

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

二〇二六年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：富国基金管理有限公司

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

富国基金管理有限公司的董事会、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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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 1 月 1 日起至 2026 年 6 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	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	半年度财务报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	净资产变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	39
7.1	期末基金资产组合情况	39

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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.....	64
§ 9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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.....	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	69
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证综指交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	上证综指 ETF
场内简称	上证指数 ETF 富国
基金主代码	510210
交易代码	510210
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2011 年 01 月 30 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
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	8,507,192,565.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 3 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的标的指数为上证综合指数。
投资策略	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台，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。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的最优化目标组合的构建、存托凭证的投资策略、其他金融工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场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		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	郭明
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1196 号世	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	纪汇办公楼二座 27-30 层	
邮政编码	200120	100140
法定代表人	陈戈	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金中期报告置备地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号

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日至2026年06月30日)
本期已实现收益	358,703,131.13
本期利润	346,502,401.23
加权平均基金份额本期利润	0.0486
本期加权平均净值利润率	4.75%
本期基金份额净值增长率	3.51%
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	3,763,955,108.72
期末可供分配基金份额利润	0.4424
期末基金资产净值	8,735,553,364.68
期末基金份额净值	1.0268
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	116.51%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。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（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

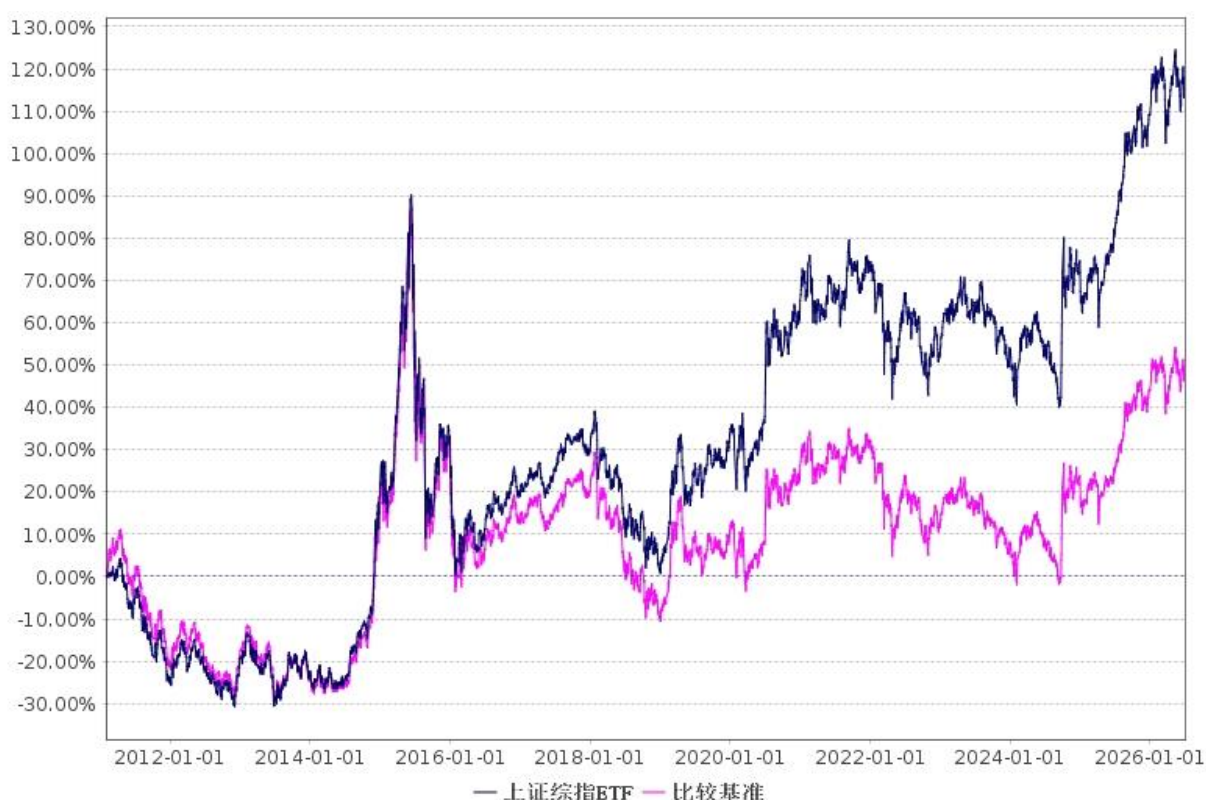
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.56%	0.93%	5.20%	0.94%	-0.64%	-0.01%
过去六个月	3.51%	0.97%	3.16%	0.95%	0.35%	0.02%
过去一年	19.53%	0.84%	18.87%	0.83%	0.66%	0.01%
过去三年	33.04%	1.00%	27.87%	1.00%	5.17%	0.00%
过去五年	28.98%	0.99%	14.01%	0.99%	14.97%	0.00%
过去七年	74.52%	1.02%	37.45%	1.02%	37.07%	0.00%

过去十年	94.78%	1.00%	39.76%	1.02%	55.02%	-0.02%
自基金合同生效起至今	116.51%	1.21%	48.74%	1.22%	67.77%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

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



注：1、截止日期为2026年6月30日。

§ 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

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一。公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月，加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。

目前，公司注册资本金 5.2 亿元人民币，股东为：国泰海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、加拿大蒙特利尔银行及山东省金融资产管理股份有限公司。公司在北京、成都、广州设立有分公司，并全资设有两家子公司——富国资产管理（上海）有限公司和富国资产管理（香港）有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、QDII、社保、企业年金、基本养老保险基金等基金公司全部业务牌照。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、富国天利增长债券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国中债-1-3 年国开行债券指数证券投资基金、富国全球科技互联网股票型证券投资基金（QDII）、富国鑫旺稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、富国富钱包货币市场基金、富国首创水务封闭式基础设施证券投资基金等 464 只公开募集证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王保合	本基金现任基金经理	2011-03-03	—	20	博士，自 2006 年 7 月加入富国基金管理有限公司，历任助理数量研究员、研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资副总监、量化与海外投资部量化投资总监、量化投资部总经理；现任富国基金总经理助理，兼任富国基金量化投资部总经理、资深定

					量基金经理。自 2011 年 03 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2011 年 03 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 04 月起任富国中证国有企业改革指数型证券投资基金(原富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证全指证券公司指数型证券投资基金(原富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金)基金经理；自 2015 年 05 月起任富国中证银行指数型证券投资基金(原富国中证银行指数分级证券投资基金)基金经理；自 2020 年 09 月起任富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金(LOF)基金经理；自 2022 年 11 月起任富国中证 1000 优选股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国致弘量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2023 年 12 月起任富国致航量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2025 年 06 月起任富国致享量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
方旻	本基金现任基金经理	2014-11-19	—	16	硕士，自 2010 年 2 月加入富国基金管理有限公司，历任定量研究员、基金经理助理、基金经理、量化与海外投资部量化投资总监助理、高级定量基金经理、量化投资部量化投资副总监、量化投资部量化投资总监；现任富国基金量化投资部量化投资总监兼资深定量基金经理。自 2014 年 11 月起任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；自 2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理；自 2014 年 11 月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自

					2018 年 05 月起任富国中证 1000 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2019 年 01 月起任富国 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理；自 2020 年 02 月起任富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2025 年 04 月起任富国致盛量化选股股票型证券投资基金基金经理；自 2025 年 05 月起任富国上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金经理；自 2025 年 06 月起任富国致享量化选股股票型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为上证综指交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

本报告期，公司严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规和内部管理办法的要求，通过自动化系统、人工审核等方式在各投资业务环节加强管控，确保公平对待旗下管理的所有投资组合。管理人对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析评估。在同向交易价差分析方面，采集连续四个季度不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，对同向交易价差进行假设检验并对检验结果进行分析。分析结果表明在同向交易价差方面，本投资组合与公司管理的其他投资组合未出现可能导致不公平交易、利益输送的交易事项。本报告期内公司旗下基金严格遵守法律法

规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，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

本报告期内未发现异常交易行为。

在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本基金与公司管理的其他投资组合之间，出现 46 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，为投资组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平对待投资组合或利益输送等情况。

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 年伊始，国内经济数据回暖、人民币升值等因素助推 A 股快速上行，随后融资保证金上调降温市场，叠加海外关税、美伊地缘反复扰动情绪。进入 2 月，美联储新任主席提名强化紧缩预期，全球迎来鹰派交易。3 月起，美伊冲突主导市场，月初冲突推高油价打压风险偏好；中旬局势僵持加剧滞胀忧虑；下旬美方释放缓和信号，悲观情绪有所修复。4 月地缘扰动降温、流动性预期改善，A 股科技成长维持强势并向低拥挤赛道扩散。海外半导体行情向好，AI 算力需求持续验证；国内资金聚焦产业主线，行情向国产算力、半导体、AIDC 基建延伸。5 月中旬多重催化消退，叠加美国通胀走高、加息预期升温，美债利率上行带来海外流动性压力，市场见顶回落。资金进一步聚焦 AI 硬件，电子、通信虹吸其他板块。6 月市场维持震荡分化，指数依靠少数赛道保持韧性，但个股中位数持续走弱，多数标的承受调整压力。

总体来看，2026 年上半年上证综指上涨 3.16%，沪深 300 上涨 7.55%，中证 500 指数上涨 20.97%，创业板指上涨 35.58%，科创综指上涨 53.99%。

在投资管理上，本基金采用最优化抽样复制标的指数，妥善处理日常申赎事项，合理安排仓位及头寸，将跟踪误差控制在合理水平，努力为投资者提供更合适的投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0268 元；份额累计净值为 2.0565 元；本报告期，本基金份额净值增长率为 3.51%；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

展望下半年，随着部分不确定因素逐步明朗，市场或仍以震荡运行为主。从外部环境来看，地缘政治局势仍可能对市场风险偏好产生扰动，油价冲高后有所回落；美国通胀数据环比回落，

