

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
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	54
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实沪深 300ETF
场内简称	沪深 300ETF 嘉实
基金主代码	159919
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 7 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,939,216,676.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 28 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	许俊
	联系电话	(010) 65215588	010-66596688
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65215588	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100020	100818
法定代表人		经雷	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	43,358,176,270.93
本期利润	8,812,104,701.85
加权平均基金份额本期利润	0.4361
本期加权平均净值利润率	8.84%
本期基金份额净值增长率	8.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	19,968,404,319.49
期末可供分配基金份额利润	2.8776
期末基金资产净值	36,314,315,244.63
期末基金份额净值	5.2332
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	143.37%

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

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	12.58%	1.25%	11.90%	1.26%	0.68%	-0.01%
过去六个月	8.37%	1.12%	7.55%	1.13%	0.82%	-0.01%
过去一年	29.22%	1.02%	26.51%	1.02%	2.71%	0.00%
过去三年	38.59%	1.11%	29.59%	1.11%	9.00%	0.00%
过去五年	5.67%	1.12%	-4.68%	1.12%	10.35%	0.00%
过去七年	48.79%	1.16%	30.16%	1.17%	18.63%	-0.01%
过去十年	89.58%	1.15%	57.88%	1.15%	31.70%	0.00%
自基金合同生效起至今	143.37%	1.34%	83.35%	1.34%	60.02%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：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3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		
刘珈吟	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实中证主要消费 ETF 发起联接、嘉	2021 年 9 月 24 日	—	17 年	2009 年加入嘉实基金管理有限公司，曾任指数投资部指数研究员。现任指数投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	实中证国 新央企现 代 能 源 ETF、嘉实 中证国新 央企现代 能 源 ETF 联接、嘉 实 中 证 A500ETF、 嘉实中证 A500ETF 联接基金 经理				
何如	本基金基 金经理	2016 年 1 月 5 日	2026 年 1 月 14 日	20 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富 兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任 职于产品管理部、指数投资部，现任指数 基金经理。硕士研究生，具有基金从业资 格。加拿大国籍。

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、《嘉实沪深 300 交易型开放式指数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

本基金跟踪沪深 300 指数，沪深 300 指数由上海和深圳证券交易所中市值大、流动性好的 300 只股票组成，综合反映中国 A 股市场上市股票价格的整体表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2026 年上半年，中国经济延续“稳中向新”态势。生产端工业保持韧性，高技术产业与装备制造业表现亮眼，AI 产业链带动效应持续，新质生产力加快培育。需求端投资结构持续优化，基建托底发力，消费稳步释放，出口发挥稳定锚作用。价格端积极变化增多，物价温和回升，企业盈利预期修复。服务业贡献提升，制造业高端化智能化升级明确。政策协同精准有力，总体运行在合理区间。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.01%，年化跟踪误差为 0.37%，符合基金合同约定的年化跟踪误差不超过 2.00%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 5.2332 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.37%，业绩比较基准收益率为 7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济有望在“结构分化”中走向“盈利修复”。外需与高技术制造保持韧性的同时，下半年财政支出有望加快落地，货币政策维持适度宽松，为内需回暖提供支撑。产业层面，AI 算力、半导体、高端装备等硬科技赛道受益全球产业周期上行和自主可控，业绩可见度持续提升。权益市场或将从“估值扩张”驱动切换至“业绩验证”驱动。风险上仍需关注海外加息预期扰动与贸易摩擦升温对外需和风险偏好的阶段性冲击。

本基金作为一只投资于沪深 300 指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的沪深 300 指数的投资工具。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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	1,289,019,661.15	1,030,754,672.97
结算备付金		373,994,511.75	312,162,463.92
存出保证金		186,797,683.00	137,044,911.00
交易性金融资产	6.4.7.2	35,278,462,337.54	195,887,249,511.90
其中：股票投资		35,278,462,337.54	195,887,249,511.90
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		171,768,200.84	54,945,509.44
应收股利		4,842,600.00	3,960,600.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		37,304,884,994.28	197,426,117,669.23
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		977,271,842.36	259,935,159.78
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		6,891,379.27	24,874,728.50
应付托管费		2,297,126.39	8,291,576.18
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,609,689.88	7,143,774.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,499,711.75	1,885,491.10
负债合计		990,569,749.65	302,130,729.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	16,345,910,925.14	96,152,170,003.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	19,968,404,319.49	100,971,816,935.67
净资产合计		36,314,315,244.63	197,123,986,939.38
负债和净资产总计		37,304,884,994.28	197,426,117,669.23

