

嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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 2026 年 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 and 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
3.3 其他指标	9
§ 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
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	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉实中证 1000 指数增强发起式	
基金主代码	016776	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 6 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	84,647,805.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实中证 1000 指数增强发起式 A	嘉实中证 1000 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	016776	016777
报告期末下属分级基金的份额总额	36,251,900.48 份	48,395,905.21 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金作为股票指数增强型基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求有效跟踪标的指数，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 指数作为基金投资组合的标的指数。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务的投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的证券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	嘉实基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	郭松	汪小敏
	联系电话	(010)65215588	021-31888888
	电子邮箱	service@jsfund.cn	wangxm8@spdb.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95528
传真		(010)65215588	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	上海市中山东一路 12 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		100020	200126
法定代表人		经雷	张为忠

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	http://www.jsfund.cn
基金中期报告置备地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

§ 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 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	嘉实中证 1000 指数增强发起式 A	嘉实中证 1000 指数增强发起式 C
本期已实现收益	7,872,422.48	14,813,624.99
本期利润	6,804,933.58	14,157,259.48
加权平均基金份 额本期利润	0.1702	0.2000
本期加权平均净 值利润率	11.96%	14.24%
本期基金份额净 值增长率	15.64%	15.49%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	17,143,779.12	22,261,532.44
期末可供分配基金份额利润	0.4729	0.4600
期末基金资产净值	54,825,744.32	72,544,216.77
期末基金份额净值	1.5124	1.4990
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	51.24%	49.90%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

（3）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

嘉实中证 1000 指数增强发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	13.03%	1.47%	14.83%	1.53%	-1.80%	-0.06%
过去六个月	15.64%	1.48%	15.23%	1.54%	0.41%	-0.06%
过去一年	44.31%	1.25%	36.53%	1.31%	7.78%	-0.06%
过去三年	49.27%	1.47%	32.22%	1.57%	17.05%	-0.10%
自基金合同生效起至今	51.24%	1.38%	30.17%	1.48%	21.07%	-0.10%

嘉实中证 1000 指数增强发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	12.96%	1.47%	14.83%	1.53%	-1.87%	-0.06%

过去六个月	15.49%	1.48%	15.23%	1.54%	0.26%	-0.06%
过去一年	43.95%	1.25%	36.53%	1.31%	7.42%	-0.06%
过去三年	48.17%	1.47%	32.22%	1.57%	15.95%	-0.10%
自基金合同生效起 至今	49.90%	1.38%	30.17%	1.48%	19.73%	-0.10%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = (\text{中证 1000 指数}(t) / \text{中证 1000 指数}(t-1) - 1) \times 95\% + ((1 + \text{银行活期存款税后利率})^{1/365} - 1) \times 5\%$$

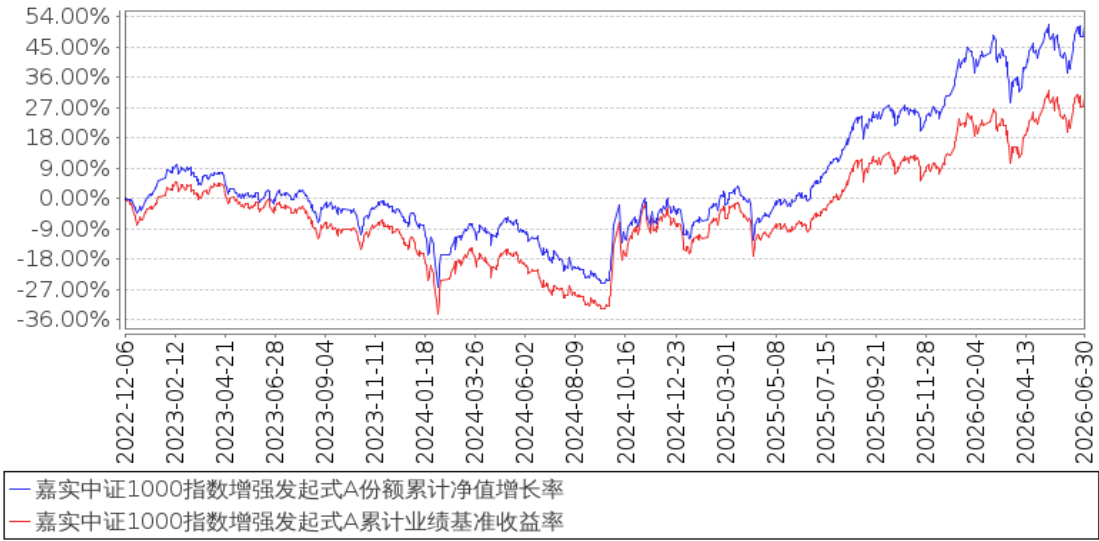
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

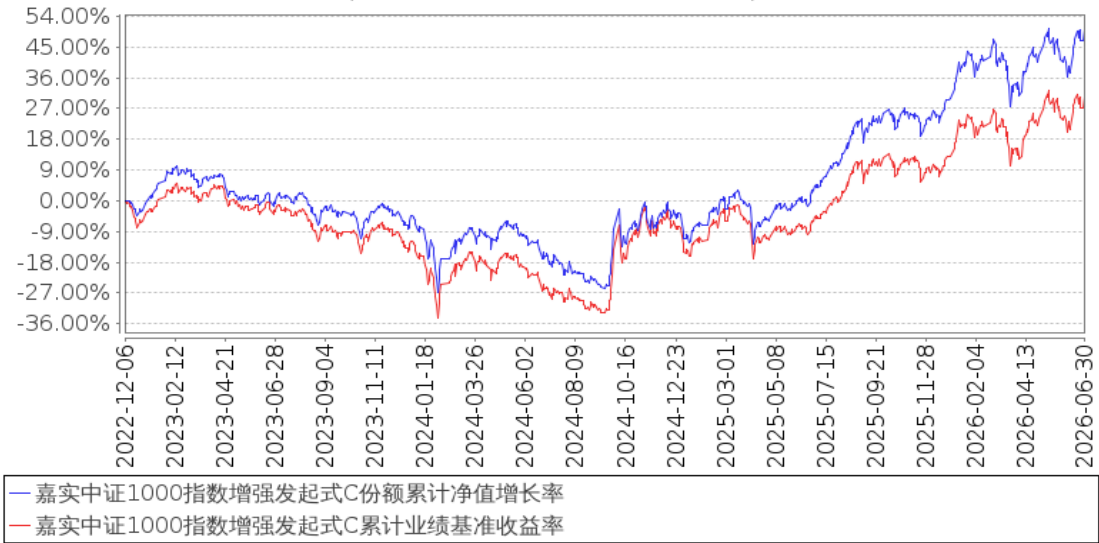
嘉实中证1000指数增强发起式A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022年12月06日至2026年06月30日)



