

嘉实中证 A100 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	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	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	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	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	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43

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	43
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	43
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	43
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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	45
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	47
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	48
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 A100 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉实中证 A100 指数增强发起式	
基金主代码	021799	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 12 月 24 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	11,102,330.99 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 A100 指数增强发起式 A	嘉实中证 A100 指数增强发起式 C
下属分级基金的交 易代码	021799	021800
报告期末下属分级 基金的份额总额	10,728,361.83 份	373,969.16 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，力求对标的指数（中证 A100 指数）进行有效跟踪的基础上，通过精选个股策略增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 A100 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策略。
业绩比较基准	中证 A100 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	招商银行股份有限公司
信息披露	姓名	郭松	张姗

负责人	联系电话	(010)65215588	400-61-95555
	电子邮箱	service@jsfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-600-8800	400-61-95555
传真		(010)65215588	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100020	518040
法定代表人		经雷	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告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 A100 指数增强发起式 A	嘉实中证 A100 指数增强发起式 C
本期已实现收益	672,423.99	13,393.95
本期利润	1,611,293.65	43,171.60
加权平均基金份 额本期利润	0.1533	0.1736
本期加权平均净 值利润率	12.33%	13.85%
本期基金份额净 值增长率	12.81%	12.67%
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	1, 219, 001. 14	40, 782. 61
期末可供分配基金份额利润	0. 1136	0. 1091
期末基金资产净值	14, 425, 913. 88	500, 931. 25
期末基金份额净值	1. 3447	1. 3395
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	34. 47%	33. 95%

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 A100 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	15. 24%	1. 28%	11. 76%	1. 30%	3. 48%	-0. 02%
过去六个月	12. 81%	1. 17%	8. 08%	1. 16%	4. 73%	0. 01%
过去一年	34. 62%	1. 05%	28. 86%	1. 05%	5. 76%	0. 00%
自基金合同生效起至今	34. 47%	1. 02%	29. 28%	1. 02%	5. 19%	0. 00%

嘉实中证 A100 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	15. 16%	1. 28%	11. 76%	1. 30%	3. 40%	-0. 02%
过去六个月	12. 67%	1. 17%	8. 08%	1. 16%	4. 59%	0. 01%

过去一年	34.29%	1.05%	28.86%	1.05%	5.43%	0.00%
自基金合同生效起 至今	33.95%	1.02%	29.28%	1.02%	4.67%	0.00%

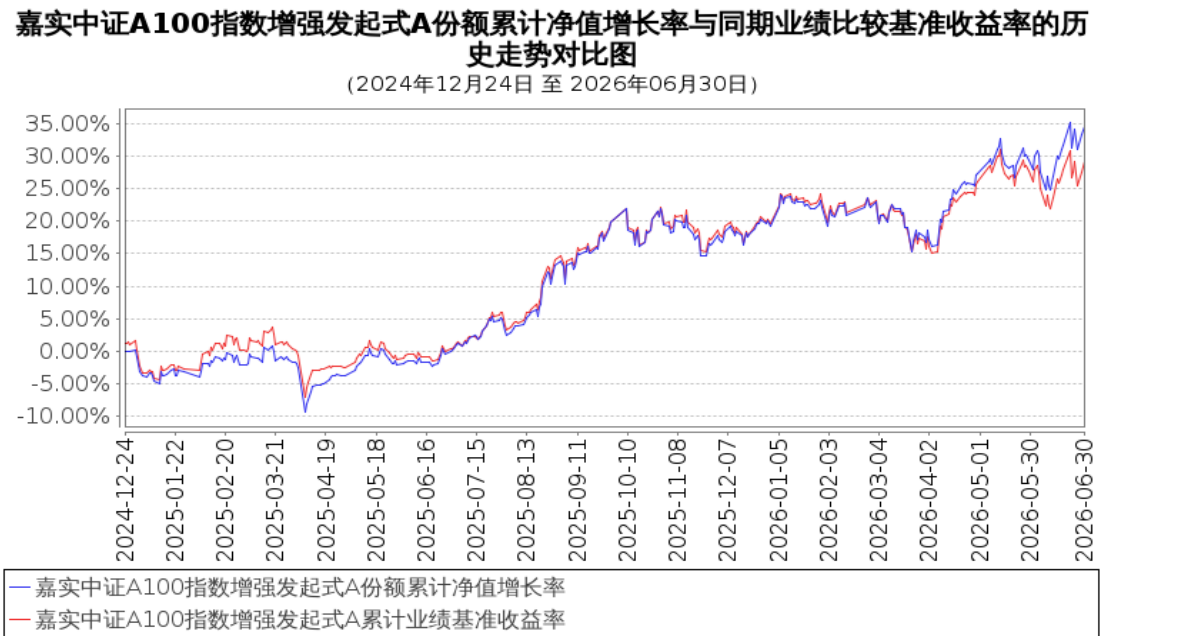
注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = (\text{中证 A100 指数}(t) / \text{中证 A100 指数}(t-1) - 1) \times 95\% + ((1 + \text{银行活期存款利率(税后)})^{(1/365)} - 1) \times 5\%$$

