | 0.05 |
| 455 | 603070 | 万控智造     | 25,400  | 319,532.00 | 0.05 |
| 456 | 600535 | 天士力      | 23,400  | 309,582.00 | 0.05 |
| 457 | 601689 | 拓普集团     | 5,455   | 307,771.10 | 0.04 |
| 458 | 603786 | 科博达      | 7,500   | 306,825.00 | 0.04 |
| 459 | 688131 | 皓元医药     | 3,242   | 306,693.20 | 0.04 |
| 460 | 600861 | 北京人力     | 24,800  | 302,560.00 | 0.04 |
| 461 | 688565 | 力源科技     | 32,002  | 302,418.90 | 0.04 |
| 462 | 603659 | 璞泰来      | 10,400  | 300,872.00 | 0.04 |
| 463 | 603233 | 大参林      | 20,000  | 300,600.00 | 0.04 |
| 464 | 601236 | 红塔证券     | 43,200  | 294,624.00 | 0.04 |
| 465 | 600717 | 天津港      | 75,300  | 292,917.00 | 0.04 |
| 466 | 601928 | 凤凰传媒     | 32,600  | 286,554.00 | 0.04 |
| 467 | 601016 | 节能风电     | 73,800  | 286,344.00 | 0.04 |
| 468 | 600363 | 联创光电     | 8,000   | 286,240.00 | 0.04 |
| 469 | 603270 | 金帝精密科技股份 | 8,500   | 284,835.00 | 0.04 |
| 470 | 600039 | 四川路桥     | 36,000  | 281,520.00 | 0.04 |
| 471 | 601888 | 中国中免     | 5,200   | 279,292.00 | 0.04 |
| 472 | 601858 | 中国科传     | 16,100  | 278,691.00 | 0.04 |
| 473 | 600633 | 浙数文化     | 27,200  | 276,896.00 | 0.04 |
| 474 | 601800 | 中国交建     | 47,800  | 272,938.00 | 0.04 |
| 475 | 600612 | 老凤祥      | 8,300   | 266,845.00 | 0.04 |
| 476 | 600382 | 广东明珠     | 39,300  | 264,489.00 | 0.04 |
| 477 | 600928 | 西安银行     | 79,100  | 258,657.00 | 0.04 |
| 478 | 600010 | 包钢股份     | 110,100 | 245,523.00 | 0.04 |
| 479 | 688613 | 奥精医疗     | 17,256  | 243,482.16 | 0.04 |
| 480 | 688678 | 福立旺精密    | 10,060  | 243,150.20 | 0.04 |
| 481 | 603689 | 皖天然气     | 34,673  | 240,283.89 | 0.04 |
| 482 | 688343 | 云天励飞股份   | 2,913   | 237,875.58 | 0.03 |
| 483 | 600787 | 中储股份     | 56,700  | 237,006.00 | 0.03 |