叠加非农数据走弱，后续美联储加息预期或有所降温，对全球流动性的压制可能相应缓解。国内方面，经济修复态势短期或将延续，内需仍有待进一步修复，后续稳增长政策及相关工程项目的实施效果值得关注。整体来看，受资金博弈等因素影响，市场运行过程中仍可能伴随节奏波动与反复。8月中报密集披露期可能促使市场进一步关注企业盈利表现，市场机会或更多体现为具有业绩支撑品种的估值修复。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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——富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理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 半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上证综指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	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	209,806,558.15	32,519,406.12
结算备付金	14,193,090.50	13,305,499.19
存出保证金	316,739.28	114,840.28
交易性金融资产	8,681,504,944.54	5,831,930,942.32
其中：股票投资	8,680,913,936.77	5,830,736,832.41
基金投资	—	—
债券投资	591,007.77	1,194,109.91
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收清算款	6,693,846.67	10,574,595.18
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	8,912,515,179.14	5,888,445,283.09
负债和净资产	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付清算款	170,931,022.19	5,453,650.55
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	3,373,839.64	2,554,482.57
应付托管费	674,767.93	510,896.53
应付销售服务费	—	—
应付投资顾问费	—	—
应交税费	0.27	3.71

应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,982,184.43	1,051,769.73
负债合计	176,961,814.46	9,570,803.09
净资产：		
实收基金	4,971,598,255.96	3,462,094,598.02
未分配利润	3,763,955,108.72	2,416,779,881.98
净资产合计	8,735,553,364.68	5,878,874,480.00
负债和净资产总计	8,912,515,179.14	5,888,445,283.09

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0268 元，基金份额总额 8,507,192,565.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证综指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 (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)
一、营业总收入	368,280,458.90	304,471,213.39
1. 利息收入	147,115.66	74,198.77
其中：存款利息收入	147,115.66	74,198.77
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）	382,639,693.68	381,129,350.50
其中：股票投资收益	312,350,020.07	321,524,554.27
基金投资收益	—	—
债券投资收益	1,289,174.50	123,814.55
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	69,000,499.11	59,480,981.68
其他投资收益	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-12,200,729.90	-65,699,647.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-2,305,620.54	-11,032,688.74
减：二、营业总支出	21,778,057.67	15,796,692.40
1. 管理人报酬	18,067,650.31	12,753,547.31
2. 托管费	3,613,530.11	2,550,709.49

3. 销售服务费	—	—
4. 投资顾问费	—	—
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 信用减值损失	—	—
7. 税金及附加	1.15	0.42
8. 其他费用	96,876.10	492,435.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	346,502,401.23	288,674,520.99
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	346,502,401.23	288,674,520.99
五、其他综合收益的税后净额	—	—
六、综合收益总额	346,502,401.23	288,674,520.99

6.3 净资产变动表

会计主体：上证综指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 (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	3,462,094,598.02	2,416,779,881.98	5,878,874,480.00
二、本期期初净资产	3,462,094,598.02	2,416,779,881.98	5,878,874,480.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,509,503,657.94	1,347,175,226.74	2,856,678,884.68
（一）、综合收益总额	—	346,502,401.23	346,502,401.23
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,509,503,657.94	1,000,672,825.51	2,510,176,483.45
其中：1. 基金申购款	11,709,610,837.69	8,619,701,734.67	20,329,312,572.36
2. 基金赎回款	10,200,107,179.75	7,619,028,909.16	17,819,136,088.91
（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	4,971,598,255.96	3,763,955,108.72	8,735,553,364.68
项目	上年度可比期间 (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	4,538,558,297.74	1,789,505,338.28	6,328,063,636.02
二、本期期初净资产	4,538,558,297.74	1,789,505,338.28	6,328,063,636.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,173,965,778.61	-677,896,085.47	2,851,861,864.08

(一)、综合收益总额	—	288,674,520.99	288,674,520.99
(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)	— 2,173,965,778.61	-966,570,606.46	— 3,140,536,385.07
其中: 1. 基金申购款	4,170,858,538.16	1,485,678,368.73	5,656,536,906.89
2. 基金赎回款	— 6,344,824,316.77	— 2,452,248,975.19	— 8,797,073,291.96
(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	2,364,592,519.13	1,111,609,252.81	3,476,201,771.94

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:

陈 戈

林志松

徐慧

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证综指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[2010]1379号《关于核准上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2011年1月30日正式生效，首次设立募集规模为320,363,407.00份基金份额。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富国基金管理有限公司，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。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在10个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于存托凭证、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人将在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为上证综合指数。

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发布的《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发布的其他相关规定。

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6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

2 增值税

根据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

务院令第 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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

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的公告》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 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末（2026 年 06 月 30 日）
活期存款	209,806,558.15
等于：本金	209,790,668.59
加：应计利息	15,889.56
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	209,806,558.15

注：本基金本报告期末未持有定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2026年06月30日）			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		8,502,019,218.23	—	8,680,913,936.77	178,894,718.54
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	591,000.00	7.77	591,007.77	—
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	591,000.00	7.77	591,007.77	—
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		8,502,610,218.23	7.77	8,681,504,944.54	178,894,718.54

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：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

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：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（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	1,820,464.13

其中：交易所市场	1,820,464.13
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	60,000.00
预提审计费	101,720.30
合计	1,982,184.43

6.4.7.7 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	5,924,192,565.00	3,462,094,598.02
本期申购	20,037,000,000.00	11,709,610,837.69
本期赎回（以“-”号填列）	-17,454,000,000.00	-10,200,107,179.75
本期末	8,507,192,565.00	4,971,598,255.96

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,272,429,559.65	-855,649,677.67	2,416,779,881.98
本期期初	3,272,429,559.65	-855,649,677.67	2,416,779,881.98
本期利润	358,703,131.13	-12,200,729.90	346,502,401.23
本期基金份额交易产生的变动数	1,599,753,927.50	-599,081,101.99	1,000,672,825.51
其中：基金申购款	12,005,411,543.98	-3,385,709,809.31	8,619,701,734.67
基金赎回款	-10,405,657,616.48	2,786,628,707.32	-7,619,028,909.16
本期已分配利润	—	—	—
本期末	5,230,886,618.28	-1,466,931,509.56	3,763,955,108.72

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
活期存款利息收入	128,089.44
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	18,677.68
其他	348.54
合计	147,115.66

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（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	187,937,313.79
股票投资收益——赎回差价收入	124,412,706.28
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	312,350,020.07

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
卖出股票成交总额	9,302,495,675.45
减：卖出股票成本总额	9,105,787,467.56
减：交易费用	8,770,894.10
买卖股票差价收入	187,937,313.79

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
赎回基金份额对价总额	17,819,136,088.91
减：现金支付赎回款总额	29,592,213.91
减：赎回股票成本总额	17,665,131,168.72
减：交易费用	—
赎回差价收入	124,412,706.28

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
债券投资收益——利息收入	316.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,288,857.56
合计	1,289,174.50

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,334,419.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,045,000.00
减：应计利息总额	428.55
减：交易费用	133.30
买卖债券差价收入	1,288,857.56

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无买卖贵金属交易。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 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收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）
股票投资产生的股利收益	69,000,499.11
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	69,000,499.11

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
1. 交易性金融资产	-12,200,729.90
股票投资	-12,200,729.90
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	—
合计	-12,200,729.90

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
基金赎回费收入	—
替代损益	-2,305,620.54
合计	-2,305,620.54

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）
审计费用	33,720.30
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	—
银行费用	343.00
其他	2,812.80
合计	96,876.10

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

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
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构（2025 年 3 月 14 日前）
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金管理人的股东、基金代销机构（自 2025 年 3 月 14 日起）
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：（1）关联方国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原关联方海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

（2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（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）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
申万宏源	14,621,346,235.51	70.99	1,241,421,260.41	12.38

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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）	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）

申万宏源	3,317,114.84	99.48	—	—
------	--------------	-------	---	---

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回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2026年01月01日至2026年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	1,987,532.40	70.99	1,384,490.58	76.05
关联方名称	上年度可比期间（2025年01月01日至2025年06月30日）			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	168,703.31	12.38	99,214.66	16.72

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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（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）
当期发生的基金应支付的管理费	18,067,650.31	12,753,547.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,392,836.09	2,262,951.63
应支付基金管理人的净管理费	14,674,814.22	10,490,595.68

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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）
当期发生的基金应支付的托管费	3,613,530.11	2,550,709.49

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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通过银行间同业市场进行债券（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从事证券出借业务。

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从事证券出借业务。

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：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人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	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
国泰海通证券股份有限公司	6,194,849.00	0.07	2,450.00	—
申万宏源证券有限公司	1,430,022.00	0.02	2,954,774.00	0.05
富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,329,050,634.00	15.62	754,521,834.00	12.74

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
中国工商银行股份有限公司	209,806,558.15	128,089.44	22,950,383.82	61,692.12

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

本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

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
------	------	-------	-----	--------	------	--------	----------	--------	--------	----

601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股限售	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	—
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股限售	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	—
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股限售	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	—
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新股限售	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	—
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股限售	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	—
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股限售	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	—
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股限售	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	—
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股限售	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	—
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	—
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股限售	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	—
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股限售	114.28	676.94	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	—
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股限售	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	—
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股限售	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	—
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股限售	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	—
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	—
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	—
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股限售	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	—
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股限售	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	—

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

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
111025	圣泉转债	2026-06-26	1 个月内（含）	认购新发证券	100.00	100.00	5,910	591,000.00	591,007.77	—

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（单 位：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	26,867.00	11,416,65 9.40	22,353,34 4.00	—

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

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：本基金本报告期末未持有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以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和合规稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，但标的指数成分券不受此限。本基金在交易所进