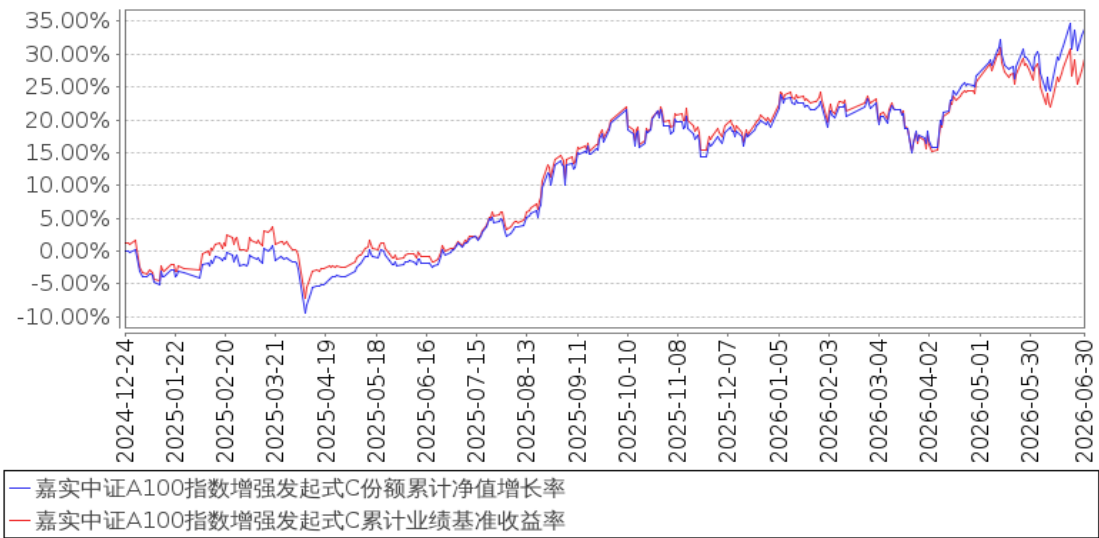
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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A100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
(2024年12月24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	2025 年 2 月 24 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1000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。

（3）2026 年 8 月 4 日，本基金管理人发布《关于嘉实中证 A100 指数增强发起式经理变更的公告》，龙昌伦先生不再担任本基金基金经理，增聘郑金陶先生担任本基金基金经理，该基金将由郑金陶先生单独管理。

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 A100 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、半导体设备方向对资金产生虹吸效应。行业方面，电子、通信、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 A100 指数增强发起式 A 基金份额净值为 1.3447 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.81%；截至本报告期末嘉实中证 A100 指数增强发起式 C 基金份额净值为 1.3395 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.67%；业绩比较基准收益率为 8.08%。

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

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证 A100 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	974,852.77	837,515.95
结算备付金		16,994.16	8,254.19
存出保证金		1,098.00	896.89
交易性金融资产	6.4.7.2	13,951,650.24	12,046,414.63
其中：股票投资		13,951,650.24	12,046,414.63