嘉实中证1000指数增强发起式C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022年12月06日至2026年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 385 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、不动产基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龙昌伦	本基金、嘉实量化	2022 年 12 月 6 日	-	12 年	曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015 年 4 月

阿尔法混合、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实中证500指数增强、嘉实量化精选股票、嘉实创业板增强策略ETF、嘉实中证A100指数增强发起式、嘉实上证科创板综合增强策略ETF基金经理				加入嘉实基金管理有限公司，现任职于股票投研体系。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
---	--	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资

建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 3 次，其中 2 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，1 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A 股市场在政策托底、流动性充裕及 AI 等新产业景气高增的共同驱动下，呈现出极致分化的结构性行情。主要指数上行但涨幅差异巨大，市场活跃度创历史新高，上半年日均成交额约 2.74 万亿元，同比接近翻倍。其中科技与高端制造板块成为市场上涨主线，科创 50 和创业板指分别上涨 64.25% 和 35.58%，大幅跑赢同期其他宽基指数，显示投资者对科技成长板块景气度的极强信心。相较之下，上证 50 下跌 1.38%，上证指数仅上涨 3.16%，大盘价值蓝筹风格表现明显偏弱。

宏观层面，经济整体在复杂外部环境下展现出韧性与分化并存的特征。上半年经济呈开局良好与结构性分化并行的复杂图景，一季度开局平稳，二季度增长动能较一季度有所放缓，内需偏弱、外需与新动能成为主要支撑。内需修复基础尚不牢固，居民消费谨慎，社会消费增速持续回落；固定资产投资走弱，传统制造与地产链条仍是主要拖累。外需在波动中展现出较强韧性，依托完备产业链优势，高新技术产品成为出口核心驱动力。政策层面，财政与货币协同发力但相比过往更重节奏与结构，宏观政策整体保持定力，为下半年预留发力空间。

从行业表现来看，2026 年上半年 A 股市场不同行业表现差异极为鲜明，在 AI 产业周期与国产替代共振下走出极致分化行情。市场风格从防御彻底转向进取，成长风格大幅跑赢价值风格，硬科技成为绝对主线，AI 算力、光通信、半导体设备等方向对资金产生虹吸效应。行业方面，电子、通信、建筑材料、机械设备等涨幅居前，商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料等则表现靠后。

本基金主要利用全市场多因子选股模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。报告期内，基金保持仓位稳定，以获取超额收益为核心。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实中证 1000 指数增强发起式 A 基金份额净值为 1.5124 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.64%；截至本报告期末嘉实中证 1000 指数增强发起式 C 基金份额净值为 1.4990 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.49%；业绩比较基准收益率为 15.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，国内经济预计仍将延续外需相对较强、内需修复偏缓的结构特征，企业盈利改善的速度取决于稳增长政策的落地、居民与企业需求的恢复节奏，以及外部贸易环境的变化。与此同时，财政与货币协同发力，流动性环境总体有望保持合理充裕。而地缘政治、海外货币政策走向及外需波动仍可能对市场形成阶段性扰动。

权益市场的主要驱动力预计将由上半年的流动性与估值扩张，逐步转向基本面兑现。经历了上半年的极致分化后，市场整体估值有所抬升，波动或将继续维持偏高水平，但结构性行情的格局有望延续。在此背景下，市场风格有望从前期的科技主线的极致分化，向更多板块和主题扩散，演变成风格再平衡的结构特征。科技成长等高景气方向仍具备中长期产业逻辑，但考虑到上半年科技板块涨幅较大、行业估值与交易拥挤度有所提升，投资主线更有可能从上半年强势的算力基础设施进一步沿产业链上下游进行景气扩散。整体而言，下半年需要更加重视业绩与估值的匹配。业绩兑现能力将成为标的主要上行驱动力，而景气成长和低估值价值的哑铃布局有望是下半年的主流操作思路。

具体操作上，本基金将继续在行业中性的框架内坚持自下而上精选个股的投资策略，在控制指数跟踪误差的同时力争为持有人创造更多的超额收益。

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》及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基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告

“6.4.11 利润分配情况”。

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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行认真的复核，未发现基金管理人存在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的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由嘉实基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	9,300,679.68	12,168,914.98
结算备付金		1,076,928.22	—
存出保证金		203,640.00	—
交易性金融资产	6.4.7.2	118,901,099.21	139,698,988.06
其中：股票投资		118,244,023.05	139,144,680.12
基金投资		—	—
债券投资		657,076.16	554,307.94

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		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,093,756.01	2,373,669.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		130,576,103.12	154,241,572.72
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,033,226.31	5,603,458.43
应付管理人报酬		105,631.04	166,361.28
应付托管费		10,563.09	16,636.16
应付销售服务费		15,434.06	35,010.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9.74	0.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	41,277.79	78,007.74
负债合计		3,206,142.03	5,899,474.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	84,647,805.69	114,101,736.80
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	42,722,155.40	34,240,361.67
净资产合计		127,369,961.09	148,342,098.47
负债和净资产总计		130,576,103.12	154,241,572.72

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实中证 1000 指数增强发起式 A 基金份额净值 1.5124 元，基金份额总额 36,251,900.48 份，嘉实中证 1000 指数增强发起式 C 基金份额净值 1.4990 元，基

金份额总额 48,395,905.21 份，基金份额总额合计为 84,647,805.69 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		21,983,025.02	2,881,811.42
1. 利息收入		28,107.76	3,199.96
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,107.76	3,199.96
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）		23,536,671.56	2,400,373.43
其中：股票投资收益	6.4.7.14	22,616,417.22	2,176,739.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,429.34	1,011.23
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	141,133.26	-
股利收益	6.4.7.19	775,691.74	222,622.41
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,723,854.41	468,487.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	142,100.11	9,750.85
减：二、营业总支出		1,020,831.96	151,908.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	776,901.97	117,192.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	77,690.14	11,719.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	123,512.74	7,376.98
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. 22	-	-
7. 税金及附加		987. 57	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	41, 739. 54	15, 619. 11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20, 962, 193. 06	2, 729, 903. 30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20, 962, 193. 06	2, 729, 903. 30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		20, 962, 193. 06	2, 729, 903. 30