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。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不进行列示。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末（2026年06月30日）	上年度末（2025年12月31日）
AAA	—	—
AAA 以下	591,007.77	1,194,109.91
未评级	—	—
合计	591,007.77	1,194,109.91

注：本表主要列示除短融和超短融之外的信用债，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末（2026 年 06 月 30 日）	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	209,806,558.15	—	—	—	209,806,558.15
结算备付金	14,193,090.50	—	—	—	14,193,090.50
存出保证金	316,739.28	—	—	—	316,739.28
交易性金融资产	591,007.77	—	—	8,680,913,936.77	8,681,504,944.54
应收清算款	—	—	—	6,693,846.67	6,693,846.67

资产总计	224,907,395.70	—	—	8,687,607,783.44	8,912,515,179.14
负债					
应付清算款	—	—	—	170,931,022.19	170,931,022.19
应付管理人报酬	—	—	—	3,373,839.64	3,373,839.64
应付托管费	—	—	—	674,767.93	674,767.93
应交税费	—	—	—	0.27	0.27
其他负债	—	—	—	1,982,184.43	1,982,184.43
负债总计	—	—	—	176,961,814.46	176,961,814.46
利率敏感度缺口	224,907,395.70	—	—	8,510,645,968.98	8,735,553,364.68
上年度末（2025年12月31日）	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	32,519,406.12	—	—	—	32,519,406.12
结算备付金	13,305,499.19	—	—	—	13,305,499.19
存出保证金	114,840.28	—	—	—	114,840.28
交易性金融资产	1,194,109.91	—	—	5,830,736,832.41	5,831,930,942.32
应收清算款	—	—	—	10,574,595.18	10,574,595.18
资产总计	47,133,855.50	—	—	5,841,311,427.59	5,888,445,283.09
负债					
应付清算款	—	—	—	5,453,650.55	5,453,650.55
应付管理人报酬	—	—	—	2,554,482.57	2,554,482.57
应付托管费	—	—	—	510,896.53	510,896.53
应交税费	—	—	—	3.71	3.71
其他负债	—	—	—	1,051,769.73	1,051,769.73
负债总计	—	—	—	9,570,803.09	9,570,803.09
利率敏感度缺口	47,133,855.50	—	—	5,831,740,624.50	5,878,874,480.00

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。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

注：本基金本期末及上年度末均未持有债券资产（不含可转债），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

本基金的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

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末（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	8,680,913,936.77	99.37	5,830,736,832.41	99.18
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	591,007.77	0.01	1,194,109.91	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	8,681,504,944.54	99.38	5,831,930,942.32	99.20

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 06 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准增加 1%	88,212,483.38	58,166,324.94
	2. 业绩比较基准减少 1%	-88,212,483.38	-58,166,324.94

注：本基金管理人运用资本资产定价模型（CAPM）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，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

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（2026年06月30日）	上年度末（2025年12月31日）
第一层次	8,644,386,681.50	5,813,742,530.81
第二层次	22,944,351.77	10,777,490.71
第三层次	14,173,911.27	7,410,920.80
合计	8,681,504,944.54	5,831,930,942.32

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、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

本基金本报告期末及上年度末均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

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,680,913,936.77	97.40
	其中：股票	8,680,913,936.77	97.40
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	591,007.77	0.01
	其中：债券	591,007.77	0.01
	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	223,999,648.65	2.51
8	其他各项资产	7,010,585.95	0.08
9	合计	8,912,515,179.14	100.00

注：上表中的股票投资金额含可退替代款估值增值

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,639,568.00	0.10
B	采矿业	700,066,647.69	8.01
C	制造业	4,343,686,813.54	49.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	354,179,965.62	4.05
E	建筑业	136,690,959.14	1.56
F	批发和零售业	97,008,235.44	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	283,549,060.99	3.25
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	599,501,632.90	6.86
J	金融业	1,783,228,086.69	20.41
K	房地产业	103,344,250.14	1.18

L	租赁和商务服务业	37,270,814.05	0.43
M	科学研究和技术服务业	109,531,735.30	1.25
N	水利、环境和公共设施管理业	63,619,820.92	0.73
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	39,169,759.25	0.45
S	综合	6,975,038.00	0.08
	合计	8,666,462,387.67	99.21

7.2.1.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	14,173,911.27	0.16
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	14,173,911.27	0.16

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

1	601288	农业银行	43,925,063	266,625,132.41	3.05
2	601138	工业富联	2,856,428	206,091,280.20	2.36
3	601988	中国银行	35,204,011	201,366,942.92	2.31
4	601857	中国石油	23,009,080	199,718,814.40	2.29
5	600519	贵州茅台	138,581	164,286,389.69	1.88
6	688256	寒武纪	92,391	147,414,460.05	1.69
7	688041	海光信息	322,156	119,294,366.80	1.37
8	600036	招商银行	2,765,785	98,185,367.50	1.12
9	600919	江苏银行	8,939,071	96,363,185.38	1.10
10	600900	长江电力	3,616,085	95,717,769.95	1.10
11	601088	中国神华	2,437,004	95,140,636.16	1.09
12	601899	紫金矿业	3,719,818	93,516,224.52	1.07
13	603986	兆易创新	94,400	76,936,000.00	0.88
14	600183	生益科技	440,796	76,434,026.40	0.87
15	603259	药明康德	592,412	73,761,218.12	0.84
16	601628	中国人寿	1,955,072	69,111,795.20	0.79
17	601939	建设银行	7,078,428	68,165,261.64	0.78
18	601998	中信银行	8,889,629	61,605,128.97	0.71
19	601009	南京银行	6,106,824	60,396,489.36	0.69
20	601658	邮储银行	11,682,500	57,594,725.00	0.66
21	600999	招商证券	2,713,028	57,244,890.80	0.66
22	600030	中信证券	1,902,934	54,671,293.82	0.63
23	600989	宝丰能源	2,591,068	52,676,412.44	0.60
24	688498	源杰科技	27,262	51,416,132.00	0.59
25	601328	交通银行	7,847,852	50,461,688.36	0.58
26	601985	中国核电	5,557,200	50,181,516.00	0.57
27	688012	中微公司	105,283	49,325,085.50	0.56
28	600487	亨通光电	440,900	48,208,006.00	0.55
29	600809	山西汾酒	430,259	47,057,426.83	0.54
30	688008	澜起科技	151,554	46,966,584.60	0.54
31	601728	中国电信	9,030,818	46,869,945.42	0.54
32	603993	洛阳钼业	2,471,414	43,373,315.70	0.50
33	601318	中国平安	907,940	43,345,055.60	0.50
34	600926	杭州银行	2,754,984	39,809,518.80	0.46
35	600150	中国船舶	1,160,992	39,229,919.68	0.45
36	600885	宏发股份	1,129,072	38,941,693.28	0.45
37	688981	中芯国际	243,342	38,647,576.44	0.44
38	601127	赛力斯	605,300	37,074,625.00	0.42
39	600028	中国石化	8,236,158	36,733,264.68	0.42
40	600176	中国巨石	502,100	36,593,048.00	0.42
41	601166	兴业银行	2,192,060	36,300,513.60	0.42

42	600025	华能水电	3,931,057	34,947,096.73	0.40
43	601319	中国人保	5,064,770	34,237,845.20	0.39
44	600015	华夏银行	5,349,763	34,184,985.57	0.39
45	601869	长飞光纤	61,500	33,572,850.00	0.38
46	600887	伊利股份	1,354,600	32,456,216.00	0.37
47	600875	东方电气	1,044,000	30,035,880.00	0.34
48	601198	东兴证券	2,157,900	29,325,861.00	0.34
49	601816	京沪高铁	6,456,300	29,247,039.00	0.33
50	688521	芯原股份	77,786	28,869,496.04	0.33
51	600177	雅戈尔	3,791,290	28,548,413.70	0.33
52	600023	浙能电力	5,412,254	28,468,456.04	0.33
53	603799	华友钴业	583,295	28,149,816.70	0.32
54	600219	南山铝业	7,025,084	28,030,085.16	0.32
55	600938	中国海油	1,031,200	27,997,080.00	0.32
56	601229	上海银行	3,212,888	27,887,867.84	0.32
57	600000	浦发银行	3,204,965	27,594,748.65	0.32
58	688525	佰维存储	54,859	27,140,393.07	0.31
59	688347	华虹宏力	80,518	27,078,203.40	0.31
60	600547	山东黄金	1,166,667	26,938,341.03	0.31
61	601995	中金公司	740,434	26,766,689.10	0.31
62	600489	中金黄金	1,479,734	26,709,198.70	0.31
63	688082	盛美上海	61,554	26,591,328.00	0.30
64	601872	招商轮船	1,501,700	26,384,869.00	0.30
65	688002	睿创微纳	170,153	26,320,967.57	0.30
66	603256	宏和科技	97,600	25,896,208.00	0.30
67	600406	国电南瑞	1,132,536	25,878,447.60	0.30
68	603288	海天味业	776,846	25,760,213.36	0.29
69	600019	宝钢股份	4,708,909	25,569,375.87	0.29
70	601601	中国太保	891,340	25,421,016.80	0.29
71	601018	宁波港	7,874,200	24,803,730.00	0.28
72	600418	江淮汽车	959,884	24,793,803.72	0.28
73	600309	万华化学	357,730	24,472,309.30	0.28
74	600276	恒瑞医药	465,307	24,214,576.28	0.28
75	600584	长电科技	230,101	23,826,958.55	0.27
76	600350	山东高速	2,113,910	23,527,818.30	0.27
77	601225	陕西煤业	1,153,723	23,478,263.05	0.27
78	601231	环旭电子	715,182	23,171,896.80	0.27
79	600061	国投资本	3,532,371	23,137,030.05	0.26
80	688072	拓荆科技	26,867	22,353,344.00	0.26
81	600346	恒力石化	1,244,221	22,035,153.91	0.25
82	600893	航发动力	571,670	21,917,827.80	0.25