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 5.2332 元，基金份额总额 6,939,216,676.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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		8,913,000,309.66	3,950,689,304.96
1. 利息收入		3,617,214.17	7,580,897.13
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,617,214.17	2,963,661.43
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		-	4,617,235.70
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		43,392,316,201.02	4,102,126,807.66
其中：股票投资收益	6.4.7.14	42,510,539,574.95	1,902,681,987.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	3,277,331.81
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收	6.4.7.17	-	-

益			
衍生工具收益	6.4.7.18	95,599,999.08	2,218,133.17
股利收益	6.4.7.19	786,176,626.99	2,193,949,354.72
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	-34,546,071,569.08	-73,336,254.34
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	63,138,463.55	-85,682,145.49
减：二、营业总支出		100,895,607.81	170,150,639.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	74,650,004.66	119,103,192.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,883,334.86	39,701,064.19
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		344,574.29	35,511.15
8. 其他费用	6.4.7.23	1,017,694.00	11,310,871.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,812,104,701.85	3,780,538,665.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,812,104,701.85	3,780,538,665.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,812,104,701.85	3,780,538,665.53

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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	96,152,170,003.71	-	100,971,816,935.67	197,123,986,939.38
二、本期期初净资产	96,152,170,003.71	-	100,971,816,935.67	197,123,986,939.38

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-79,806,259.07 8.57	-	-81,003,412.61 6.18	-160,809,671.69 4.75
(一)、综合收益总额	-	-	8,812,104,701.85	8,812,104,701.85
(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)	-79,806,259.07 8.57	-	-89,815,517.31 8.03	-169,621,776.39 6.60
其中：1. 基金申购款	6,627,201,304.08	-	7,355,134,849.54	13,982,336,153.62
2. 基金赎回款	-86,433,460.38 2.65	-	-97,170,652.16 7.57	-183,604,112.55 0.22
(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	16,345,910,925.14	-	19,968,404,319.49	36,314,315,244.63
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	89,285,405,765.99	-	67,103,695,797.82	156,389,101,563.81
二、本期期初净资产	89,285,405,765.99	-	67,103,695,797.82	156,389,101,563.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	7,861,056,434.91	-	5,321,065,295.09	13,182,121,730.00
(一)、综合收益总额	-	-	3,780,538,665.53	3,780,538,665.53
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	7,861,056,434.91	-	3,975,942,549.15	11,836,998,984.06

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	18,141,062,552.84	-	11,430,982,528.77	29,572,045,081.61
2. 基金赎回款	-10,280,006,117.93	-	-7,455,039,979.62	-17,735,046,097.55
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-2,435,415,919.59	-2,435,415,919.59
四、本期期末净资产	97,146,462,200.90	-	72,424,761,092.91	169,571,223,293.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(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[2012]393 号《关于核准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,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《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 19,333,307,392.00 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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》、国务院令第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	1,289,019,661.15
等于：本金	1,288,863,540.11
加：应计利息	156,121.04
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	1,289,019,661.15

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		28,106,510,488.45	-	35,278,462,337.54	7,171,951,849.09
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		28,106,510,488.45	-	35,278,462,337.54	7,171,951,849.09

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	966,301,200.00	-	-	-
其中：股指期货	966,301,200.00	-	-	-

投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	966,301,200.00	-	-	-

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
IF2607	IF2607	660.00	974,556,000.00	8,254,800.00
合计				8,254,800.00
减：可抵销期货暂收款				8,254,800.00
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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,264,600.37
其中：交易所市场	2,264,600.37
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,227.67
其他	141,883.71
合计	2,499,711.75

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,818,816,676.00	96,152,170,003.71
本期申购	2,813,400,000.00	6,627,201,304.08
本期赎回（以“-”号填列）	-36,693,000,000.00	-86,433,460,382.65
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	6,939,216,676.00	16,345,910,925.14