基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		698,921.56	-
应收股利		-	-
应收申购款		38,504.06	29.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		15,682,020.79	12,893,111.65
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		737,273.62	-
应付赎回款		1,187.41	224.34
应付管理人报酬		9,452.81	8,696.53
应付托管费		2,363.19	2,174.13
应付销售服务费		108.83	117.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	4,789.80	6,692.16
负债合计		755,175.66	17,904.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	11,102,330.99	10,802,592.46
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,824,514.14	2,072,614.55
净资产合计		14,926,845.13	12,875,207.01
负债和净资产总计		15,682,020.79	12,893,111.65

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实中证 A100 指数增强发起式 A 基金份额净值 1.3447 元，基金份额总额 10,728,361.83 份，嘉实中证 A100 指数增强发起式 C 基金份额净值 1.3395 元，基金份额总额 373,969.16 份，基金份额总额合计为 11,102,330.99 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证 A100 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		1,724,239.95	183,264.78
1. 利息收入		1,596.02	1,839.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,596.02	1,839.08
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）		753,788.55	10,933.78
其中：股票投资收益	6.4.7.14	621,572.61	-123,325.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	132,215.94	134,259.22
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	968,647.31	170,463.43
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	208.07	28.49
减：二、营业总支出		69,774.70	112,336.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	52,950.80	39,341.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,237.73	9,835.29
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	381.47	167.30
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		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	3, 204. 70	62, 992. 46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 654, 465. 25	70, 928. 43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 654, 465. 25	70, 928. 43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1, 654, 465. 25	70, 928. 43

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证 A100 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	10, 802, 592. 46	-	2, 072, 614. 55	12, 875, 207. 01
二、本期期初净资产	10, 802, 592. 46	-	2, 072, 614. 55	12, 875, 207. 01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	299, 738. 53	-	1, 751, 899. 59	2, 051, 638. 12
（一）、综合收益总额	-	-	1, 654, 465. 25	1, 654, 465. 25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	299, 738. 53	-	97, 434. 34	397, 172. 87
其中：1. 基金申购款	851, 572. 47	-	235, 387. 67	1, 086, 960. 14
2. 基金赎回款	-551, 833. 94	-	-137, 953. 33	-689, 787. 27
（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	11,102,330.99	-	3,824,514.14	14,926,845.13
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	10,148,319.44	-	-82,934.28	10,065,385.16
二、本期期初净资产	10,148,319.44	-	-82,934.28	10,065,385.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-40,756.51	-	71,357.75	30,601.24
(一)、综合收益总额	-	-	70,928.43	70,928.43
(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)	-40,756.51	-	429.32	-40,327.19
其中：1. 基金申购款	44,303.97	-	-699.67	43,604.30
2. 基金赎回款	-85,060.48	-	1,128.99	-83,931.49
(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	10,107,562.93	-	-11,576.53	10,095,986.40

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

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

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 A100 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[2023]2090 号《关于准予嘉实创新趋势股票型发起式证券投资基金注册的批复》和证监许可[2024]929 号《关于准予嘉实创新趋势股票型发起式证券投资基金变更注册的批复》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 A100 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 A100 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2024 年 12 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,148,319.44 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1 号《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[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，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% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 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	974,852.77
等于：本金	974,756.52
加：应计利息	96.25
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	974,852.77

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		11,546,430.74	-	13,951,650.24	2,405,219.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		11,546,430.74	-	13,951,650.24	2,405,219.50

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

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	0.49
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,309.61
其中：交易所市场	2,309.61
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	2,479.70
合计	4,789.80

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实中证 A100 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	10,346,995.57	10,346,995.57
本期申购	464,094.95	464,094.95
本期赎回（以“-”号填列）	-82,728.69	-82,728.69
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	10,728,361.83	10,728,361.83