83	601600	中国铝业	2,654,525	21,820,195.50	0.25
84	688025	杰普特	45,259	21,271,730.00	0.24
85	688191	智洋创新	563,289	20,109,417.30	0.23
86	600482	中国动力	609,101	19,978,512.80	0.23
87	688702	盛科通信	49,757	19,404,732.43	0.22
88	601061	中信金属	1,796,782	19,351,342.14	0.22
89	601169	北京银行	3,902,795	19,123,695.50	0.22
90	601100	恒立液压	177,266	19,066,730.96	0.22
91	601838	成都银行	1,073,093	18,993,746.10	0.22
92	601825	沪农商行	2,524,800	18,910,752.00	0.22
93	601668	中国建筑	4,346,371	18,863,250.14	0.22
94	688578	艾力斯	170,830	18,654,636.00	0.21
95	600733	北汽蓝谷	3,786,940	18,442,397.80	0.21
96	601360	三六零	2,099,795	18,247,218.55	0.21
97	600018	上港集团	3,844,600	18,146,512.00	0.21
98	601179	中国西电	1,214,100	18,114,372.00	0.21
99	605117	德业股份	169,220	17,967,779.60	0.21
100	603296	华勤技术	237,900	17,668,833.00	0.20
101	600352	浙江龙盛	1,454,145	17,609,695.95	0.20
102	601611	中国核建	1,577,000	17,583,550.00	0.20
103	605499	东鹏饮料	142,225	17,554,831.75	0.20
104	688017	绿的谐波	41,721	17,433,537.06	0.20
105	688127	蓝特光学	178,467	17,418,379.20	0.20
106	688052	纳芯微	60,365	17,403,833.15	0.20
107	600111	北方稀土	361,121	17,351,864.05	0.20
108	688261	东微半导	165,140	17,328,140.20	0.20
109	600566	济川药业	778,000	17,263,820.00	0.20
110	600642	申能股份	1,972,762	17,222,212.26	0.20
111	688307	中润光学	212,479	16,987,696.05	0.19
112	603290	斯达半导	110,860	16,954,928.40	0.19
113	603083	剑桥科技	66,409	16,925,661.83	0.19
114	688689	银河微电	260,796	16,878,717.12	0.19
115	688502	茂莱光学	24,246	16,817,025.60	0.19
116	603659	璞泰来	576,370	16,674,384.10	0.19
117	600188	兖矿能源	936,800	16,646,936.00	0.19
118	600663	陆家嘴	2,629,642	16,514,151.76	0.19
119	601699	潞安环能	1,156,300	16,511,964.00	0.19
120	600641	先导基电	410,200	16,350,572.00	0.19
121	688313	仕佳光子	88,200	16,286,130.00	0.19
122	601997	贵阳银行	3,139,800	16,107,174.00	0.18
123	600363	联创光电	448,700	16,054,486.00	0.18

124	600353	旭光电子	348,178	15,876,916.80	0.18
125	603699	纽威股份	314,020	15,795,206.00	0.18
126	600391	航发科技	463,653	15,509,192.85	0.18
127	600206	有研新材	229,130	15,260,058.00	0.17
128	601083	锦江航运	1,531,403	15,222,145.82	0.17
129	688469	芯联集成	1,433,753	15,212,119.33	0.17
130	601688	华泰证券	734,591	15,147,266.42	0.17
131	601698	中国卫通	500,140	15,129,235.00	0.17
132	688045	必易微	186,022	15,026,857.16	0.17
133	600160	巨化股份	282,120	14,955,181.20	0.17
134	688690	纳微科技	335,842	14,810,632.20	0.17
135	603268	松发股份	105,700	14,721,896.00	0.17
136	603283	赛腾股份	181,796	14,721,840.08	0.17
137	600438	通威股份	1,204,300	14,584,073.00	0.17
138	688700	东威科技	160,156	14,317,946.40	0.16
139	600096	云天化	469,519	14,273,377.60	0.16
140	688019	安集科技	41,870	14,213,190.20	0.16
141	688568	中科星图	337,045	13,977,256.15	0.16
142	600502	安徽建工	3,178,830	13,827,910.50	0.16
143	603019	中科曙光	128,922	13,824,306.06	0.16
144	688102	斯瑞新材	289,457	13,656,581.26	0.16
145	600460	士兰微	249,800	13,654,068.00	0.16
146	688390	固德威	123,964	13,451,333.64	0.15
147	601058	赛轮轮胎	1,164,690	13,428,875.70	0.15
148	601066	中信建投	459,300	13,351,851.00	0.15
149	603078	江化微	268,000	13,244,560.00	0.15
150	688677	海泰新光	130,860	13,233,871.80	0.15
151	603893	瑞芯微	70,000	13,185,200.00	0.15
152	688766	普冉股份	17,136	13,136,457.60	0.15
153	688110	东芯股份	63,859	13,008,078.30	0.15
154	600299	安迪苏	1,649,217	12,946,353.45	0.15
155	600901	江苏金租	2,215,627	12,739,855.25	0.15
156	601000	唐山港	3,066,551	12,726,186.65	0.15
157	600066	宇通客车	471,600	12,643,596.00	0.14
158	600707	彩虹股份	748,427	12,640,932.03	0.14
159	600757	长江传媒	1,726,323	12,619,421.13	0.14
160	600498	烽火通信	171,200	12,600,320.00	0.14
161	600259	中稀有色	123,200	12,518,352.00	0.14
162	688179	阿拉丁	450,625	12,486,818.75	0.14
163	603737	三棵树	516,415	12,445,601.50	0.14
164	600660	福耀玻璃	244,920	12,353,764.80	0.14

165	601919	中远海控	929,940	12,331,004.40	0.14
166	601766	中国中车	2,364,707	12,296,476.40	0.14
167	600026	中远海能	679,900	12,197,406.00	0.14
168	601212	白银有色	2,389,700	12,139,676.00	0.14
169	600031	三一重工	697,425	12,051,504.00	0.14
170	600522	中天科技	196,956	11,951,290.08	0.14
171	600585	海螺水泥	703,193	11,919,121.35	0.14
172	600968	海油发展	3,566,381	11,876,048.73	0.14
173	600741	华域汽车	762,000	11,826,240.00	0.14
174	600909	华安证券	1,054,658	11,717,250.38	0.13
175	600886	国投电力	873,728	11,629,319.68	0.13
176	600497	驰宏锌锗	950,684	11,512,783.24	0.13
177	600667	太极实业	392,600	11,456,068.00	0.13
178	688249	晶合集成	193,419	11,417,523.57	0.13
179	688122	西部超导	181,702	11,412,702.62	0.13
180	601377	兴业证券	1,888,586	11,407,059.44	0.13
181	603516	淳中科技	84,400	11,361,084.00	0.13
182	688620	安凯微	698,552	11,316,542.40	0.13
183	601555	东吴证券	1,423,618	11,275,054.56	0.13
184	688385	复旦微电	156,446	11,153,035.34	0.13
185	688195	腾景科技	57,776	11,126,502.08	0.13
186	603267	鸿远电子	143,200	11,095,136.00	0.13
187	688111	金山办公	51,995	11,077,534.75	0.13
188	688518	联赢激光	353,672	10,928,464.80	0.13
189	688778	厦钨新能	200,697	10,917,916.80	0.12
190	688336	三生国健	203,734	10,818,275.40	0.12
191	601567	三星电气	722,600	10,795,644.00	0.12
192	600392	盛和资源	361,900	10,773,763.00	0.12
193	600563	法拉电子	56,406	10,762,264.80	0.12
194	601669	中国电建	2,282,200	10,726,340.00	0.12
195	601117	中国化学	1,456,400	10,704,540.00	0.12
196	600236	桂冠电力	1,214,384	10,662,291.52	0.12
197	600098	广州发展	1,797,300	10,622,043.00	0.12
198	600105	永鼎股份	156,300	10,547,124.00	0.12
199	601021	春秋航空	230,003	10,483,536.74	0.12
200	603392	万泰生物	384,600	10,372,662.00	0.12
201	603833	欧派家居	338,875	10,203,526.25	0.12
202	601818	光大银行	3,521,800	10,178,002.00	0.12
203	601678	滨化股份	1,539,906	10,147,980.54	0.12
204	600143	金发科技	654,085	10,105,613.25	0.12
205	605599	菜百股份	724,182	9,921,293.40	0.11

206	688777	中控技术	83,688	9,833,340.00	0.11
207	600141	兴发集团	208,546	9,795,405.62	0.11
208	688093	世华科技	265,042	9,780,049.80	0.11
209	688506	百利天恒	33,236	9,772,381.08	0.11
210	600429	三元股份	2,417,900	9,768,316.00	0.11
211	603565	中谷物流	994,447	9,755,525.07	0.11
212	600732	爱旭股份	701,300	9,713,005.00	0.11
213	601898	中煤能源	797,231	9,710,273.58	0.11
214	688301	奕瑞科技	78,107	9,685,268.00	0.11
215	600331	宏达股份	878,900	9,659,111.00	0.11
216	603156	养元饮品	196,800	9,656,976.00	0.11
217	688202	美迪西	118,597	9,571,963.87	0.11
218	688146	中船特气	27,274	9,545,627.26	0.11
219	603110	东方材料	406,300	9,413,971.00	0.11
220	688235	百济神州	36,785	9,365,828.85	0.11
221	688519	南亚新材	24,526	9,320,861.04	0.11
222	688321	微芯生物	349,887	9,212,524.71	0.11
223	600483	福能股份	902,600	9,197,494.00	0.11
224	601155	新城控股	895,173	9,184,474.98	0.11
225	605123	派克新材	94,400	9,157,744.00	0.10
226	688120	华海清科	28,252	9,102,229.36	0.10
227	601963	重庆银行	894,300	9,014,544.00	0.10
228	600011	华能国际	1,186,300	9,004,017.00	0.10
229	600323	瀚蓝环境	327,060	8,981,067.60	0.10
230	688717	艾罗能源	106,758	8,815,008.06	0.10
231	605186	健麾信息	280,700	8,802,752.00	0.10
232	601298	青岛港	1,087,100	8,751,155.00	0.10
233	600201	生物股份	750,600	8,744,490.00	0.10
234	603538	美诺华	267,100	8,694,105.00	0.10
235	605589	圣泉集团	136,589	8,682,962.73	0.10
236	601139	深圳燃气	1,517,200	8,587,352.00	0.10
237	603885	吉祥航空	831,528	8,556,423.12	0.10
238	603686	福龙马	657,800	8,498,776.00	0.10
239	688182	灿勤科技	196,576	8,466,528.32	0.10
240	688183	生益电子	63,619	8,423,155.60	0.10
241	600268	国电南自	723,500	8,407,070.00	0.10
242	600693	东百集团	1,071,900	8,403,696.00	0.10
243	688209	英集芯	288,732	8,396,326.56	0.10
244	688348	昱能科技	240,680	8,370,850.40	0.10
245	600298	安琪酵母	230,302	8,336,932.40	0.10
246	600521	华海药业	576,000	8,294,400.00	0.09