|     |        |         |         |            |      |
|-----|--------|---------|---------|------------|------|
| 484 | 603466 | 风语筑     | 24,200  | 236,918.00 | 0.03 |
| 485 | 688303 | 大全能源    | 13,332  | 232,376.76 | 0.03 |
| 486 | 603887 | 城地香江    | 24,700  | 230,698.00 | 0.03 |
| 487 | 603408 | 建霖家居    | 23,800  | 229,670.00 | 0.03 |
| 488 | 603201 | 常润股份    | 16,420  | 229,223.20 | 0.03 |
| 489 | 601061 | 中信金属    | 21,200  | 228,324.00 | 0.03 |
| 490 | 688728 | 格科微有限公司 | 10,813  | 227,505.52 | 0.03 |
| 491 | 600486 | 扬农化工    | 4,474   | 226,831.80 | 0.03 |
| 492 | 600968 | 海油发展    | 67,900  | 226,107.00 | 0.03 |
| 493 | 601865 | 福莱特     | 21,500  | 225,965.00 | 0.03 |
| 494 | 600983 | 惠而浦     | 32,200  | 223,146.00 | 0.03 |
| 495 | 688305 | 科德数控    | 3,377   | 220,416.79 | 0.03 |
| 496 | 600356 | 恒丰纸业    | 29,500  | 218,595.00 | 0.03 |
| 497 | 603172 | 浙江万丰股份  | 13,300  | 218,519.00 | 0.03 |
| 498 | 603855 | 华荣股份    | 12,500  | 216,625.00 | 0.03 |
| 499 | 605056 | 咸亨国际    | 13,100  | 209,600.00 | 0.03 |
| 500 | 600628 | 新世界     | 36,900  | 207,747.00 | 0.03 |
| 501 | 600570 | 恒生电子    | 9,800   | 207,662.00 | 0.03 |
| 502 | 688599 | 天合光能    | 14,441  | 203,906.92 | 0.03 |
| 503 | 603602 | 纵横通信    | 18,500  | 203,870.00 | 0.03 |
| 504 | 600718 | 东软集团    | 27,500  | 199,100.00 | 0.03 |
| 505 | 688609 | 广东九联科技  | 18,025  | 198,455.25 | 0.03 |
| 506 | 603357 | 设计总院    | 32,100  | 195,168.00 | 0.03 |
| 507 | 603816 | 顾家家居    | 8,700   | 194,532.00 | 0.03 |
| 508 | 688137 | 近岸蛋白    | 5,368   | 193,248.00 | 0.03 |
| 509 | 600398 | 海澜之家    | 36,600  | 191,418.00 | 0.03 |
| 510 | 688088 | 虹软科技    | 5,366   | 190,761.30 | 0.03 |
| 511 | 603151 | 邦基科技股份  | 17,300  | 190,127.00 | 0.03 |
| 512 | 600750 | 华润江中    | 8,600   | 189,802.00 | 0.03 |
| 513 | 600853 | 龙建股份    | 62,100  | 188,784.00 | 0.03 |
| 514 | 600609 | 金杯汽车    | 59,800  | 186,576.00 | 0.03 |
| 515 | 603282 | 亚光科技股份  | 13,000  | 185,510.00 | 0.03 |
| 516 | 603611 | 诺力股份    | 11,400  | 184,566.00 | 0.03 |
| 517 | 605001 | 威奥股份    | 33,800  | 184,210.00 | 0.03 |
| 518 | 605577 | 龙版传媒    | 20,800  | 183,248.00 | 0.03 |
| 519 | 600588 | 用友网络    | 19,900  | 182,682.00 | 0.03 |
| 520 | 600221 | 海航控股    | 135,300 | 182,655.00 | 0.03 |
| 521 | 601156 | 东航物流    | 11,300  | 182,156.00 | 0.03 |