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	161,335,460,621.38	-60,363,643,685.71	100,971,816,935.67
本期期初	161,335,460,621.38	-60,363,643,685.71	100,971,816,935.67
本期利润	43,358,176,270.93	-34,546,071,569.08	8,812,104,701.85
本期基金份额交易产生的变动数	-161,073,864,091.07	71,258,346,773.04	-89,815,517,318.03
其中：基金申购款	14,340,102,684.65	-6,984,967,835.11	7,355,134,849.54
基金赎回款	-175,413,966,775.72	78,243,314,608.15	-97,170,652,167.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,619,772,801.24	-23,651,368,481.75	19,968,404,319.49

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	1,996,560.38
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	1,543,535.06
其他	77,118.73
合计	3,617,214.17

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	22,429,586,736.19
股票投资收益——赎回差价收入	20,080,952,838.76
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	42,510,539,574.95

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	124,628,572,611.86
减：卖出股票成本总额	102,121,870,798.32
减：交易费用	77,115,077.35
买卖股票差价收入	22,429,586,736.19

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	183,604,112,550.22
减：现金支付赎回款总额	110,737,981,882.22
减：赎回股票成本总额	52,785,177,829.24
减：交易费用	-
赎回差价收入	20,080,952,838.76

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 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

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	95,599,999.08

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	786,176,626.99
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	786,176,626.99

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	-34,537,553,009.08
股票投资	-34,537,553,009.08
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	-8, 518, 560. 00
权证投资	-
期货投资	-8, 518, 560. 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	-34, 546, 071, 569. 08

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	-
替代损益	63, 138, 463. 55
合计	63, 138, 463. 55

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	33, 720. 30
信息披露费	59, 507. 37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	61, 071. 02
其他	863, 395. 31
合计	1, 017, 694. 00

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 (LOF)（“嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)”）	本基金的联接基金

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	74,650,004.66	119,103,192.60
其中：应支付销售机构的客户维护 费	934,312.90	925,172.08
应支付基金管理人的净管理费	73,715,691.76	118,178,020.52

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 0.15%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×0.15%/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	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
当期发生的基金应支付的托管费	24,883,334.86	39,701,064.19

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/当年天数。

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

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)	1,410,428,920.00	20.33	1,533,528,920.00	3.76

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	1,289,019,661.15	1,996,560.38	2,251,859,686.65	1,890,967.25

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

报告期末(2026 年 06 月 30 日)，本基金持有 17,859,429 股中国银行的 A 股普通股，估值总额为人民币 102,155,933.88 元，占基金资产净值的比例为 0.28%(2025 年 12 月 31 日：110,971,129 股，估值总额为人民币 635,864,569.17 元，占基金资产净值的比例为 0.32%)。

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	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新发未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛龙	2026 年 3	6 个月	新股	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

	股份	月 24 日		锁定						
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信	2026 年 1	6 个月	新股	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-

	股份	月 8 日		锁定						
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股锁定	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	676.94	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯	2026 年 4	6 个月	新股	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-

	仪器	月 16 日		锁定						
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	264,974	176,480,326.93	220,458,368.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

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时间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	1,289,019,661.15	-	-	-	1,289,019,661.15
结算备付金	373,994,511.75	-	-	-	373,994,511.75
存出保证金	69,850,963.00	-	-	116,946,720.00	186,797,683.00
交易性金融资产	-	-	-	35,278,462,337.54	35,278,462,337.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	171,768,200.84	171,768,200.84
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	4,842,600.00	4,842,600.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,732,865,135.90	-	-	35,572,019,858.38	37,304,884,994.28
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	-	-	-	977,271,842.36	977,271,842.36
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	6,891,379.27	6,891,379.27
应付托管费	-	-	-	2,297,126.39	2,297,126.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,609,689.88	1,609,689.88
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,499,711.75	2,499,711.75
负债总计	-	-	-	990,569,749.65	990,569,749.65
利率敏感度缺口	1,732,865,135.90	-	-	34,581,450,108.73	36,314,315,244.63
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	1,030,754,672.97	-	-	-	1,030,754,672.97
结算备付金	312,162,463.92	-	-	-	312,162,463.92
存出保证金	1,453,647.00	-	-	135,591,264.00	137,044,911.00
交易性金融资产	-	-	-	195,887,249,511.90	195,887,249,511.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	54,945,509.44	54,945,509.44
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	3,960,600.00	3,960,600.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,344,370,783.89	-	-	196,081,746,885.34	197,426,117,669.23
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	-	-	-	259,935,159.78	259,935,159.78
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	24,874,728.50	24,874,728.50
应付托管费	-	-	-	8,291,576.18	8,291,576.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,143,774.29	7,143,774.29
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,885,491.10	1,885,491.10
负债总计	-	-	-	302,130,729.85	302,130,729.85
利率敏感度缺口	1,344,370,783.	-	-	-195,779,616,15	197,123,986,939.38