247	601618	中国中冶	3,362,975	8,205,659.00	0.09
248	600773	西藏城投	632,100	8,135,127.00	0.09
249	688585	上纬新材	48,997	8,123,702.60	0.09
250	600292	电投水电	670,613	8,074,180.52	0.09
251	603380	易德龙	178,100	8,030,529.00	0.09
252	601665	齐鲁银行	1,387,100	8,003,567.00	0.09
253	601615	明阳智能	688,100	7,961,317.00	0.09
254	688536	思瑞浦	21,830	7,948,084.70	0.09
255	600988	赤峰黄金	301,800	7,943,376.00	0.09
256	603125	常青科技	241,100	7,893,614.00	0.09
257	601778	晶科科技	1,828,900	7,864,270.00	0.09
258	688187	时代电气	114,089	7,833,350.74	0.09
259	600531	豫光金铅	530,541	7,830,785.16	0.09
260	600104	上汽集团	801,500	7,822,640.00	0.09
261	600770	综艺股份	1,116,500	7,815,500.00	0.09
262	603629	利通电子	43,700	7,813,997.00	0.09
263	603596	伯特利	312,634	7,765,828.56	0.09
264	603200	上海洗霸	178,800	7,752,768.00	0.09
265	688586	江航装备	659,277	7,706,948.13	0.09
266	600516	方大炭素	1,240,747	7,655,408.99	0.09
267	688277	天智航	446,346	7,632,516.60	0.09
268	605358	立昂微	98,300	7,628,080.00	0.09
269	603806	福斯特	450,600	7,565,574.00	0.09
270	688516	奥特维	131,422	7,542,308.58	0.09
271	600410	华胜天成	475,700	7,530,331.00	0.09
272	603826	坤彩科技	294,200	7,519,752.00	0.09
273	688326	经纬恒润	105,908	7,506,759.04	0.09
274	688173	希荻微	390,489	7,473,959.46	0.09
275	600109	国金证券	850,800	7,470,024.00	0.09
276	601339	百隆东方	1,103,082	7,467,865.14	0.09
277	601881	中国银河	594,063	7,467,371.91	0.09
278	600237	铜峰电子	534,700	7,459,065.00	0.09
279	600927	永安期货	598,729	7,454,176.05	0.09
280	600906	财达证券	996,386	7,433,039.56	0.09
281	601577	长沙银行	850,982	7,412,053.22	0.08
282	600377	宁沪高速	637,700	7,378,189.00	0.08
283	688378	奥来德	118,530	7,348,860.00	0.08
284	600039	四川路桥	936,180	7,320,927.60	0.08
285	688199	久日新材	211,618	7,307,169.54	0.08
286	600699	均胜电子	336,300	7,267,443.00	0.08
287	688262	国芯科技	167,799	7,253,950.77	0.08

288	600816	建元信托	2,958,600	7,218,984.00	0.08
289	600690	海尔智家	353,500	7,214,935.00	0.08
290	600057	厦门象屿	1,329,821	7,207,629.82	0.08
291	600985	淮北矿业	508,200	7,140,210.00	0.08
292	688271	联影医疗	70,154	7,101,689.42	0.08
293	688396	华润微	72,750	7,096,762.50	0.08
294	603929	亚翔集成	26,000	7,072,520.00	0.08
295	600233	圆通速递	445,900	7,022,925.00	0.08
296	688207	格灵深瞳	349,378	7,022,497.80	0.08
297	603977	国泰集团	421,600	6,960,616.00	0.08
298	688330	宏力达	205,377	6,947,903.91	0.08
299	603619	中曼石油	370,200	6,926,442.00	0.08
300	603301	振德医疗	79,300	6,911,788.00	0.08
301	603933	睿能科技	305,400	6,886,770.00	0.08
302	603005	晶方科技	127,400	6,863,038.00	0.08
303	600050	中国联通	1,712,100	6,848,400.00	0.08
304	600100	同方股份	998,020	6,836,437.00	0.08
305	688779	五矿新能	842,400	6,831,864.00	0.08
306	600590	泰豪科技	676,100	6,828,610.00	0.08
307	603228	景旺电子	93,800	6,792,058.00	0.08
308	688653	康希通信	390,243	6,782,423.34	0.08
309	600131	国网信通	464,000	6,774,400.00	0.08
310	688059	华锐精密	33,893	6,768,771.03	0.08
311	688068	热景生物	77,776	6,735,401.60	0.08
312	605058	澳弘电子	186,000	6,725,760.00	0.08
313	600702	舍得酒业	188,400	6,697,620.00	0.08
314	600549	厦门钨业	78,600	6,696,720.00	0.08
315	688303	大全能源	383,627	6,686,618.61	0.08
316	603216	梦天家居	324,800	6,681,136.00	0.08
317	601608	中信重工	1,394,350	6,651,049.50	0.08
318	600115	中国东航	1,744,300	6,645,783.00	0.08
319	688062	迈威生物	235,112	6,641,914.00	0.08
320	688728	格科微	315,429	6,636,626.16	0.08
321	603093	南华期货	362,400	6,577,560.00	0.08
322	600155	华创云信	1,184,300	6,537,336.00	0.07
323	688099	晶晨股份	63,319	6,515,525.10	0.07
324	601877	正泰电器	259,800	6,513,186.00	0.07
325	603931	格林达	109,500	6,504,300.00	0.07
326	601689	拓普集团	114,400	6,454,448.00	0.07
327	689009	九号公司	168,947	6,445,328.05	0.07
328	601888	中国中免	119,933	6,441,601.43	0.07

329	600118	中国卫星	78,400	6,432,720.00	0.07
330	600326	西藏天路	993,200	6,426,004.00	0.07
331	600320	振华重工	1,552,966	6,413,749.58	0.07
332	688681	科汇股份	458,577	6,410,906.46	0.07
333	600089	特变电工	284,600	6,403,500.00	0.07
334	601512	中新集团	819,700	6,393,660.00	0.07
335	600821	金开新能	1,017,000	6,356,250.00	0.07
336	603501	豪威集团	67,000	6,354,950.00	0.07
337	600362	江西铜业	146,600	6,347,780.00	0.07
338	605056	咸亨国际	396,100	6,337,600.00	0.07
339	601128	常熟银行	1,087,924	6,331,717.68	0.07
340	600801	华新建材	402,974	6,286,394.40	0.07
341	600027	华电国际	1,409,900	6,274,055.00	0.07
342	600986	浙文互联	898,800	6,273,624.00	0.07
343	600208	衢州发展	2,207,800	6,248,074.00	0.07
344	600666	奥瑞德	1,573,680	6,247,509.60	0.07
345	603679	华体科技	308,900	6,233,602.00	0.07
346	688617	惠泰医疗	34,003	6,173,584.68	0.07
347	605222	起帆电缆	264,100	6,158,812.00	0.07
348	688428	诺诚健华	216,229	6,156,039.63	0.07
349	600711	盛屯矿业	560,200	6,145,394.00	0.07
350	601633	长城汽车	407,154	6,143,953.86	0.07
351	600839	四川长虹	879,900	6,141,702.00	0.07
352	603198	迎驾贡酒	206,800	6,121,280.00	0.07
353	603939	益丰药房	339,460	6,103,490.80	0.07
354	600684	珠江股份	2,021,380	6,084,353.80	0.07
355	688169	石头科技	63,702	6,049,778.94	0.07
356	688126	沪硅产业	151,276	6,034,399.64	0.07
357	603026	石大胜华	67,356	6,019,605.72	0.07
358	600415	小商品城	591,700	6,011,672.00	0.07
359	600685	中船防务	236,000	6,003,840.00	0.07
360	688228	开普云	77,622	6,003,285.48	0.07
361	688106	金宏气体	144,444	5,991,537.12	0.07
362	603696	安记食品	520,300	5,983,450.00	0.07
363	600630	龙头股份	612,900	5,969,646.00	0.07
364	688063	派能科技	111,750	5,952,922.50	0.07
365	600941	中国移动	69,007	5,943,572.91	0.07
366	601020	华钰矿业	247,040	5,926,489.60	0.07
367	603038	华立股份	379,690	5,923,164.00	0.07
368	603266	天龙股份	351,670	5,918,606.10	0.07
369	601059	信达证券	365,500	5,917,445.00	0.07