|     |        |         |         |            |      |
|-----|--------|---------|---------|------------|------|
| 522 | 600429 | 三元股份    | 44,600  | 180,184.00 | 0.03 |
| 523 | 688327 | 云从科技    | 14,351  | 178,813.46 | 0.03 |
| 524 | 603236 | 移远通信    | 3,420   | 175,001.40 | 0.03 |
| 525 | 688128 | 中国电器研究院 | 7,326   | 173,919.24 | 0.03 |
| 526 | 603066 | 音飞储存    | 17,500  | 170,800.00 | 0.02 |
| 527 | 688311 | 盟升电子    | 6,497   | 170,156.43 | 0.02 |
| 528 | 600369 | 西南证券    | 42,100  | 169,242.00 | 0.02 |
| 529 | 603787 | 新日股份    | 18,600  | 169,074.00 | 0.02 |
| 530 | 600195 | 中牧股份    | 28,600  | 168,740.00 | 0.02 |
| 531 | 600529 | 山东药玻    | 9,100   | 167,895.00 | 0.02 |
| 532 | 600480 | 凌云股份    | 20,000  | 166,200.00 | 0.02 |
| 533 | 600300 | 维维股份    | 58,900  | 166,098.00 | 0.02 |
| 534 | 600572 | 康恩贝     | 42,200  | 165,424.00 | 0.02 |
| 535 | 688326 | 经纬恒润    | 2,328   | 165,008.64 | 0.02 |
| 536 | 600606 | 绿地控股    | 134,500 | 162,745.00 | 0.02 |
| 537 | 688318 | 财富趋势    | 2,265   | 161,517.15 | 0.02 |
| 538 | 603583 | 捷昌驱动    | 6,800   | 155,040.00 | 0.02 |
| 539 | 688590 | 新致软件    | 12,428  | 154,480.04 | 0.02 |
| 540 | 600325 | 华发股份    | 64,300  | 148,533.00 | 0.02 |
| 541 | 603511 | 爱慕股份    | 12,700  | 146,050.00 | 0.02 |
| 542 | 688382 | 益方生物科技  | 7,940   | 142,920.00 | 0.02 |
| 543 | 600866 | 星湖科技    | 31,500  | 138,285.00 | 0.02 |
| 544 | 688579 | 地纬智能    | 17,825  | 135,291.75 | 0.02 |
| 545 | 688435 | 英方软件    | 4,218   | 134,976.00 | 0.02 |
| 546 | 600764 | 中国海防    | 7,200   | 125,496.00 | 0.02 |
| 547 | 600438 | 通威股份    | 9,600   | 116,256.00 | 0.02 |
| 548 | 603185 | 弘元绿能    | 6,800   | 113,492.00 | 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

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  | 688797 | 臻宝科技   | 99    | 46,398.33 | 0.01         |
| 2  | 688811 | 有研金属复材 | 480   | 11,582.40 | 0.00         |
| 3  | 603407 | 长裕集团   | 72    | 5,289.12  | 0.00         |
| 4  | 603435 | 嘉德利    | 61    | 2,849.31  | 0.00         |

|   |        |         |    |        |      |
|---|--------|---------|----|--------|------|
| 5 | 603293 | 埃泰克汽车电子 | 25 | 848.25 | 0.00 |
|---|--------|---------|----|--------|------|

#### 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初基金资产净值 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      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------------|----------------|
| 1  | 688256 | 寒武纪科技    | 14,761,406.39 | 3.74           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台     | 5,575,552.00  | 1.41           |
| 3  | 688012 | 中微半导体设备  | 4,749,822.60  | 1.20           |
| 4  | 688008 | 澜起科技     | 4,377,132.13  | 1.11           |
| 5  | 688521 | 芯原微电子    | 4,144,415.87  | 1.05           |
| 6  | 603629 | 利通电子     | 3,789,459.00  | 0.96           |
| 7  | 688200 | 华峰测控     | 3,564,222.63  | 0.90           |
| 8  | 688515 | 裕太微电子    | 3,230,969.38  | 0.82           |
| 9  | 688188 | 上海柏楚电子科技 | 2,902,045.76  | 0.74           |
| 10 | 688519 | 南亚新材料    | 2,900,129.49  | 0.74           |
| 11 | 688027 | 科大国盾量子   | 2,819,232.63  | 0.72           |
| 12 | 603986 | 兆易创新     | 2,710,079.00  | 0.69           |
| 13 | 688002 | 睿创微纳     | 2,670,474.19  | 0.68           |
| 14 | 688041 | 海光信息     | 2,611,798.76  | 0.66           |
| 15 | 688213 | 思特威电子科技  | 2,460,033.97  | 0.62           |
| 16 | 688668 | 鼎通科技     | 2,368,343.02  | 0.60           |
| 17 | 688183 | 生益电子     | 2,188,010.13  | 0.55           |
| 18 | 688052 | 纳芯微电子    | 2,186,987.37  | 0.55           |
| 19 | 688981 | 中芯国际     | 2,083,703.63  | 0.53           |
| 20 | 603893 | 瑞芯微      | 2,076,213.00  | 0.53           |