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	114, 101, 736. 80	-	34, 240, 361. 67	148, 342, 098. 47
二、本期期初净资产	114, 101, 736. 80	-	34, 240, 361. 67	148, 342, 098. 47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-29, 453, 931. 11	-	8, 481, 793. 73	-20, 972, 137. 38
（一）、综合收益总额	-	-	20, 962, 193. 06	20, 962, 193. 06
（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）	-29, 453, 931. 11	-	-12, 480, 399. 33	-41, 934, 330. 44
其中：1. 基金申购款	196, 371, 883. 81	-	78, 850, 152. 93	275, 222, 036. 74
2. 基金赎回款	-225, 825, 814. 92	-	-91, 330, 552. 26	-317, 156, 367. 18
（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	84,647,805.69	-	42,722,155.40	127,369,961.09
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	23,882,021.40	-	-1,505,585.90	22,376,435.50
二、本期期初净资产	23,882,021.40	-	-1,505,585.90	22,376,435.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,633,413.49	-	2,679,471.13	4,312,884.62
(一)、综合收益总额	-	-	2,729,903.30	2,729,903.30
(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)	1,633,413.49	-	-50,432.17	1,582,981.32
其中：1. 基金申购款	12,349,936.49	-	-306,641.03	12,043,295.46
2. 基金赎回款	-10,716,523.00	-	256,208.86	-10,460,314.14
(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	25,515,434.89	-	1,173,885.23	26,689,320.12

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：

经雷

梁凯

李袁

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

嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2071 号《关于准予嘉实中证 1000 指数增强型发

起式证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 11,861,498.98 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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、应用指南、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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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》、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》、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》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2017]56 号《关于资管

产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金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，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；

(2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(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；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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)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；

(4)对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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；

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税；

(6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	1,777,259.67
等于：本金	1,776,893.65
加：应计利息	366.02
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	7,523,420.01
等于：本金	7,522,735.75
加：应计利息	684.26
减：坏账准备	-
合计	9,300,679.68

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		116,507,975.14	-	118,244,023.05	1,736,047.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	568,198.00	4,200.36	657,076.16	84,677.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	568,198.00	4,200.36	657,076.16	84,677.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		117,076,173.14	4,200.36	118,901,099.21	1,820,725.71

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,569,760.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,569,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,569,760.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2609	IM2609	1.00	1,697,000.00	127,240.00
合计				127,240.00
减：可抵销期货暂收款				127,240.00
净额				0.00

注：衍生金融资产/负债项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产/负债项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	196.93
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	38,679.70
其他	2,401.16
合计	41,277.79

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实中证 1000 指数增强发起式 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,196,597.32	25,196,597.32
本期申购	33,819,235.59	33,819,235.59
本期赎回（以“-”号填列）	-22,763,932.43	-22,763,932.43
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	36,251,900.48	36,251,900.48

嘉实中证 1000 指数增强发起式 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,905,139.48	88,905,139.48
本期申购	162,552,648.22	162,552,648.22
本期赎回（以“-”号填列）	-203,061,882.49	-203,061,882.49
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	48,395,905.21	48,395,905.21

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实中证 1000 指数增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,665,444.28	1,091,050.40	7,756,494.68
本期期初	6,665,444.28	1,091,050.40	7,756,494.68
本期利润	7,872,422.48	-1,067,488.90	6,804,933.58
本期基金份额交易产生的变动数	2,605,912.36	1,406,503.22	4,012,415.58
其中：基金申购款	12,100,463.40	1,965,755.15	14,066,218.55
基金赎回款	-9,494,551.04	-559,251.93	-10,053,802.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,143,779.12	1,430,064.72	18,573,843.84

嘉实中证 1000 指数增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,675,077.41	3,808,789.58	26,483,866.99
本期期初	22,675,077.41	3,808,789.58	26,483,866.99
本期利润	14,813,624.99	-656,365.51	14,157,259.48
本期基金份额交易产生的变动数	-15,227,169.96	-1,265,644.95	-16,492,814.91
其中：基金申购款	62,492,437.83	2,291,496.55	64,783,934.38
基金赎回款	-77,719,607.79	-3,557,141.50	-81,276,749.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,261,532.44	1,886,779.12	24,148,311.56

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,191.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	13,935.30
结算备付金利息收入	3,987.19
其他	993.85
合计	28,107.76

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	22,616,417.22
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	22,616,417.22

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	492,592,245.45
减：卖出股票成本总额	469,489,381.85
减：交易费用	486,446.38
买卖股票差价收入	22,616,417.22

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	3,231.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	198.00
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	3,429.34

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	607,590.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	599,802.00
减：应计利息总额	7,590.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	198.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	141,133.26

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	775,691.74
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	775,691.74

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,851,094.41
股票投资	-1,912,581.91
债券投资	61,487.50
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	127,240.00
权证投资	-
期货投资	127,240.00
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	-1,723,854.41

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

基金赎回费收入	126,911.47
基金转出费收入	15,188.64
合计	142,100.11

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	13,884.51
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	—
银行划款手续费	3,054.91
存托服务费	4.93
合计	41,739.54

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害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
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	基金托管人的关联方

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	776,901.97	117,192.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	274,783.05	17,698.29
应支付基金管理人的净管理费	502,118.92	99,494.49

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	77,690.14	11,719.25

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	嘉实中证 1000 指数增强发起式 A	嘉实中证 1000 指数增强发起式 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	13,820.43	13,820.43
浦发银行	-	7,215.44	7,215.44
嘉实财富	-	585.02	585.02
合计	-	21,620.89	21,620.89
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实中证 1000 指数增强发起式 A	嘉实中证 1000 指数增强发起式 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	2,831.20	2,831.20
浦发银行	-	659.19	659.19
嘉实财富	-	789.10	789.10
合计	-	4,279.49	4,279.49

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

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

无。

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

无。

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

无。

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	嘉实中证 1000 指数增强发起式 A	嘉实中证 1000 指数增强发起式 C

报告期初持有的基金份额	10,001,805.73	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,805.73	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.59%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	嘉实中证 1000 指数增强发起式 A	嘉实中证 1000 指数增强发起式 C
报告期初持有的基金份额	10,001,805.73	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,805.73	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	55.43%	-

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

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

无。

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	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司_活期	1,777,259.67	9,191.42	1,032,946.49	1,241.41