370	603778	国晟科技	480,500	5,910,150.00	0.07
371	600863	华能蒙电	1,257,100	5,908,370.00	0.07
372	600588	用友网络	641,800	5,891,724.00	0.07
373	600879	航天电子	275,797	5,871,718.13	0.07
374	688196	卓越新能	162,598	5,837,268.20	0.07
375	688589	力合微	253,547	5,826,510.06	0.07
376	601865	福莱特	544,800	5,725,848.00	0.07
377	601162	天风证券	1,693,100	5,705,747.00	0.07
378	601233	桐昆股份	262,200	5,676,630.00	0.06
379	688253	英诺特	93,994	5,665,958.32	0.06
380	600764	中国海防	324,600	5,657,778.00	0.06
381	688031	星环科技	49,051	5,649,694.18	0.06
382	603025	大豪科技	413,840	5,644,777.60	0.06
383	688787	海天瑞声	41,953	5,640,580.85	0.06
384	603507	振江股份	171,400	5,637,346.00	0.06
385	688055	龙腾光电	977,907	5,632,744.32	0.06
386	603297	永新光学	38,300	5,628,185.00	0.06
387	601238	广汽集团	1,104,300	5,609,844.00	0.06
388	600520	三佳科技	141,100	5,603,081.00	0.06
389	600750	华润江中	252,900	5,581,503.00	0.06
390	603786	科博达	136,400	5,580,124.00	0.06
391	601019	山东出版	869,400	5,564,160.00	0.06
392	600728	佳都科技	1,293,300	5,509,458.00	0.06
393	688311	盟升电子	208,972	5,472,976.68	0.06
394	688660	电气风电	631,429	5,442,917.98	0.06
395	688425	铁建重工	1,351,065	5,431,281.30	0.06
396	688046	药康生物	223,507	5,408,869.40	0.06
397	688388	嘉元科技	122,593	5,394,092.00	0.06
398	688048	长光华芯	10,725	5,383,950.00	0.06
399	600827	百联股份	724,500	5,368,545.00	0.06
400	603390	通达电气	512,600	5,351,544.00	0.06
401	603185	弘元绿能	320,035	5,341,384.15	0.06
402	688510	航亚科技	223,653	5,340,833.64	0.06
403	688629	华丰科技	28,321	5,310,470.71	0.06
404	600372	中航机载	488,172	5,296,666.20	0.06
405	603323	苏农银行	1,362,835	5,274,171.45	0.06
406	600426	华鲁恒升	220,400	5,271,968.00	0.06
407	688475	萤石网络	192,544	5,266,078.40	0.06
408	600550	保变电气	447,800	5,252,694.00	0.06
409	600961	株冶集团	161,100	5,218,029.00	0.06
410	600895	张江高科	139,600	5,200,100.00	0.06

411	688609	九联科技	472,093	5,197,743.93	0.06
412	603897	长城科技	158,900	5,157,894.00	0.06
413	603660	苏州科达	420,500	5,151,125.00	0.06
414	688776	国光电气	83,948	5,149,370.32	0.06
415	600125	铁龙物流	1,014,849	5,145,284.43	0.06
416	600722	金牛化工	633,300	5,142,396.00	0.06
417	600683	京投发展	445,500	5,123,250.00	0.06
418	603305	旭升集团	422,600	5,121,912.00	0.06
419	605288	凯迪股份	60,340	5,119,849.00	0.06
420	600739	辽宁成大	505,450	5,110,099.50	0.06
421	688668	鼎通科技	13,674	5,104,504.20	0.06
422	603393	新天然气	238,400	5,104,144.00	0.06
423	688279	峰岷科技	22,642	5,081,770.48	0.06
424	688139	海尔生物	192,025	5,073,300.50	0.06
425	603158	腾龙股份	414,800	5,073,004.00	0.06
426	601900	南方传媒	464,542	5,044,926.12	0.06
427	600428	中远海特	644,296	5,031,951.76	0.06
428	600510	黑牡丹	673,900	5,027,294.00	0.06
429	603068	博通集成	124,100	4,992,543.00	0.06
430	601126	四方股份	78,900	4,986,480.00	0.06
431	688107	安路科技	109,332	4,985,539.20	0.06
432	688009	中国通号	1,045,589	4,977,003.64	0.06
433	601599	浙文影业	1,774,197	4,950,009.63	0.06
434	603260	合盛硅业	101,700	4,908,042.00	0.06
435	600020	中原高速	1,326,430	4,894,526.70	0.06
436	688472	阿特斯	452,343	4,894,351.26	0.06
437	688005	容百科技	159,786	4,889,451.60	0.06
438	603358	华达科技	112,400	4,889,400.00	0.06
439	688018	乐鑫科技	38,070	4,869,914.40	0.06
440	600064	南京高科	681,720	4,860,663.60	0.06
441	601108	财通证券	561,500	4,856,975.00	0.06
442	600673	东阳光	144,100	4,838,878.00	0.06
443	688083	中望软件	74,121	4,799,334.75	0.05
444	688800	瑞可达	49,800	4,779,306.00	0.05
445	601016	节能风电	1,228,713	4,767,406.44	0.05
446	600515	海南机场	1,732,200	4,746,228.00	0.05
447	600380	健康元	503,486	4,742,838.12	0.05
448	688160	步科股份	43,419	4,722,684.63	0.05
449	600557	康缘药业	400,600	4,715,062.00	0.05
450	600420	国药现代	592,000	4,706,400.00	0.05
451	688222	成都先导	146,498	4,704,050.78	0.05

452	688246	嘉和美康	228,649	4,698,736.95	0.05
453	603308	应流股份	77,000	4,650,800.00	0.05
454	601595	上海电影	280,000	4,648,000.00	0.05
455	688368	晶丰明源	21,464	4,647,385.28	0.05
456	688579	地纬智能	611,026	4,637,687.34	0.05
457	605286	同力天启	181,675	4,630,895.75	0.05
458	688499	利元亨	87,353	4,590,400.15	0.05
459	600230	沧州大化	351,700	4,579,134.00	0.05
460	688295	中复神鹰	75,368	4,562,778.72	0.05
461	601456	国联民生	513,900	4,542,876.00	0.05
462	600717	天津港	1,157,300	4,501,897.00	0.05
463	600803	新奥股份	283,200	4,474,560.00	0.05
464	600580	卧龙电驱	135,100	4,471,810.00	0.05
465	688135	利扬芯片	105,528	4,440,618.24	0.05
466	605168	三人行	87,670	4,439,608.80	0.05
467	600256	广汇能源	897,800	4,435,132.00	0.05
468	605577	龙版传媒	498,800	4,394,428.00	0.05
469	688648	中邮科技	120,020	4,386,731.00	0.05
470	600598	北大荒	403,200	4,370,688.00	0.05
471	600171	上海贝岭	136,800	4,369,392.00	0.05
472	688543	国科军工	110,721	4,367,943.45	0.05
473	601799	星宇股份	48,100	4,358,822.00	0.05
474	688361	中科飞测	10,114	4,349,020.00	0.05
475	688156	路德科技	143,475	4,340,118.75	0.05
476	688318	财富趋势	60,825	4,337,430.75	0.05
477	600284	浦东建设	888,615	4,318,668.90	0.05
478	688186	广大特材	284,504	4,310,235.60	0.05
479	688363	华熙生物	120,149	4,297,729.73	0.05
480	601222	林洋能源	805,200	4,283,664.00	0.05
481	600546	山煤国际	391,900	4,283,467.00	0.05
482	603195	公牛集团	108,920	4,264,218.00	0.05
483	603656	泰禾智能	242,000	4,254,360.00	0.05
484	603568	伟明环保	276,600	4,254,108.00	0.05
485	688231	隆达股份	114,893	4,220,019.89	0.05
486	688290	景业智能	63,545	4,216,846.20	0.05
487	601886	江河集团	524,800	4,214,144.00	0.05
488	688375	国博电子	40,117	4,184,203.10	0.05
489	688798	艾为电子	56,955	4,175,940.60	0.05
490	603738	泰晶科技	69,400	4,167,470.00	0.05
491	688570	天玛智控	292,657	4,164,509.11	0.05
492	603197	保隆科技	148,000	4,135,120.00	0.05

493	688036	传音控股	70,119	4,133,515.05	0.05
494	603119	浙江荣泰	61,930	4,108,436.20	0.05
495	688125	安达智能	25,104	4,104,504.00	0.05
496	688180	君实生物	120,972	4,091,273.04	0.05
497	603499	翔港科技	310,416	4,081,970.40	0.05
498	601399	国机重装	1,164,900	4,077,150.00	0.05
499	600405	动力源	901,135	4,073,130.20	0.05
500	688232	新点软件	229,069	4,072,846.82	0.05
501	600820	隧道股份	777,700	4,051,817.00	0.05
502	688382	益方生物	224,965	4,049,370.00	0.05
503	603638	艾迪精密	171,556	4,022,988.20	0.05
504	688200	华峰测控	7,654	4,019,115.40	0.05
505	688588	凌志软件	440,566	4,004,744.94	0.05
506	600316	洪都航空	143,000	3,995,420.00	0.05
507	601106	中国一重	1,210,700	3,995,310.00	0.05
508	603366	日出东方	546,700	3,974,509.00	0.05
509	600129	太极集团	288,900	3,920,373.00	0.04
510	603728	鸣志电器	64,300	3,917,156.00	0.04
511	600605	汇通能源	134,700	3,895,524.00	0.04
512	603039	泛微网络	107,857	3,890,401.99	0.04
513	603703	盛洋科技	348,180	3,864,798.00	0.04
514	600481	双良节能	773,874	3,861,631.26	0.04
515	600575	淮河能源	1,204,900	3,843,631.00	0.04
516	688088	虹软科技	107,563	3,823,864.65	0.04
517	603901	永创智能	348,300	3,786,021.00	0.04
518	603233	大参林	251,620	3,781,848.60	0.04
519	603369	今世缘	159,500	3,781,745.00	0.04
520	605016	百龙创园	146,000	3,774,100.00	0.04
521	601107	四川成渝	771,900	3,766,872.00	0.04
522	600971	恒源煤电	540,585	3,730,036.50	0.04
523	601990	南京证券	564,100	3,706,137.00	0.04
524	603171	税友股份	93,000	3,706,050.00	0.04
525	688275	万润新能	29,037	3,703,669.35	0.04
526	600869	远东股份	110,504	3,698,568.88	0.04
527	688599	天合光能	261,885	3,697,816.20	0.04
528	605376	博迁新材	13,600	3,689,680.00	0.04
529	688116	天奈科技	96,543	3,687,942.60	0.04
530	605287	德才股份	88,500	3,671,865.00	0.04
531	688680	海优新材	87,235	3,663,870.00	0.04
532	688289	圣湘生物	254,325	3,662,280.00	0.04
533	688523	航天环宇	69,717	3,653,170.80	0.04