	89		5.49	
--	----	--	------	--

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	35,278,462,337.54	97.15	195,887,249,511.90	99.37
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	35,278,462,337.54	97.15	195,887,249,511.90	99.37

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%	1,805,768,260.95	9,861,736,105.22
	业绩比较基准下降 5%	-1,805,768,260.95	-9,861,736,105.22

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	35,047,316,461.36	194,541,962,530.51
第二层次	221,308,659.44	1,340,038,663.13
第三层次	9,837,216.74	5,248,318.26
合计	35,278,462,337.54	195,887,249,511.90

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	35,278,462,337.54	94.57
	其中：股票	35,278,462,337.54	94.57
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	1,663,014,172.90	4.46
8	其他各项资产	363,408,483.84	0.97
9	合计	37,304,884,994.28	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	201,028,611.97	0.55
B	采矿业	1,476,641,834.81	4.07
C	制造业	22,605,124,006.52	62.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	876,244,725.03	2.41
E	建筑业	402,516,946.25	1.11
F	批发和零售业	52,129,796.64	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	854,976,344.88	2.35
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,890,679,982.46	5.21
J	金融业	6,180,752,355.88	17.02
K	房地产业	114,011,227.65	0.31
L	租赁和商务服务业	161,276,765.53	0.44
M	科学研究和技术服务业	384,093,428.40	1.06
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	47,966,043.02	0.13
R	文化、体育和娱乐业	20,248,122.00	0.06
S	综合	—	—
	合计	35,267,690,191.04	97.12

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	36,149.82	0.00
C	制造业	9,799,483.46	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.00
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	10,687,508.18	0.03

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	1,391,333	1,766,992,910.00	4.87
2	300750	宁德时代	3,295,405	1,295,127,119.05	3.57
3	300502	新易盛	1,737,233	1,054,500,431.00	2.90
4	600519	贵州茅台	779,538	924,134,503.62	2.54
5	603986	兆易创新	832,555	678,532,325.00	1.87
6	601318	中国平安	13,299,844	634,934,552.56	1.75
7	688256	寒武纪	388,971	620,622,679.05	1.71
8	600036	招商银行	15,442,989	548,226,109.50	1.51
9	601899	紫金矿业	20,558,195	516,833,022.30	1.42
10	002371	北方华创	541,513	479,000,739.28	1.32
11	000333	美的集团	6,060,718	457,766,030.54	1.26
12	002475	立讯精密	6,347,384	446,855,833.60	1.23
13	688008	澜起科技	1,430,687	443,369,901.30	1.22
14	688012	中微公司	939,316	440,069,546.00	1.21
15	688041	海光信息	1,162,384	430,430,795.20	1.19
16	002384	东山精密	1,598,718	419,423,667.30	1.15
17	600900	长江电力	15,260,178	403,936,911.66	1.11
18	688981	中芯国际	2,541,585	403,654,529.70	1.11
19	000725	京东方 A	45,272,491	392,965,221.88	1.08
20	603259	药明康德	3,084,840	384,093,428.40	1.06
21	601138	工业富联	4,953,245	357,376,626.75	0.98
22	600030	中信证券	12,174,811	349,782,320.03	0.96
23	601166	兴业银行	21,119,624	349,740,973.44	0.96
24	300059	东方财富	15,786,042	321,719,535.96	0.89
25	600183	生益科技	1,815,906	314,878,100.40	0.87
26	600276	恒瑞医药	5,568,086	289,763,195.44	0.80
27	300274	阳光电源	1,805,747	287,149,887.94	0.79
28	601398	工商银行	40,361,950	285,358,986.50	0.79
29	300408	三环集团	1,672,086	279,071,153.40	0.77
30	002594	比亚迪	3,384,053	269,709,024.10	0.74
31	300476	胜宏科技	760,832	263,575,029.76	0.73
32	601211	国泰海通	14,101,613	256,649,356.60	0.71
33	002463	沪电股份	1,678,221	256,432,168.80	0.71
34	300394	天孚通信	814,731	246,602,779.08	0.68
35	000988	华工科技	1,229,779	227,029,501.19	0.63
36	301308	江波龙	319,038	224,538,944.40	0.62
37	688072	拓荆科技	264,974	220,458,368.00	0.61
38	600176	中国巨石	2,996,400	218,377,632.00	0.60
39	601288	农业银行	35,855,397	217,642,259.79	0.60
40	601328	交通银行	33,276,246	213,966,261.78	0.59
41	000651	格力电器	5,579,891	209,245,912.50	0.58
42	600522	中天科技	3,408,625	206,835,365.00	0.57
43	688521	芯原股份	532,144	197,499,924.16	0.54