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰海通证券股份有限公司	688781	视涯科技	网下申购	2,471	56,042.28
国泰海通证券股份有限公司	301696	三瑞智能	网下申购	1,168	28,826.24
国泰海通证券股份有限公司	301666	大普微	网下申购	719	33,131.52
国泰海通证券股份有限公司	688635	长进光子	网下申购	684	28,030.32
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 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
001220	世盟股	2026 年 1 月 27	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	42	1,176.00	1,166.76	-

	份	日								
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	73	3,887.98	4,288.02	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	763	5,966.66	15,824.62	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	69	1,268.22	1,157.82	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	180	4,894.20	5,635.80	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	288	13,271.04	133,439.04	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	163	11,354.58	26,089.78	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	40	3,135.20	4,870.80	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	117	2,887.56	10,155.60	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	135	1,509.30	2,374.65	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	35	1,172.15	1,187.55	-
603407	长裕集	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	122	1,690.92	8,962.12	-

	团	日								
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	81	1,276.56	3,783.51	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	122	2,159.40	10,287.04	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	69	2,827.62	21,265.11	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	658	11,528.16	23,635.36	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股锁定	22.68	42.16	1,607	36,446.76	67,751.12	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	36	3,318.48	16,673.40	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	47	3,848.36	74,463.51	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.41	24.13	607	3,890.87	14,646.91	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	139	3,652.92	23,920.51	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	274	5,392.32	38,768.26	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券	成功认购	受限期	流通受限	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名 称	日		类型			位： 张)			
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新债 未上 市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.12	-
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月 内(含)	新债 未上 市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.09	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受
限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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。

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、
制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经
营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会合规与
风险控制委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风
险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法

去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	504,469.68	504,552.55
合计	504,469.68	504,552.55

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	152,606.48	49,755.39
未评级	-	-

合计	152,606.48	49,755.39
----	------------	-----------

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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，因此除附注 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，其余均能以合理价格适时变现。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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 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	9,300,679.68	-	-	-	9,300,679.68
结算备付金	1,076,928.22	-	-	-	1,076,928.22
存出保证金	-	-	-	203,640.00	203,640.00
交易性金融资产	504,469.68	-	152,606.48	118,244,023.05	118,901,099.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,093,756.01	1,093,756.01
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,882,077.58	-	152,606.48	119,541,419.06	130,576,103.12
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,033,226.31	3,033,226.31
应付管理人报酬	-	-	-	105,631.04	105,631.04
应付托管费	-	-	-	10,563.09	10,563.09

应付销售服务费	-	-	-	15,434.06	15,434.06
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	9.74	9.74
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	41,277.79	41,277.79
负债总计	-	-	-	3,206,142.03	3,206,142.03
利率敏感度缺口	10,882,077.58	-	152,606.48	116,335,277.03	127,369,961.09
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	12,168,914.98	-	-	-	12,168,914.98
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	504,552.55	-	49,755.39	139,144,680.12	139,698,988.06
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,373,669.68	2,373,669.68
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,673,467.53	-	49,755.39	141,518,349.80	154,241,572.72
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,603,458.43	5,603,458.43
应付管理人报酬	-	-	-	166,361.28	166,361.28
应付托管费	-	-	-	16,636.16	16,636.16
应付销售服务费	-	-	-	35,010.63	35,010.63
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	78,007.74	78,007.74
负债总计	-	-	-	5,899,474.25	5,899,474.25
利率敏感度缺口	12,673,467.53	-	49,755.39	135,618,875.55	148,342,098.47

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	2,887.15	1,108.27
	市场利率上升 25 个基点	-2,840.30	-1,092.88

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。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股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降

低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 6 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	118,244,023.05	92.84	139,144,680.12	93.80
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	118,244,023.05	92.84	139,144,680.12	93.80

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	6,052,618.84	7,035,653.31
	业绩比较基准下降 5%	-6,052,618.84	-7,035,653.31

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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	117,876,282.03	139,194,435.51
第二层次	514,469.89	504,552.55
第三层次	510,347.29	-
合计	118,901,099.21	139,698,988.06

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

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	118,244,023.05	90.56
	其中：股票	118,244,023.05	90.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	657,076.16	0.50
	其中：债券	657,076.16	0.50

	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	10,377,607.90	7.95
8	其他各项资产	1,297,396.01	0.99
9	合计	130,576,103.12	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	154,252.00	0.12
B	采矿业	2,021,693.00	1.59
C	制造业	72,776,661.74	57.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,214,477.00	2.52
E	建筑业	948,169.00	0.74
F	批发和零售业	1,039,667.00	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	1,803,363.08	1.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,319,360.35	8.10
J	金融业	2,206,736.00	1.73
K	房地产业	1,961,721.00	1.54
L	租赁和商务服务业	835,220.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	935,732.00	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	531,792.00	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	178,620.00	0.14
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	930,228.00	0.73
S	综合	-	-
	合计	99,857,692.17	78.40

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	998,431.62	0.78
C	制造业	11,965,439.50	9.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	754,859.00	0.59
E	建筑业	261,000.00	0.20
F	批发和零售业	346,256.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,191,053.76	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	863,245.00	0.68
J	金融业	1,444,290.00	1.13
K	房地产业	28,292.00	0.02
L	租赁和商务服务业	204,344.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	329,120.00	0.26
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	18,386,330.88	14.44

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002484	江海股份	14,200	1,491,000.00	1.17
2	605376	博迁新材	5,300	1,437,890.00	1.13
3	688766	普冉股份	1,600	1,226,560.00	0.96
4	605111	新洁能	11,900	1,179,766.00	0.93