534	688118	普元信息	181,519	3,652,162.28	0.04
535	605255	天普股份	55,500	3,651,345.00	0.04
536	603099	长白山	102,300	3,649,041.00	0.04
537	600822	上海物贸	479,300	3,647,473.00	0.04
538	600760	中航沈飞	88,500	3,637,350.00	0.04
539	600600	青岛啤酒	69,552	3,632,700.96	0.04
540	600436	片仔癀	33,200	3,628,096.00	0.04
541	603319	美湖股份	108,800	3,613,248.00	0.04
542	600475	华光环能	236,500	3,606,625.00	0.04
543	600779	水井坊	127,100	3,602,014.00	0.04
544	688309	恒誉科技	59,136	3,600,199.68	0.04
545	600114	东睦股份	95,258	3,596,942.08	0.04
546	603529	爱玛科技	182,100	3,552,771.00	0.04
547	688205	德科立	17,055	3,550,680.45	0.04
548	600674	川投能源	250,100	3,543,917.00	0.04
549	601606	长城军工	128,900	3,543,461.00	0.04
550	600793	宜宾纸业	293,100	3,525,993.00	0.04
551	605299	舒华体育	263,400	3,516,390.00	0.04
552	603053	成都燃气	419,600	3,507,856.00	0.04
553	600161	天坛生物	302,440	3,502,255.20	0.04
554	600771	广誉远	270,300	3,500,385.00	0.04
555	601727	上海电气	499,900	3,499,300.00	0.04
556	600062	华润双鹤	218,000	3,496,720.00	0.04
557	603122	合富中国	318,900	3,495,144.00	0.04
558	600216	浙江医药	305,800	3,486,120.00	0.04
559	600611	大众交通	922,900	3,479,333.00	0.04
560	600529	山东药玻	188,000	3,468,600.00	0.04
561	600967	内蒙一机	318,400	3,454,640.00	0.04
562	601236	红塔证券	506,300	3,452,966.00	0.04
563	601811	新华文轩	315,400	3,450,476.00	0.04
564	600977	中国电影	266,900	3,448,348.00	0.04
565	600279	重庆港	943,000	3,441,950.00	0.04
566	600925	苏能股份	854,300	3,425,743.00	0.04
567	600858	银座股份	776,700	3,425,247.00	0.04
568	600051	宁波联合	607,700	3,421,351.00	0.04
569	601136	首创证券	245,200	3,420,540.00	0.04
570	600755	厦门国贸	629,800	3,413,516.00	0.04
571	600021	上海电力	226,500	3,413,355.00	0.04
572	600505	西昌电力	319,100	3,411,179.00	0.04
573	601800	中国交建	596,800	3,407,728.00	0.04
574	601200	上海环境	516,040	3,405,864.00	0.04

575	600610	中毅达	519,400	3,402,070.00	0.04
576	600446	金证股份	338,100	3,401,286.00	0.04
577	601789	宁波建工	847,700	3,399,277.00	0.04
578	600692	亚通股份	624,900	3,393,207.00	0.04
579	600703	三安光电	159,900	3,393,078.00	0.04
580	605188	国光连锁	290,000	3,390,100.00	0.04
581	600095	湘财股份	449,900	3,387,747.00	0.04
582	603615	茶花股份	209,600	3,385,040.00	0.04
583	600559	老白干酒	302,200	3,384,640.00	0.04
584	600726	华电能源	475,000	3,382,000.00	0.04
585	603598	引力传媒	197,200	3,381,980.00	0.04
586	688652	京仪装备	16,866	3,376,067.22	0.04
587	600535	天士力	255,000	3,373,650.00	0.04
588	605398	新炬网络	170,600	3,369,350.00	0.04
589	600398	海澜之家	643,800	3,367,074.00	0.04
590	600250	南京商旅	436,500	3,365,415.00	0.04
591	600285	羚锐制药	172,900	3,350,802.00	0.04
592	600570	恒生电子	157,502	3,337,467.38	0.04
593	601827	三峰环境	455,400	3,310,758.00	0.04
594	603016	新宏泰	97,500	3,291,600.00	0.04
595	603220	中贝通信	153,200	3,273,884.00	0.04
596	600012	皖通高速	207,200	3,265,472.00	0.04
597	601933	永辉超市	1,148,400	3,261,456.00	0.04
598	688331	荣昌生物	24,898	3,243,213.48	0.04
599	600601	方正科技	233,200	3,227,488.00	0.04
600	603816	顾家家居	141,263	3,158,640.68	0.04
601	688027	国盾量子	6,265	3,157,622.65	0.04
602	603020	爱普股份	222,400	3,135,840.00	0.04
603	688061	灿瑞科技	61,810	3,070,102.70	0.04
604	601111	中国国航	504,000	3,049,200.00	0.03
605	688010	福光股份	62,662	3,047,253.06	0.03
606	605333	沪光股份	178,200	3,038,310.00	0.03
607	601788	光大证券	208,700	3,011,541.00	0.03
608	688410	山外山	201,728	2,896,814.08	0.03
609	688213	思特威	26,203	2,805,555.21	0.03
610	688512	慧智微	171,425	2,737,657.25	0.03
611	603270	金帝股份	80,900	2,710,959.00	0.03
612	603588	高能环境	139,300	2,674,560.00	0.03
613	600395	盘江股份	582,684	2,657,039.04	0.03
614	688266	泽璟制药	22,736	2,652,381.76	0.03
615	603726	朗迪集团	76,000	2,603,000.00	0.03

616	605133	嵘泰股份	65,500	2,578,735.00	0.03
617	603132	金徽股份	165,400	2,576,932.00	0.03
618	603135	中重科技	211,400	2,557,940.00	0.03
619	603889	新澳股份	492,410	2,516,215.10	0.03
620	688593	新相微	63,373	2,466,477.16	0.03
621	688230	芯导科技	31,111	2,451,857.91	0.03
622	603010	万盛股份	135,100	2,448,012.00	0.03
623	688486	龙迅股份	38,491	2,447,257.78	0.03
624	603698	航天工程	63,400	2,444,704.00	0.03
625	688049	炬芯科技	52,075	2,442,838.25	0.03
626	688007	光峰科技	182,739	2,430,428.70	0.03
627	603067	振华股份	52,500	2,430,225.00	0.03
628	688561	奇安信	100,584	2,412,004.32	0.03
629	605118	力鼎光电	69,000	2,407,410.00	0.03
630	688305	科德数控	36,787	2,401,087.49	0.03
631	688558	国盛智科	72,905	2,395,658.30	0.03
632	688047	龙芯中科	15,485	2,395,064.95	0.03
633	688281	华秦科技	47,664	2,394,162.72	0.03
634	688559	海目星	28,514	2,392,894.88	0.03
635	688698	伟创电气	45,620	2,392,769.00	0.03
636	688391	钜泉科技	66,509	2,385,677.83	0.03
637	605588	冠石科技	35,400	2,377,818.00	0.03
638	603505	金石资源	118,000	2,377,700.00	0.03
639	688273	麦澜德	61,029	2,364,263.46	0.03
640	600366	宁波韵升	160,400	2,354,672.00	0.03
641	605167	利柏特	146,100	2,352,210.00	0.03
642	688615	合合信息	20,778	2,349,991.80	0.03
643	688577	浙海德曼	51,269	2,349,658.27	0.03
644	688119	中钢洛耐	488,309	2,319,467.75	0.03
645	688109	品茗科技	30,635	2,319,069.50	0.03
646	603556	海兴电力	105,300	2,316,600.00	0.03
647	688234	天岳先进	13,307	2,308,897.57	0.03
648	600645	中源协和	134,100	2,294,451.00	0.03
649	603179	新泉股份	46,142	2,290,950.30	0.03
650	600740	山西焦化	717,300	2,288,187.00	0.03
651	600312	平高电气	129,400	2,285,204.00	0.03
652	688685	迈信林	41,587	2,283,126.30	0.03
653	688343	云天励飞	27,844	2,273,741.04	0.03
654	603286	日盈电子	49,500	2,258,685.00	0.03
655	688291	金橙子	38,590	2,256,743.20	0.03
656	603345	安井食品	28,100	2,253,339.00	0.03