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初基金资产净值 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      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------------|----------------|
| 1  | 688256 | 寒武纪科技   | 10,974,686.41 | 2.78           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台    | 6,747,444.00  | 1.71           |
| 3  | 688008 | 澜起科技    | 6,159,825.70  | 1.56           |
| 4  | 688012 | 中微半导体设备 | 4,025,921.93  | 1.02           |

|    |        |          |              |      |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 5  | 688002 | 睿创微纳     | 3,286,151.64 | 0.83 |
| 6  | 688041 | 海光信息     | 3,271,690.79 | 0.83 |
| 7  | 688521 | 芯原微电子    | 3,266,430.74 | 0.83 |
| 8  | 603893 | 瑞芯微      | 2,638,887.00 | 0.67 |
| 9  | 688200 | 华峰测控     | 2,608,808.96 | 0.66 |
| 10 | 688515 | 裕太微电子    | 2,461,398.13 | 0.62 |
| 11 | 688508 | 芯朋微电子    | 2,361,373.66 | 0.60 |
| 12 | 688183 | 生益电子     | 2,298,798.95 | 0.58 |
| 13 | 688261 | 东微半导体    | 2,273,179.70 | 0.58 |
| 14 | 688519 | 南亚新材料    | 2,168,743.50 | 0.55 |
| 15 | 688027 | 科大国盾量子   | 2,126,526.77 | 0.54 |
| 16 | 688188 | 上海柏楚电子科技 | 1,942,264.18 | 0.49 |
| 17 | 688202 | 美迪西生物医药  | 1,883,597.34 | 0.48 |
| 18 | 605499 | 东鹏饮料     | 1,867,822.00 | 0.47 |
| 19 | 603986 | 兆易创新     | 1,853,830.00 | 0.47 |
| 20 | 688439 | 振华风光     | 1,847,862.32 | 0.47 |

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 | 209,827,472.31 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 191,508,326.26 |

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） | 129,008.67 | 0.02         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 地方政府债     | -          | -            |
| 10 | 其他        | -          | -            |
| 11 | 合计        | 129,008.67 | 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  | 公允价值      | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-----|-----------|----------------------|
| 1  | 118069 | 爱科转债 | 550 | 55,004.82 | 0.01                 |
| 2  | 113706 | 金帝转债 | 400 | 40,002.81 | 0.01                 |
| 3  | 118072 | 鼎通转债 | 340 | 34,001.04 | 0.00                 |

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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 | 4,885.03 |
| 2  | 应收清算款 | -        |
| 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    | 4,885.03 |

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

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  | 688797 | 臻宝科技    | 46,398.33   | 0.01         | 新股流通受限   |
| 2  | 688811 | 有研金属复材  | 11,582.40   | 0.00         | 新股流通受限   |
| 3  | 603407 | 长裕集团    | 5,289.12    | 0.00         | 新股流通受限   |
| 4  | 603435 | 嘉德利     | 2,849.31    | 0.00         | 新股流通受限   |
| 5  | 603293 | 埃泰克汽车电子 | 848.25      | 0.00         | 新股流通受限   |

§ 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>例 (%) | 持有份额           | 占总份额比<br>例 (%) |
| 30,941       | 15,506.87     | 28,512,899.00 | 5.94           | 451,285,101.00 | 94.06          |

## 8.2 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。

## 8.3 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                             | 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（2023 年 11 月 22 日）基金份额总额 | 464,798,000.00 |
| 本报告期初基金份额总额                     | 287,798,000.00 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 999,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 807,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | —              |
| 本报告期末基金份额总额                     | 479,798,000.00 |

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，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