5	688536	思瑞浦	3,155	1,148,703.95	0.90
6	603678	火炬电子	13,200	1,095,600.00	0.86
7	603083	剑桥科技	4,100	1,044,967.00	0.82
8	688627	精智达	1,400	1,001,000.00	0.79
9	688388	嘉元科技	21,935	965,140.00	0.76
10	603063	禾望电气	18,100	957,309.00	0.75
11	600888	新疆众和	56,300	894,607.00	0.70
12	002643	万润股份	42,600	892,470.00	0.70
13	001339	智微智能	8,710	890,858.80	0.70
14	688605	先锋精科	8,500	884,170.00	0.69
15	300613	富瀚微	11,000	880,880.00	0.69
16	688548	广钢气体	16,700	870,070.00	0.68
17	300319	麦捷科技	29,200	865,196.00	0.68
18	688432	有研硅	21,500	859,355.00	0.67
19	300607	拓斯达	20,800	857,584.00	0.67
20	688300	联瑞新材	3,400	830,960.00	0.65
21	688368	晶丰明源	3,800	822,776.00	0.65
22	688110	东芯股份	4,000	814,800.00	0.64
23	688690	纳微科技	18,200	802,620.00	0.63
24	300576	容大感光	15,510	794,422.20	0.62
25	002518	科士达	14,800	793,132.00	0.62
26	688332	中科蓝讯	4,960	781,200.00	0.61
27	002428	云南锗业	6,500	781,170.00	0.61
28	601677	明泰铝业	46,900	778,540.00	0.61
29	002158	汉钟精机	20,500	760,140.00	0.60
30	300416	苏试试验	37,200	758,136.00	0.60
31	002768	国恩股份	14,500	754,870.00	0.59
32	601208	东材科技	10,500	743,295.00	0.58
33	002913	奥士康	11,100	709,734.00	0.56
34	688141	杰 华 特	4,600	706,100.00	0.55
35	688048	长光华芯	1,400	702,800.00	0.55
36	300357	我武生物	29,400	685,608.00	0.54
37	300870	欧陆通	1,980	684,466.20	0.54
38	603319	美湖股份	20,600	684,126.00	0.54
39	000636	风华高科	9,400	679,056.00	0.53
40	600461	洪城环境	74,100	671,346.00	0.53
41	002338	奥普光电	11,600	663,520.00	0.52
42	002948	青岛银行	130,100	660,908.00	0.52
43	600641	先导基电	16,500	657,690.00	0.52
44	002276	万马股份	64,700	654,117.00	0.51
45	600559	老白干酒	57,400	642,880.00	0.50
46	002563	森马服饰	125,200	631,008.00	0.50
47	601187	厦门银行	92,200	629,726.00	0.49

48	002911	佛燃能源	64,800	614,952.00	0.48
49	601860	紫金银行	253,300	612,986.00	0.48
50	688409	富创精密	2,000	612,500.00	0.48
51	603297	永新光学	4,100	602,495.00	0.47
52	002534	西子洁能	32,400	601,020.00	0.47
53	002004	华邦健康	149,900	589,107.00	0.46
54	600206	有研新材	8,700	579,420.00	0.45
55	603025	大豪科技	42,200	575,608.00	0.45
56	601096	宏盛华源	131,800	572,012.00	0.45
57	605333	沪光股份	33,100	564,355.00	0.44
58	603327	福蓉科技	63,000	534,240.00	0.42
59	603305	旭升集团	43,900	532,068.00	0.42
60	688559	海目星	6,200	520,304.00	0.41
61	688531	日联科技	2,900	515,736.00	0.40
62	002320	海峡股份	82,200	515,394.00	0.40
63	000811	冰轮环境	9,000	505,980.00	0.40
64	688779	五矿新能	60,900	493,899.00	0.39
65	300775	三角防务	22,400	493,696.00	0.39
66	300049	福瑞医科	12,500	486,000.00	0.38
67	000534	万泽股份	17,600	481,536.00	0.38
68	001359	平安电工	3,820	478,455.00	0.38
69	603638	艾迪精密	20,300	476,035.00	0.37
70	002779	中坚科技	6,000	471,360.00	0.37
71	603124	江南新材	2,500	467,450.00	0.37
72	600869	远东股份	13,800	461,886.00	0.36
73	002947	恒铭达	6,000	456,300.00	0.36
74	000061	农产品	81,400	455,840.00	0.36
75	002925	盈趣科技	18,400	453,744.00	0.36
76	600961	株冶集团	14,000	453,460.00	0.36
77	688515	裕太微	1,800	447,768.00	0.35
78	002017	东信和平	30,100	440,363.00	0.35
79	000603	盛达资源	18,900	436,590.00	0.34
80	002101	广东鸿图	45,700	435,978.00	0.34
81	002345	潮宏基	46,400	425,488.00	0.33
82	600502	安徽建工	96,700	420,645.00	0.33
83	601200	上海环境	63,100	416,460.00	0.33
84	300171	东富龙	37,500	414,750.00	0.33
85	300360	炬华科技	35,000	411,250.00	0.32
86	600821	金开新能	65,100	406,875.00	0.32
87	601126	四方股份	6,400	404,480.00	0.32
88	688516	奥特维	7,000	401,730.00	0.32
89	002174	游族网络	31,700	399,737.00	0.31
90	605123	派克新材	4,100	397,741.00	0.31

91	601801	皖新传媒	80,600	397,358.00	0.31
92	000810	创维数字	29,900	396,175.00	0.31
93	002093	国脉科技	62,600	394,380.00	0.31
94	001914	招商积余	48,300	394,128.00	0.31
95	601089	福元医药	24,200	393,976.00	0.31
96	688050	爱博医疗	10,789	393,259.05	0.31
97	002097	山河智能	54,200	391,866.00	0.31
98	002985	北摩高科	14,000	387,800.00	0.30
99	000685	中山公用	34,500	385,020.00	0.30
100	002545	东方铁塔	23,700	384,414.00	0.30
101	600033	福建高速	118,800	382,536.00	0.30
102	301196	唯科科技	3,050	382,531.00	0.30
103	002544	普天科技	20,800	378,976.00	0.30
104	300446	航天智造	21,700	365,211.00	0.29
105	300568	星源材质	19,300	361,296.00	0.28
106	688279	峰岬科技	1,600	359,104.00	0.28
107	688352	硕中科技	14,800	357,864.00	0.28
108	688486	龙迅股份	5,600	356,048.00	0.28
109	002745	木林森	28,100	352,655.00	0.28
110	301571	国科天成	5,400	351,972.00	0.28
111	600075	新疆天业	86,900	351,076.00	0.28
112	000930	中粮科技	80,500	342,125.00	0.27
113	002531	天顺风能	40,300	339,729.00	0.27
114	001287	中电港	10,900	339,535.00	0.27
115	600963	岳阳林纸	110,000	334,400.00	0.26
116	300811	铂科新材	3,500	332,115.00	0.26
117	605507	国邦医药	22,400	331,520.00	0.26
118	600773	西藏城投	25,700	330,759.00	0.26
119	688167	炬光科技	900	318,789.00	0.25
120	600266	城建发展	81,300	317,883.00	0.25
121	003039	顺控发展	28,400	312,684.00	0.25
122	603826	坤彩科技	12,100	309,276.00	0.24
123	002250	联化科技	22,600	308,942.00	0.24
124	600509	天富能源	36,200	305,890.00	0.24
125	603619	中曼石油	16,200	303,102.00	0.24
126	002163	海南发展	36,200	301,908.00	0.24
127	002895	川恒股份	10,200	297,840.00	0.23
128	002516	旷达科技	53,300	297,414.00	0.23
129	600353	旭光电子	6,400	291,840.00	0.23
130	603283	赛腾股份	3,600	291,528.00	0.23
131	600728	佳都科技	68,300	290,958.00	0.23
132	002840	华统股份	39,500	287,955.00	0.23
133	688800	瑞可达	2,940	282,151.80	0.22