657	601336	新华保险	37,700	2,249,182.00	0.03
658	603317	天味食品	172,700	2,246,827.00	0.03
659	605196	华通线缆	85,900	2,241,990.00	0.03
660	600984	建设机械	598,750	2,239,325.00	0.03
661	600369	西南证券	556,600	2,237,532.00	0.03
662	601607	上海医药	144,600	2,226,840.00	0.03
663	688141	杰华特	14,480	2,222,680.00	0.03
664	600998	九州通	473,700	2,221,653.00	0.03
665	603181	皇马科技	136,700	2,217,274.00	0.03
666	600375	汉马科技	600,600	2,216,214.00	0.03
667	603112	华翔股份	131,800	2,205,014.00	0.03
668	600797	浙大网新	344,300	2,203,520.00	0.03
669	601118	海南橡胶	446,400	2,196,288.00	0.03
670	688089	ST 嘉必优	206,442	2,190,349.62	0.03
671	603169	兰石重装	309,100	2,188,428.00	0.03
672	600325	华发股份	947,000	2,187,570.00	0.03
673	603803	瑞斯康达	185,800	2,181,292.00	0.02
674	601156	东航物流	134,700	2,171,364.00	0.02
675	603779	威龙股份	289,000	2,170,390.00	0.02
676	603519	立霸股份	141,700	2,168,010.00	0.02
677	601519	大智慧	249,000	2,148,870.00	0.02
678	603355	莱克电气	81,300	2,144,694.00	0.02
679	600916	中国黄金	313,500	2,144,340.00	0.02
680	603300	海南华铁	469,900	2,138,045.00	0.02
681	600620	天宸股份	540,800	2,136,160.00	0.02
682	600866	星湖科技	485,000	2,129,150.00	0.02
683	603612	索通发展	117,200	2,124,836.00	0.02
684	601006	大秦铁路	460,300	2,121,983.00	0.02
685	600865	百大集团	258,800	2,119,572.00	0.02
686	600810	神马股份	343,500	2,119,395.00	0.02
687	600578	京能电力	328,300	2,117,535.00	0.02
688	601777	千里科技	259,400	2,116,704.00	0.02
689	600970	中材国际	295,600	2,107,628.00	0.02
690	600499	科达制造	151,900	2,096,220.00	0.02
691	603085	天成自控	192,800	2,095,736.00	0.02
692	603069	海汽集团	165,900	2,082,045.00	0.02
693	600966	博汇纸业	435,400	2,081,212.00	0.02
694	600108	亚盛集团	700,200	2,072,592.00	0.02
695	688071	华依科技	56,737	2,067,496.28	0.02
696	688039	当虹科技	55,307	2,064,057.24	0.02
697	603967	中创物流	196,700	2,035,845.00	0.02

698	688531	日联科技	11,332	2,015,282.88	0.02
699	600113	浙江东日	60,200	1,997,436.00	0.02
700	601077	渝农商行	325,660	1,989,782.60	0.02
701	688136	科兴制药	93,191	1,929,985.61	0.02
702	688692	达梦数据	7,868	1,922,073.72	0.02
703	688411	海博思创	6,501	1,893,091.20	0.02
704	688293	奥浦迈	44,702	1,863,626.38	0.02
705	600737	中粮糖业	149,900	1,848,267.00	0.02
706	688607	康众医疗	36,039	1,837,989.00	0.02
707	600562	国睿科技	86,500	1,835,530.00	0.02
708	603285	键邦股份	40,900	1,832,729.00	0.02
709	605289	罗曼股份	12,200	1,769,000.00	0.02
710	603129	春风动力	6,900	1,765,020.00	0.02
711	688258	卓易信息	14,862	1,761,741.48	0.02
712	688172	燕东微	21,038	1,760,039.08	0.02
713	603306	华懋科技	16,900	1,752,361.00	0.02
714	601113	华鼎股份	530,900	1,751,970.00	0.02
715	688683	莱尔科技	46,110	1,748,491.20	0.02
716	600962	国投中鲁	57,930	1,747,748.10	0.02
717	688539	高华科技	54,613	1,741,062.44	0.02
718	603127	昭衍新药	45,400	1,735,188.00	0.02
719	600501	航天晨光	108,900	1,712,997.00	0.02
720	688132	邦彦技术	129,963	1,709,013.45	0.02
721	688679	通源环境	40,545	1,706,539.05	0.02
722	603995	甬金股份	73,500	1,705,935.00	0.02
723	603095	越剑智能	117,500	1,682,600.00	0.02
724	603336	宏辉果蔬	212,400	1,682,208.00	0.02
725	688528	秦川物联	182,739	1,670,234.46	0.02
726	603567	珍宝岛	380,700	1,667,466.00	0.02
727	601677	明泰铝业	100,299	1,664,963.40	0.02
728	688719	爱科赛博	21,577	1,661,429.00	0.02
729	601375	中原证券	413,900	1,651,461.00	0.02
730	603515	欧普照明	100,900	1,648,706.00	0.02
731	600808	马钢股份	658,300	1,645,750.00	0.02
732	603955	大千生态	84,600	1,637,856.00	0.02
733	688308	欧科亿	9,002	1,636,653.62	0.02
734	600121	郑州煤电	455,300	1,629,974.00	0.02
735	688335	复洁科技	67,294	1,617,747.76	0.02
736	688035	德邦科技	17,539	1,610,080.20	0.02
737	600746	江苏索普	307,800	1,609,794.00	0.02
738	600571	信雅达	163,000	1,589,250.00	0.02

739	603800	洪田股份	19,000	1,544,510.00	0.02
740	603587	地素时尚	138,800	1,542,068.00	0.02
741	603162	海通发展	171,400	1,537,458.00	0.02
742	603071	物产环能	137,900	1,525,174.00	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	占基金资产净值比例（%）
1	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.08
2	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.04
3	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.03
4	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
5	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
6	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
7	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
8	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
9	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
10	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
11	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
12	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
13	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
14	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
15	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
16	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
17	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
18	603284	林平发展	46	1,604.02	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	600519	贵州茅台	234,356,298.32	3.99
2	688256	寒武纪	99,042,545.43	1.68
3	600150	中国船舶	93,209,897.76	1.59
4	601988	中国银行	85,315,028.00	1.45
5	601138	工业富联	83,371,297.99	1.42
6	600584	长电科技	81,994,899.00	1.39
7	688041	海光信息	78,034,789.81	1.33
8	603288	海天味业	71,112,144.61	1.21

9	601857	中国石油	68,148,774.00	1.16
10	601288	农业银行	68,143,623.00	1.16
11	603259	药明康德	62,954,983.05	1.07
12	600183	生益科技	62,294,057.20	1.06
13	601009	南京银行	53,787,259.48	0.91
14	688981	中芯国际	52,670,740.73	0.90
15	600177	雅戈尔	50,976,572.00	0.87
16	600023	浙能电力	50,916,006.66	0.87
17	600900	长江电力	50,907,725.00	0.87
18	600036	招商银行	49,294,845.00	0.84
19	600879	航天电子	47,780,226.00	0.81
20	600999	招商证券	47,203,372.00	0.80

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	688385	复旦微电	431,786,059.51	7.34
2	600519	贵州茅台	153,269,776.70	2.61
3	600480	凌云股份	126,038,682.04	2.14
4	601857	中国石油	87,911,097.00	1.50
5	600150	中国船舶	76,321,153.27	1.30
6	600183	生益科技	70,996,123.00	1.21
7	688256	寒武纪	68,520,985.10	1.17
8	600989	宝丰能源	66,278,367.00	1.13
9	601991	大唐发电	63,818,446.56	1.09
10	688041	海光信息	62,202,725.53	1.06
11	600276	恒瑞医药	58,893,319.28	1.00
12	603288	海天味业	57,970,532.08	0.99
13	601318	中国平安	57,607,292.00	0.98
14	600031	三一重工	55,322,905.22	0.94
15	600584	长电科技	54,494,670.00	0.93
16	600887	伊利股份	52,821,809.00	0.90
17	603379	三美股份	52,303,933.44	0.89
18	600309	万华化学	51,977,032.50	0.88
19	603019	中科曙光	46,034,306.00	0.78
20	600598	北大荒	45,595,725.00	0.78

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

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	11,295,737,820.03
卖出股票收入（成交）总额	9,302,495,675.45

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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）	591,007.77	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	591,007.77	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111025	圣泉转债	5,910	591,007.77	0.01

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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

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	316,739.28

2	应收清算款	6,693,846.67
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	7,010,585.95

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未持有流通受限的股票。

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	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.08	新股限售
2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.04	新股限售
3	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.03	新股限售
4	688820	盛合晶微	338,302.59	0.00	新股限售
5	688790	昂瑞微	293,237.55	0.00	新股限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
129,750	65,566.03	3,851,932,683.00	45.28	4,655,259,882.00	54.72	1,329,050,634.00	15.62

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	—	—

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（2011 年 01 月 30 日）基金份额总额	320,363,407.00
本报告期期初基金份额总额	5,924,192,565.00
本报告期基金总申购份额	20,037,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	17,454,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	8,507,192,565.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布公告，王苏龙先生自 2026 年 6 月 26 日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。

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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

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

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

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，基金管理人无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，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：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

注：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 (%)	
长江证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	1,888,721,103.87	9.17	256,717.03	9.17	—
申万宏源	1	14,621,346,235.51	70.99	1,987,532.40	70.99	—
银河证券	2	4,086,841,509.09	19.84	555,460.76	19.84	—

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

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	
	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 (%)
长江证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	17,304.57	0.52	—	—	—	—
申万宏源	3,317,114.84	99.48	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—

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	关于调整上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告	规定披露媒介	2026 年 01 月 16 日
2	关于富国基金管理有限公司旗下部分上交所上市基金场内扩位简称变更的公告	规定披露媒介	2026 年 03 月 20 日
3	富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定披露媒介	2026 年 06 月 27 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超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

一、本报告期内，为更好地保障基金持有人利益，依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定以及《上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人与基金托管人协商一致，决定提高上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值计算精度，由“保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入”变更为“保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入”。具体可参见基金管理人于 2026 年 1 月 16 日发布的《关于调整上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告》及修订后的基金合同等相关法律文件。

二、本报告期内，经向上海证券交易所申请并获得同意，本基金管理人决定自 2026 年 3 月 20 日起将本基金的场内扩位简称由“上证指数 ETF”变更为“上证指数 ETF 富国”。具体可参见基金管理人于 2026 年 3 月 20 日发布的《关于富国基金管理有限公司旗下部分上交所上市基金场内扩位简称变更的公告》。

三、本报告期内，经基金管理人董事会第七届十四次会议审议通过，王苏龙先生自 2026 年 6 月 26 日起担任公司董事长，同日起裴长江先生不再担任公司董事长。具体可参见基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的《富国基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

§ 12 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立上证综指交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、上证综指交易型开放式指数证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、上证综指交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址： http://www.fullgoal.com.cn 。