嘉实中证 A100 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	455,596.89	455,596.89
本期申购	387,477.52	387,477.52
本期赎回（以“-”号填列）	-469,105.25	-469,105.25
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	373,969.16	373,969.16

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 A100 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	510,804.98	1,475,735.56	1,986,540.54
本期期初	510,804.98	1,475,735.56	1,986,540.54
本期利润	672,423.99	938,869.66	1,611,293.65
本期基金份额交易产生的变动数	35,772.17	63,945.69	99,717.86
其中：基金申购款	44,165.66	79,904.94	124,070.60
基金赎回款	-8,393.49	-15,959.25	-24,352.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,219,001.14	2,478,550.91	3,697,552.05

嘉实中证 A100 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	21,209.99	64,864.02	86,074.01
本期期初	21,209.99	64,864.02	86,074.01
本期利润	13,393.95	29,777.65	43,171.60
本期基金份额交易产生的变动数	6,178.67	-8,462.19	-2,283.52
其中：基金申购款	36,829.00	74,488.07	111,317.07
基金赎回款	-30,650.33	-82,950.26	-113,600.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,782.61	86,179.48	126,962.09

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	1,554.67
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	30.81
其他	10.54
合计	1,596.02

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	621,572.61
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	621,572.61

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	13,643,096.08
减：卖出股票成本总额	13,007,802.67
减：交易费用	13,720.80
买卖股票差价收入	621,572.61

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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

无。

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	132,215.94
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	132,215.94

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	968,647.31
股票投资	968,647.31
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	968,647.31

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	202.08
基金转出费收入	5.99
合计	208.07

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	2,479.70
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	725.00
合计	3,204.70

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

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	52,950.80	39,341.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	781.26	27.93
应支付基金管理人的净管理费	52,169.54	39,313.37

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 0.80%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×0.80%/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	13,237.73	9,835.29

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/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 A100 指数增强发起式 A	嘉实中证 A100 指数增强发起式 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	159.31	159.31
招商银行	-	44.32	44.32
合计	-	203.63	203.63
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 A100 指数增强发起式 A	嘉实中证 A100 指数增强发起式 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	151.75	151.75
合计	-	151.75	151.75

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，逐日累计至每月月底，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 A100 指数增强发起式 A	嘉实中证 A100 指数增强发起式 C

报告期初持有的基金份额	10,002,139.10	-
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	10,002,139.10	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	93.23%	-
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 A100 指数增强发起式 A	嘉实中证 A100 指数增强发起式 C
报告期初持有的基金份额	10,002,139.10	-
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	10,002,139.10	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	99.97%	-

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
招商银行股份有限公司_活期	974,852.77	1,554.67	763,045.83	1,337.02

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

无。

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

无。

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 risk 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

无。

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

无。

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约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	974,852.77	-	-	-	974,852.77
结算备付金	16,994.16	-	-	-	16,994.16
存出保证金	1,098.00	-	-	-	1,098.00
交易性金融资产	-	-	-	13,951,650.24	13,951,650.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	698,921.56	698,921.56
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	38,504.06	38,504.06
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	992,944.93	-	-	14,689,075.86	15,682,020.79
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	-	-	-	737,273.62	737,273.62
应付赎回款	-	-	-	1,187.41	1,187.41
应付管理人报酬	-	-	-	9,452.81	9,452.81
应付托管费	-	-	-	2,363.19	2,363.19
应付销售服务费	-	-	-	108.83	108.83
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,789.80	4,789.80
负债总计	-	-	-	755,175.66	755,175.66
利率敏感度缺口	992,944.93	-	-	13,933,900.20	14,926,845.13

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	837,515.95	-	-	-	837,515.95
结算备付金	8,254.19	-	-	-	8,254.19
存出保证金	896.89	-	-	-	896.89
交易性金融资产	-	-	-	12,046,414.63	12,046,414.63
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	-	-	-	29.99	29.99
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	846,667.03	-	-	12,046,444.62	12,893,111.65
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	-	-	-	224.34	224.34
应付管理人报酬	-	-	-	8,696.53	8,696.53
应付托管费	-	-	-	2,174.13	2,174.13
应付销售服务费	-	-	-	117.48	117.48
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,692.16	6,692.16
负债总计	-	-	-	17,904.64	17,904.64
利率敏感度缺口	846,667.03	-	-	12,028,539.98	12,875,207.01