134	300034	钢研高纳	16,400	281,096.00	0.22
135	000962	东方钨业	3,000	271,800.00	0.21
136	603306	华懋科技	2,600	269,594.00	0.21
137	688686	奥普特	1,600	269,424.00	0.21
138	300913	兆龙互连	5,600	268,296.00	0.21
139	002987	京北方	27,480	267,380.40	0.21
140	002043	兔宝宝	24,000	265,920.00	0.21
141	301556	托普云农	4,500	263,070.00	0.21
142	300990	同飞股份	2,500	262,675.00	0.21
143	600325	华发股份	113,100	261,261.00	0.21
144	300260	新莱应材	2,600	261,196.00	0.21
145	603663	三祥新材	2,700	260,010.00	0.20
146	600388	龙净环保	17,800	258,990.00	0.20
147	301511	德福科技	1,800	258,930.00	0.20
148	300184	力源信息	14,600	256,230.00	0.20
149	603267	鸿远电子	3,300	255,684.00	0.20
150	603202	天有为	5,200	255,528.00	0.20
151	600259	中稀有色	2,500	254,025.00	0.20
152	603556	海兴电力	11,400	250,800.00	0.20
153	600269	赣粤高速	62,900	250,342.00	0.20
154	002123	梦网科技	34,700	249,493.00	0.20
155	002222	福晶科技	2,700	249,156.00	0.20
156	688182	灿勤科技	5,700	245,499.00	0.19
157	688776	国光电气	4,000	245,360.00	0.19
158	002747	埃斯顿	6,500	242,645.00	0.19
159	603516	淳中科技	1,800	242,298.00	0.19
160	600782	新钢股份	97,600	242,048.00	0.19
161	300773	拉卡拉	15,680	239,904.00	0.19
162	600273	嘉化能源	36,600	238,632.00	0.19
163	688596	正帆科技	3,000	237,180.00	0.19
164	600686	金龙汽车	21,000	237,090.00	0.19
165	603927	中科软	18,500	235,135.00	0.18
166	002572	索菲亚	32,200	235,060.00	0.18
167	603530	神马电力	4,600	234,140.00	0.18
168	688262	国芯科技	5,400	233,442.00	0.18
169	301217	铜冠铜箔	1,400	231,098.00	0.18
170	002110	三钢闽光	79,800	229,824.00	0.18
171	300409	道氏技术	11,500	229,195.00	0.18
172	688519	南亚新材	600	228,024.00	0.18
173	600916	中国黄金	33,300	227,772.00	0.18
174	002373	千方科技	31,700	227,606.00	0.18
175	600933	爱柯迪	15,300	226,134.00	0.18
176	002941	新疆交建	23,900	225,616.00	0.18

177	000555	神州信息	21,800	224,540.00	0.18
178	688658	悦康药业	17,300	222,478.00	0.17
179	002928	华夏航空	31,800	222,282.00	0.17
180	688484	南芯科技	3,900	220,311.00	0.17
181	688630	芯基微装	400	219,756.00	0.17
182	300674	宇信科技	14,600	219,730.00	0.17
183	000543	皖能电力	28,900	218,773.00	0.17
184	002690	美亚光电	15,200	217,816.00	0.17
185	002075	沙钢股份	63,900	217,260.00	0.17
186	001337	四川黄金	5,900	216,294.00	0.17
187	688522	纳睿雷达	10,640	213,012.80	0.17
188	301095	广立微	1,800	212,490.00	0.17
189	300687	赛意信息	6,800	210,800.00	0.17
190	600577	精达股份	21,400	209,292.00	0.16
191	300672	国科微	700	206,500.00	0.16
192	688700	东威科技	2,300	205,620.00	0.16
193	688326	经纬恒润	2,900	205,552.00	0.16
194	300036	超图软件	18,200	205,114.00	0.16
195	601921	浙版传媒	30,300	202,707.00	0.16
196	603733	仙鹤股份	7,500	202,575.00	0.16
197	300257	开山股份	7,000	200,760.00	0.16
198	300253	卫宁健康	29,700	199,881.00	0.16
199	688400	凌云光	3,000	198,600.00	0.16
200	600556	天下秀	44,700	197,574.00	0.16
201	000923	河钢资源	15,800	196,078.00	0.15
202	301029	怡合达	7,200	194,472.00	0.15
203	600373	中文传媒	28,900	191,607.00	0.15
204	601778	晶科科技	43,700	187,910.00	0.15
205	600057	厦门象屿	33,900	183,738.00	0.14
206	003010	若羽臣	7,500	182,250.00	0.14
207	603162	海通发展	20,064	179,974.08	0.14
208	300492	华图山鼎	5,200	178,620.00	0.14
209	688150	莱特光电	2,600	178,412.00	0.14
210	301297	富乐德	2,900	177,596.00	0.14
211	601963	重庆银行	17,400	175,392.00	0.14
212	603599	广信股份	18,000	172,440.00	0.14
213	002405	四维图新	25,300	163,691.00	0.13
214	600201	生物股份	13,900	161,935.00	0.13
215	600301	华锡有色	2,600	159,432.00	0.13
216	605020	永和股份	3,800	154,736.00	0.12
217	002041	登海种业	19,600	154,252.00	0.12
218	002045	国光电器	19,600	153,860.00	0.12
219	600330	天通股份	4,900	151,116.00	0.12