44	600919	江苏银行	18,312,310	197,406,701.80	0.54
45	603019	中科曙光	1,822,820	195,460,988.60	0.54
46	603993	洛阳钼业	10,893,858	191,187,207.90	0.53
47	600150	中国船舶	5,635,634	190,428,072.86	0.52
48	600887	伊利股份	7,893,474	189,127,637.04	0.52
49	600584	长电科技	1,783,821	184,714,664.55	0.51
50	000338	潍柴动力	6,700,158	182,579,305.50	0.50
51	000858	五 粮 液	2,418,728	178,985,872.00	0.49
52	601816	京沪高铁	36,621,784	165,896,681.52	0.46
53	600309	万华化学	2,342,490	160,249,740.90	0.44
54	300124	汇川技术	2,362,147	156,681,210.51	0.43
55	002415	海康威视	4,569,769	156,286,099.80	0.43
56	002916	深南电路	337,411	154,500,496.90	0.43
57	600111	北方稀土	3,155,781	151,635,277.05	0.42
58	601688	华泰证券	7,294,673	150,416,157.26	0.41
59	000100	TCL 科技	25,573,263	148,836,390.66	0.41
60	000063	中兴通讯	4,007,907	145,046,154.33	0.40
61	600000	浦发银行	16,618,711	143,087,101.71	0.39
62	600089	特变电工	6,301,152	141,775,920.00	0.39
63	601857	中国石油	16,162,306	140,288,816.08	0.39
64	002028	思源电气	776,623	134,355,779.00	0.37
65	601088	中国神华	3,428,983	133,867,496.32	0.37
66	300433	蓝思科技	2,480,659	133,112,161.94	0.37
67	600031	三一重工	7,400,970	127,888,761.60	0.35
68	300014	亿纬锂能	1,900,450	123,586,263.50	0.34
69	002050	三花智控	2,794,109	122,465,797.47	0.34
70	002142	宁波银行	4,117,481	122,248,010.89	0.34
71	601601	中国太保	4,271,233	121,815,565.16	0.34
72	000001	平安银行	12,077,070	121,374,553.50	0.33
73	000792	盐湖股份	3,958,777	119,515,477.63	0.33
74	002714	牧原股份	3,407,559	119,230,489.41	0.33
75	600549	厦门钨业	1,387,139	118,184,242.80	0.33
76	002353	杰瑞股份	766,000	116,815,000.00	0.32
77	600406	国电南瑞	4,927,624	112,596,208.40	0.31
78	601668	中国建筑	25,771,532	111,848,448.88	0.31
79	000657	中钨高新	1,138,520	108,979,134.40	0.30
80	601229	上海银行	12,410,559	107,723,652.12	0.30
81	601919	中远海控	7,829,538	103,819,673.88	0.29
82	002602	世纪华通	7,353,900	103,689,990.00	0.29
83	300760	迈瑞医疗	755,626	102,636,679.58	0.28
84	601988	中国银行	17,859,429	102,155,933.88	0.28
85	601939	建设银行	10,569,859	101,787,742.17	0.28
86	600660	福耀玻璃	2,000,731	100,916,871.64	0.28