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	-	-
	市场利率上升 25 个基点	-	-

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	13,951,650.24	93.47	12,046,414.63	93.56
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	13,951,650.24	93.47	12,046,414.63	93.56

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%	740,986.75	636,538.31
	业绩比较基准下降 5%	-740,986.75	-636,538.31

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	13,951,650.24	11,926,955.88
第二层次	—	119,458.75
第三层次	—	—
合计	13,951,650.24	12,046,414.63

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，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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。
--

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	13,951,650.24	88.97
	其中：股票	13,951,650.24	88.97
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	991,846.93	6.32
8	其他各项资产	738,523.62	4.71
9	合计	15,682,020.79	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	851,975.00	5.71
C	制造业	8,623,999.34	57.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	381,726.00	2.56
E	建筑业	30,380.00	0.20
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	265,152.00	1.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	685,520.90	4.59
J	金融业	738,989.00	4.95
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	348,628.00	2.34
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	11,926,370.24	79.90

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	78,522.00	0.53
C	制造业	1,172,024.00	7.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,337.00	0.20

E	建筑业	82,335.00	0.55
F	批发和零售业	112,921.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	118,006.00	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	141,835.00	0.95
J	金融业	289,244.00	1.94
K	房地产业	1,056.00	0.01
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	2,025,280.00	13.57

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	300308	中际旭创	1,000	1,270,000.00	8.51
2	300750	宁德时代	2,400	943,224.00	6.32
3	603986	兆易创新	800	652,000.00	4.37
4	688256	寒武纪	298	475,473.90	3.19
5	600519	贵州茅台	400	474,196.00	3.18
6	002371	北方华创	470	415,743.20	2.79
7	601899	紫金矿业	16,300	409,782.00	2.75
8	000333	美的集团	5,200	392,756.00	2.63
9	000725	京东方 A	42,000	364,560.00	2.44
10	600900	长江电力	13,500	357,345.00	2.39
11	603259	药明康德	2,800	348,628.00	2.34
12	601318	中国平安	6,800	324,632.00	2.17
13	600276	恒瑞医药	5,100	265,404.00	1.78

14	601398	工商银行	36,700	259,469.00	1.74
15	688012	中微公司	498	233,313.00	1.56
16	688041	海光信息	600	222,180.00	1.49
17	688008	澜起科技	715	221,578.50	1.48
18	002463	沪电股份	1,400	213,920.00	1.43
19	002475	立讯精密	3,000	211,200.00	1.41
20	600150	中国船舶	6,200	209,498.00	1.40
21	300476	胜宏科技	600	207,858.00	1.39
22	603019	中科曙光	1,900	203,737.00	1.36
23	000651	格力电器	4,700	176,250.00	1.18
24	688981	中芯国际	1,102	175,019.64	1.17
25	300274	阳光电源	1,100	174,922.00	1.17
26	002415	海康威视	5,000	171,000.00	1.15
27	601088	中国神华	4,000	156,160.00	1.05
28	300059	东方财富	7,600	154,888.00	1.04
29	603993	洛阳钼业	8,600	150,930.00	1.01
30	601816	京沪高铁	33,000	149,490.00	1.00
31	600660	福耀玻璃	2,700	136,188.00	0.91
32	600406	国电南瑞	5,800	132,530.00	0.89
33	000100	TCL 科技	21,700	126,294.00	0.85
34	600031	三一重工	7,200	124,416.00	0.83
35	600309	万华化学	1,800	123,138.00	0.82
36	002352	顺丰控股	3,700	115,662.00	0.77
37	600019	宝钢股份	21,200	115,116.00	0.77
38	002594	比亚迪	1,200	95,640.00	0.64
39	300124	汇川技术	1,400	92,862.00	0.62
40	600089	特变电工	4,100	92,250.00	0.62
41	000063	中兴通讯	2,500	90,475.00	0.61
42	603799	华友钴业	1,800	86,868.00	0.58
43	000425	徐工机械	10,500	84,945.00	0.57
44	600941	中国移动	900	77,517.00	0.52
45	600489	中金黄金	3,300	59,565.00	0.40
46	002625	光启技术	1,900	57,608.00	0.39
47	000338	潍柴动力	1,800	49,050.00	0.33
48	600547	山东黄金	2,000	46,180.00	0.31
49	000538	云南白药	800	37,896.00	0.25
50	300014	亿纬锂能	500	32,515.00	0.22
51	601668	中国建筑	7,000	30,380.00	0.20
52	601225	陕西煤业	1,400	28,490.00	0.19
53	600160	巨化股份	500	26,505.00	0.18
54	601985	中国核电	2,700	24,381.00	0.16
55	002001	新 和 成	800	22,736.00	0.15
56	600426	华鲁恒升	900	21,528.00	0.14