220	688668	鼎通科技	400	149,320.00	0.12
221	688208	道通科技	5,831	146,882.89	0.12
222	300855	图南股份	4,600	143,796.00	0.11
223	601083	锦江航运	14,300	142,142.00	0.11
224	301371	敷尔佳	5,200	135,200.00	0.11
225	002324	普利特	11,100	133,977.00	0.11
226	300772	运达股份	10,800	132,840.00	0.10
227	600366	宁波韵升	8,800	129,184.00	0.10
228	002317	众生药业	5,200	127,764.00	0.10
229	601519	大智慧	14,800	127,724.00	0.10
230	300529	健帆生物	8,100	124,740.00	0.10
230	600587	新华医疗	10,500	124,740.00	0.10
231	300298	三诺生物	8,900	124,155.00	0.10
232	301238	瑞泰新材	5,000	122,000.00	0.10
233	600771	广誉远	9,400	121,730.00	0.10
234	601595	上海电影	7,300	121,180.00	0.10
235	600395	盘江股份	26,100	119,016.00	0.09
236	603567	珍宝岛	27,100	118,698.00	0.09
237	600740	山西焦化	36,900	117,711.00	0.09
238	000552	甘肃能化	52,400	117,376.00	0.09
239	601882	海天精工	5,800	117,334.00	0.09
240	600718	东软集团	16,100	116,564.00	0.09
241	301602	超研股份	8,400	115,416.00	0.09
242	600323	瀚蓝环境	4,200	115,332.00	0.09
243	600123	兰花科创	21,000	112,140.00	0.09
244	301510	固高科技	3,500	111,755.00	0.09
245	600452	涪陵电力	11,900	111,027.00	0.09
246	600575	淮河能源	34,700	110,693.00	0.09
247	002867	周大生	9,800	109,270.00	0.09
248	300101	振芯科技	6,700	108,339.00	0.09
249	600971	恒源煤电	15,600	107,640.00	0.08
250	605599	莱百股份	7,800	106,860.00	0.08
251	300580	贝斯特	5,200	104,572.00	0.08
252	002488	金固股份	11,700	104,247.00	0.08
253	600185	珠免集团	22,700	102,150.00	0.08
254	603809	豪能股份	11,600	101,732.00	0.08
255	301061	匠心家居	2,900	101,703.00	0.08
256	600750	华润江中	4,500	99,315.00	0.08
257	002654	万润科技	4,200	93,492.00	0.07
258	301631	壹连科技	1,300	93,418.00	0.07
259	002245	蔚蓝锂芯	4,900	91,679.00	0.07
260	301031	中熔电气	740	88,393.00	0.07
261	301339	通行宝	6,900	70,587.00	0.06

262	000969	安泰科技	2,800	68,712.00	0.05
263	300363	博腾股份	4,100	66,584.00	0.05
264	300525	博思软件	8,000	59,520.00	0.05
265	600866	星湖科技	12,600	55,314.00	0.04
266	300085	银之杰	700	24,479.00	0.02
267	601900	南方传媒	1,600	17,376.00	0.01
268	603533	掌阅科技	100	2,029.00	0.00
269	002020	京新药业	100	1,249.00	0.00
270	002716	湖南白银	100	809.00	0.00

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	688378	奥来德	11,000	682,000.00	0.54
2	600105	永鼎股份	9,900	668,052.00	0.52
3	002384	东山精密	2,400	629,640.00	0.49
4	301086	鸿富瀚	2,900	606,912.00	0.48
5	002841	视源股份	16,200	559,386.00	0.44
6	600027	华电国际	117,000	520,650.00	0.41
7	600595	中孚实业	88,600	497,932.00	0.39
8	300681	英搏尔	16,400	469,368.00	0.37
9	600150	中国船舶	13,500	456,165.00	0.36
10	001965	招商公路	49,300	451,588.00	0.35
11	002487	大金重工	7,600	440,572.00	0.35
12	000932	华菱钢铁	122,500	425,075.00	0.33
13	600985	淮北矿业	29,900	420,095.00	0.33
14	601939	建设银行	42,500	409,275.00	0.32
15	688200	华峰测控	776	407,477.60	0.32
16	600460	士兰微	7,300	399,018.00	0.31
17	688498	源杰科技	205	386,630.00	0.30
18	600028	中国石化	86,200	384,452.00	0.30
19	688328	深科达	4,000	382,800.00	0.30
20	601988	中国银行	61,300	350,636.00	0.28
21	601009	南京银行	35,100	347,139.00	0.27
22	002803	吉宏股份	13,400	346,256.00	0.27
23	600115	中国东航	86,400	329,184.00	0.26
24	688046	药康生物	13,600	329,120.00	0.26
25	601869	长飞光纤	600	327,540.00	0.26
26	300979	华利集团	10,800	321,300.00	0.25
27	600999	招商证券	13,600	286,960.00	0.23
28	688045	必易微	3,300	266,574.00	0.21
29	605289	罗曼股份	1,800	261,000.00	0.20
30	300661	圣邦股份	1,800	258,264.00	0.20
31	300308	中际旭创	200	254,000.00	0.20

32	600189	泉阳泉	33,700	253,761.00	0.20
33	000596	古井贡酒	3,100	247,380.00	0.19
34	603239	浙江仙通	16,400	242,884.00	0.19
35	688059	华锐精密	1,200	239,652.00	0.19
36	300413	芒果超媒	16,300	238,469.00	0.19
37	003816	中国广核	59,900	234,209.00	0.18
38	688052	纳芯微	800	230,648.00	0.18
39	600104	上汽集团	22,400	218,624.00	0.17
40	000429	粤高速 A	15,700	214,305.00	0.17
41	600299	安迪苏	26,900	211,165.00	0.17
42	002600	领益智造	11,900	206,346.00	0.16
43	601298	青岛港	24,200	194,810.00	0.15
44	603186	华正新材	800	180,240.00	0.14
45	000983	山西焦煤	30,700	178,060.00	0.14
46	688785	恒运昌	359	173,015.09	0.14
47	300666	江丰电子	400	147,440.00	0.12
48	002079	苏州固锔	9,800	147,294.00	0.12
49	002027	分众传媒	27,600	133,584.00	0.10
50	301666	大普微	288	133,439.04	0.10
51	603031	安孚科技	2,500	133,125.00	0.10
52	000938	紫光股份	4,500	129,870.00	0.10
53	688337	普源精电	1,610	120,637.30	0.09
54	301608	博实结	2,400	120,624.00	0.09
55	300663	科蓝软件	16,700	111,222.00	0.09
56	603256	宏和科技	400	106,132.00	0.08
57	300824	北鼎股份	11,700	84,006.00	0.07
58	688808	联讯仪器	47	74,463.51	0.06
59	600060	海信视像	2,600	72,462.00	0.06
60	600861	北京人力	5,800	70,760.00	0.06
61	603600	永艺股份	7,800	69,186.00	0.05
62	688781	视涯科技	1,607	67,751.12	0.05
63	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.04
64	688331	荣昌生物	400	52,104.00	0.04
65	301536	星宸科技	400	51,484.00	0.04
66	601881	中国银河	4,000	50,280.00	0.04
67	688820	盛合晶微	274	38,768.26	0.03
68	000761	本钢板材	14,200	30,530.00	0.02
69	001979	招商蛇口	4,400	28,292.00	0.02
70	301682	宏明电子	163	26,089.78	0.02
71	688813	泰金新能	139	23,920.51	0.02
72	688712	北芯生命	658	23,635.36	0.02
73	688635	长进光子	69	21,265.11	0.02
74	688343	云天励飞	200	16,332.00	0.01