### 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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

#### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

#### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

#### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

#### 10.7.1 基金租用或者通过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（%） |    |
| 银河证券 | 5      | 234,200,917.68 | 58.37           | 41,207.11 | 58.37         |    |
| 国泰海通 | 4      | 88,766,183.95  | 22.12           | 15,616.61 | 22.12         |    |
| 广发证券 | 1      | 27,567,80      | 6.87            | 4,849.06  | 6.87          |    |

|        |   |               |      |          |      |  |
|--------|---|---------------|------|----------|------|--|
|        |   | 9.69          |      |          |      |  |
| 国信证券   | 2 | 20,339,951.94 | 5.07 | 3,579.17 | 5.07 |  |
| 光大证券   | 1 | 11,888,833.03 | 2.96 | 2,091.45 | 2.96 |  |
| 招商证券   | 4 | 10,999,608.70 | 2.74 | 1,934.92 | 2.74 |  |
| 兴业证券   | 1 | 3,934,465.53  | 0.98 | 692.21   | 0.98 |  |
| 中信建投证券 | 1 | 3,535,838.29  | 0.88 | 622.02   | 0.88 |  |
| 长江证券   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 东方证券   | 4 | —             | —    | —        | —    |  |
| 东吴证券   | 2 | —             | —    | —        | —    |  |
| 东兴证券   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 方正证券   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 高盛中国   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 国都证券   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 国金证券   | 2 | —             | —    | —        | —    |  |
| 国投证券   | 2 | —             | —    | —        | —    |  |
| 华泰证券   | 2 | —             | —    | —        | —    |  |
| 华鑫证券   | 3 | —             | —    | —        | —    |  |
| 上海证券   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 申万宏源证券 | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 西南证券   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 中金财富   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 中金公司   | 2 | —             | —    | —        | —    |  |
| 中泰证券   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 中信证券   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |
| 中银国际   | 1 | —             | —    | —        | —    |  |

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 基金租用或者通过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 |

|            |   | (%) |   | 比例<br>(%) |   | (%) |   | (%) |
|------------|---|-----|---|-----------|---|-----|---|-----|
| 银河证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 国泰海<br>通   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 广发证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 国信证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 光大证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 招商证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 兴业证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 中信建<br>投证券 | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 长江证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 东方证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 东吴证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 东兴证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 方正证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 高盛中<br>国   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 国都证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 国金证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 国投证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 华泰证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 华鑫证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 上海证<br>券   | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |
| 申万宏<br>源证券 | - | -   | - | -         | - | -   | - | -   |

|          |   |   |   |   |   |   |   |   |
|----------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 西南证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金财<br>富 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公<br>司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证<br>券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中银国<br>际 | - | - | - | - | - | - | - | - |

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:

本基金本报告期内退租 1 家证券公司的 2 个交易单元:国新证券(上交所单元,深交所单元)。

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  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加世纪证券为 | 中国证监会基金电子披露网站,公司网站, | 2026 年 01 月 12 日 |

|   |                                                     |                                    |                  |
|---|-----------------------------------------------------|------------------------------------|------------------|
|   | 申购赎回代理券商的公告                                         | 深交所, 上交所, 上证报                      |                  |
| 2 | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告                      | 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报 | 2026 年 01 月 22 日 |
| 3 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金公司为申购赎回代理券商的公告             | 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报 | 2026 年 02 月 26 日 |
| 4 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加万和证券为申购赎回代理券商的公告             | 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 公司网站, 上证报 | 2026 年 03 月 16 日 |
| 5 | 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 (2025 年度)      | 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报 | 2026 年 03 月 31 日 |
| 6 | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告                        | 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报 | 2026 年 03 月 31 日 |
| 7 | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告                      | 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报 | 2026 年 04 月 22 日 |
| 8 | 2025 年度汇添富基金管理股份有限公司以股东身份 (通过公募基金持股) 参与股东大会投票信息披露   | 公司网站                               | 2026 年 04 月 30 日 |
| 9 | 汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛 (北京) 基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上证报           | 2026 年 06 月 06 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

注: 无。

### 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](http://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

2026 年 08 月 31 日