57	600111	北方稀土	200	9,610.00	0.06
58	601857	中国石油	100	868.00	0.01

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	688700	东威科技	1,000	89,400.00	0.60
2	600176	中国巨石	1,200	87,456.00	0.59
3	600183	生益科技	500	86,700.00	0.58
4	002414	高德红外	6,400	84,864.00	0.57
5	002803	吉宏股份	3,200	82,688.00	0.55
6	000032	深桑达 A	3,300	82,335.00	0.55
7	300770	新媒股份	2,600	81,874.00	0.55
8	600919	江苏银行	7,500	80,850.00	0.54
9	300628	亿联网络	2,300	77,786.00	0.52
10	688668	鼎通科技	200	74,660.00	0.50
11	002837	英维克	900	71,604.00	0.48
12	002142	宁波银行	2,400	71,256.00	0.48
13	601872	招商轮船	3,900	68,523.00	0.46
14	601877	正泰电器	2,600	65,182.00	0.44
15	002493	荣盛石化	6,000	64,500.00	0.43
16	600711	盛屯矿业	5,700	62,529.00	0.42
17	300627	华测导航	2,200	62,480.00	0.42
18	300394	天孚通信	200	60,536.00	0.41
19	601009	南京银行	6,100	60,329.00	0.40
20	601360	三六零	6,900	59,961.00	0.40
21	603185	弘元绿能	3,500	58,415.00	0.39
22	601138	工业富联	800	57,720.00	0.39
23	601021	春秋航空	1,000	45,580.00	0.31
24	688390	固德威	400	43,404.00	0.29
25	600999	招商证券	2,000	42,200.00	0.28
26	300201	海伦哲	1,900	40,033.00	0.27
27	002736	国信证券	3,400	33,966.00	0.23
28	002648	卫星化学	1,400	32,886.00	0.22
29	301558	三态股份	4,900	30,233.00	0.20
30	600025	华能水电	3,300	29,337.00	0.20
31	300638	广和通	1,500	27,765.00	0.19
32	300353	东土科技	1,200	24,936.00	0.17
33	001389	广合科技	100	23,725.00	0.16
34	000951	中国重汽	1,000	19,510.00	0.13
35	688618	三旺通信	600	18,462.00	0.12
36	600188	兖矿能源	900	15,993.00	0.11
37	600026	中远海能	200	3,588.00	0.02
38	600266	城建发展	200	782.00	0.01