75	001257	盛龙股份	763	15,824.62	0.01
76	688811	有研复材	607	14,646.91	0.01
77	000737	北方铜业	800	10,576.00	0.01
78	603459	红板科技	122	10,287.04	0.01
79	301696	三瑞智能	117	10,155.60	0.01
80	603407	长裕集团	122	8,962.12	0.01
81	688600	皖仪科技	200	6,656.00	0.01
82	688269	凯立新材	200	6,342.00	0.00
83	001365	天海电子	180	5,635.80	0.00
84	301683	慧谷新材	40	4,870.80	0.00
85	001237	惠康科技	73	4,288.02	0.00
86	603435	嘉德利	81	3,783.51	0.00
87	601112	振石股份	135	2,374.65	0.00
88	603293	埃泰克	35	1,187.55	0.00
89	001220	世盟股份	42	1,166.76	0.00
90	001312	福恩股份	69	1,157.82	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	002484	江海股份	3,170,060.00	2.14
2	001309	德明利	2,639,254.00	1.78
3	000899	赣能股份	2,335,623.00	1.57
4	301156	美农生物	2,238,870.00	1.51
5	002911	佛燃能源	2,100,502.00	1.42
6	300378	鼎捷数智	2,025,568.00	1.37
7	605376	博迁新材	1,997,519.00	1.35
8	603327	福蓉科技	1,983,287.00	1.34
9	688110	东芯股份	1,973,981.46	1.33
10	688141	杰 华 特	1,888,973.90	1.27
11	688362	甬矽电子	1,876,875.09	1.27
12	603171	税友股份	1,852,809.00	1.25
13	002752	昇兴股份	1,836,139.00	1.24
14	603297	永新光学	1,812,734.00	1.22
15	300244	迪安诊断	1,793,868.00	1.21
16	000422	湖北宜化	1,772,466.00	1.19
17	300446	航天智造	1,766,461.00	1.19
18	300438	鹏辉能源	1,757,319.00	1.18
19	002017	东信和平	1,751,266.00	1.18
20	605198	安德利	1,748,888.00	1.18

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	001309	德明利	3,284,136.51	2.21
2	000899	赣能股份	2,885,141.00	1.94
3	600114	东睦股份	2,648,371.00	1.79
4	688362	甬矽电子	2,541,705.81	1.71
5	688498	源杰科技	2,458,581.41	1.66
6	688200	华峰测控	2,366,625.23	1.60
7	688091	上海谊众	2,330,308.29	1.57
8	300475	香农芯创	2,325,227.00	1.57
9	301156	美农生物	2,239,739.20	1.51
10	300409	道氏技术	2,228,615.00	1.50
11	688123	聚辰股份	2,224,435.29	1.50
12	600353	旭光电子	2,173,070.00	1.46
13	002324	普利特	2,171,513.00	1.46
14	688313	仕佳光子	2,166,292.97	1.46
15	688536	思瑞浦	2,140,557.16	1.44
16	300323	华灿光电	2,088,473.00	1.41
17	688380	中微半导	2,081,605.11	1.40
18	002258	利尔化学	2,045,173.60	1.38
19	002545	东方铁塔	2,025,269.00	1.37
20	002484	江海股份	1,999,653.00	1.35

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	450,501,306.69
卖出股票收入（成交）总额	492,592,245.45

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	504,469.68	0.40
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）	152,606.48	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	657,076.16	0.52

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	019827	26 国债 01	3,000	301,944.58	0.24
2	019785	25 国债 13	2,000	202,525.10	0.16
3	118062	天准转债	130	40,562.35	0.03
4	118065	艾为转债	250	38,630.03	0.03
5	123267	珂玛转债	60	26,375.80	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的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	203,640.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,093,756.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,297,396.01

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118062	天准转债	40,562.35	0.03
2	113697	应流转债	23,845.72	0.02
3	118061	茂莱转债	13,192.37	0.01

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

无。

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

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
嘉实中证1000 指数增强发起式 A	939	38,606.92	10,001,805.73	27.59	26,250,094.75	72.41

嘉实中证 1000 指数增强发起式 C	8,112	5,965.96	9,551,491.89	19.74	38,844,413.32	80.26
合计	8,996	9,409.49	19,553,297.62	23.10	65,094,508.07	76.90

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实中证 1000 指数增强发起式 A	286,434.49	0.79
	嘉实中证 1000 指数增强发起式 C	62,015.33	0.13
	合计	348,449.82	0.41

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实中证 1000 指数增强发起式 A	0
	嘉实中证 1000 指数增强发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实中证 1000 指数增强发起式 A	10~50
	嘉实中证 1000 指数增强发起式 C	0
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,805.73	11.82	10,001,805.73	11.82	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-

基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,805.73	11.82	10,001,805.73	11.82	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中证 1000 指数增强发起式 A	嘉实中证 1000 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2022 年 12 月 6 日）基金份额总额	11,384,017.96	477,481.02
本报告期期初基金份额总额	25,196,597.32	88,905,139.48
本报告期基金总申购份额	33,819,235.59	162,552,648.22
减：本报告期基金总赎回份额	22,763,932.43	203,061,882.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	36,251,900.48	48,395,905.21

注：报告期期间基金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

报告期内未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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况
2026 年 6 月 26 日本基金管理人发布公告，程剑先生离任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况
报告期内，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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为德勤华永会计师事务所（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

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 2 月 12 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从制度建设、流程机制等方面整改完毕。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 1 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面整改完毕，已通过整改验收。
其他	-

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，托管人无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

报告期内，托管人相关从业人员无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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方财富证券股份有限公司	3	942,489,363.18	100.00	179,700.22	100.00	-
上海浦东发展银行股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金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等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 合规风控能力较强；
- (4) 交易服务能力较强。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 报告期内，本基金新增以下交易单元：上海浦东发展银行股份有限公司新增交易单元 1 个。

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 (%)
东方财富证券股份有限公司	600,399.00	100.00	-	-	-	-
上海浦东发展银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 19 日
2	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 2 日
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 10 日
4	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 21 日
5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，

或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日