39	601328	交通银行	100	643.00	0.00
40	601018	宁波港	100	315.00	0.00
41	600515	海南机场	100	274.00	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	002463	沪电股份	353,991.00	2.75
2	600150	中国船舶	306,708.00	2.38
3	000063	中兴通讯	274,953.00	2.14
4	300476	胜宏科技	259,983.00	2.02
5	603986	兆易创新	256,037.00	1.99
6	688012	中微公司	253,514.00	1.97
7	600346	恒力石化	252,719.00	1.96
8	002475	立讯精密	238,715.00	1.85
9	688256	寒武纪	236,827.36	1.84
10	300308	中际旭创	225,018.00	1.75
11	600900	长江电力	223,701.00	1.74
12	601398	工商银行	218,033.00	1.69
13	002230	科大讯飞	217,924.00	1.69
14	002415	海康威视	196,114.00	1.52
15	600547	山东黄金	193,998.00	1.51
16	000651	格力电器	185,415.00	1.44
17	600089	特变电工	184,382.00	1.43
18	300059	东方财富	180,892.00	1.40
19	603019	中科曙光	169,421.00	1.32
20	600406	国电南瑞	168,929.00	1.31

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	002475	立讯精密	355,484.00	2.76
2	600519	贵州茅台	288,372.00	2.24
3	002463	沪电股份	267,977.00	2.08
4	600309	万华化学	264,318.00	2.05
5	688008	澜起科技	254,550.00	1.98
6	000063	中兴通讯	249,467.00	1.94
7	600028	中国石化	242,958.00	1.89
8	600346	恒力石化	233,404.00	1.81
9	688012	中微公司	226,410.97	1.76
10	601398	工商银行	225,093.00	1.75
11	300274	阳光电源	222,988.00	1.73
12	002230	科大讯飞	212,125.00	1.65

13	688256	寒武纪	210,668.00	1.64
14	600150	中国船舶	204,468.88	1.59
15	000792	盐湖股份	202,710.00	1.57
16	300476	胜宏科技	199,087.00	1.55
17	601857	中国石油	194,040.00	1.51
18	600111	北方稀土	192,951.00	1.50
19	600989	宝丰能源	181,111.00	1.41
20	601318	中国平安	173,361.00	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	13,944,390.97
卖出股票收入（成交）总额	13,643,096.08

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

无。

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

无。

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

无。

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	1,098.00
2	应收清算款	698,921.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,504.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	738,523.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
嘉实中证 A100 指数 增强发起 式 A	74	144,977.86	10,002,139.10	93.23	726,222.73	6.77
嘉实中证 A100 指数 增强发起 式 C	66	5,666.20	-	-	373,969.16	100.00
合计	133	83,476.17	10,002,139.10	90.09	1,100,191.89	9.91

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 A100 指数增强发起式 A	259,497.54	2.42
	嘉实中证 A100 指数增强发起式 C	1,500.04	0.40
	合计	260,997.58	2.35

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	嘉实中证 A100 指数增强发起式 A	0
	嘉实中证 A100 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 A100 指数增强发起式 A	10~50
	嘉实中证 A100 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	发起份额总数	发起份额占基金总份额	发起份额承诺持有期限
----	--------	----------	--------	------------	------------

		份 额 比 例 (%)		比例(%)	
基金管理人固有资 金	10,002,139.10	90.09	10,002,139.10	90.09	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	10,002,139.10	90.09	10,002,139.10	90.09	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实中证 A100 指数增强发起式 A	嘉实中证 A100 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2024 年 12 月 24 日）基金份额总额	10,004,955.47	143,363.97
本报告期期初基金份额总额	10,346,995.57	455,596.89
本报告期基金总申购份额	464,094.95	387,477.52
减：本报告期基金总赎回份额	82,728.69	469,105.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,728,361.83	373,969.16

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

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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，会计师事务所为容诚会计师事务所（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

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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(%)	
中国银河证券股份有限公司	2	27,587,487.05	100.00	5,129.32	100.00	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国联民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国融证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

国盛证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
首创证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

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) 交易等服务能力较强。

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，本基金退租以下交易单元：东吴证券股份有限公司退租交易单元 1 个。首创证券股份有限公司退租交易单元 2 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 (%)
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公	-	-	-	-	-	-

司						
首创证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
五矿证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
西南证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 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高级管理人员变更公告	上海证券报、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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2026-01-01	10,002,1	-	-	10,002,	90.09

		至 2026-06-30	39.10			139.10	
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项。							

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§ 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 A100 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 A100 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 A100 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证 A100 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 A100 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