87	601728	中国电信	19,369,500	100,527,705.00	0.28
88	603501	豪威集团	1,054,923	100,059,446.55	0.28
89	600016	民生银行	30,965,678	99,709,483.16	0.27
90	601012	隆基绿能	7,562,489	99,219,855.68	0.27
91	601225	陕西煤业	4,835,363	98,399,637.05	0.27
92	002230	科大讯飞	2,394,976	97,810,819.84	0.27
93	600999	招商证券	4,628,585	97,663,143.50	0.27
94	600941	中国移动	1,128,910	97,233,018.30	0.27
95	600690	海尔智家	4,679,125	95,500,941.25	0.26
96	002352	顺丰控股	2,987,780	93,398,002.80	0.26
97	601985	中国核电	10,265,100	92,693,853.00	0.26
98	002460	赣锋锂业	1,409,710	92,195,034.00	0.25
99	603799	华友钴业	1,895,596	91,481,462.96	0.25
100	600926	杭州银行	6,327,726	91,435,640.70	0.25
101	002709	天赐材料	1,775,766	91,327,645.38	0.25
102	002938	鹏鼎控股	865,196	91,174,354.48	0.25
103	300033	同花顺	377,802	91,050,282.00	0.25
104	601169	北京银行	18,470,791	90,506,875.90	0.25
105	000977	浪潮信息	1,282,964	89,807,480.00	0.25
106	600160	巨化股份	1,682,615	89,195,421.15	0.25
107	000776	广发证券	3,662,132	85,693,888.80	0.24
108	300442	润泽科技	1,021,493	84,855,423.51	0.23
109	000425	徐工机械	10,216,668	82,652,844.12	0.23
110	688126	沪硅产业	2,062,914	82,289,639.46	0.23
111	300498	温氏股份	6,639,458	81,798,122.56	0.23
112	601600	中国铝业	9,887,465	81,274,962.30	0.22
113	600028	中国石化	18,176,559	81,067,453.14	0.22
114	600938	中国海油	2,984,176	81,020,378.40	0.22
115	000938	紫光股份	2,805,559	80,968,432.74	0.22
116	002202	金风科技	3,379,100	80,760,490.00	0.22
117	600460	士兰微	1,453,488	79,447,654.08	0.22
118	002466	天齐锂业	1,290,856	79,155,289.92	0.22
119	601766	中国中车	15,173,166	78,900,463.20	0.22
120	002600	领益智造	4,505,906	78,132,410.04	0.22
121	600050	中国联通	19,501,122	78,004,488.00	0.21
122	300661	圣邦股份	543,378	77,963,875.44	0.21
123	688082	盛美上海	179,263	77,441,616.00	0.21
124	601009	南京银行	7,710,281	76,254,679.09	0.21
125	002837	英维克	952,174	75,754,963.44	0.21
126	002049	紫光国微	835,241	74,127,638.75	0.20
127	601628	中国人寿	2,079,387	73,506,330.45	0.20
128	002179	中航光电	1,584,139	73,187,221.80	0.20
129	601100	恒立液压	669,633	72,025,725.48	0.20

130	000568	泸州老窖	916,605	71,055,219.60	0.20
131	601872	招商轮船	4,027,164	70,757,271.48	0.19
132	002241	歌尔股份	3,098,900	69,818,217.00	0.19
133	603288	海天味业	2,082,240	69,047,078.40	0.19
134	601006	大秦铁路	14,868,255	68,542,655.55	0.19
135	601658	邮储银行	13,753,400	67,804,262.00	0.19
136	000408	藏格矿业	975,582	67,627,344.24	0.19
137	605117	德业股份	636,130	67,544,283.40	0.19
138	601818	光大银行	23,157,609	66,925,490.01	0.18
139	600809	山西汾酒	609,778	66,691,419.86	0.18
140	600905	三峡能源	17,832,738	66,159,457.98	0.18
141	601888	中国中免	1,219,891	65,520,345.61	0.18
142	600489	中金黄金	3,629,032	65,504,027.60	0.18
143	688396	华润微	669,028	65,263,681.40	0.18
144	002625	光启技术	2,114,397	64,108,517.04	0.18
145	000630	铜陵有色	10,017,859	63,713,583.24	0.18
146	600893	航发动力	1,661,518	63,702,600.12	0.18
147	688271	联影医疗	623,476	63,114,475.48	0.17
148	600010	包钢股份	28,211,875	62,912,481.25	0.17
149	601127	赛力斯	1,016,891	62,284,573.75	0.17
150	601336	新华保险	1,038,482	61,955,836.12	0.17
151	600958	东方证券	6,524,457	61,590,874.08	0.17
152	688111	金山办公	286,870	61,117,653.50	0.17
153	601689	拓普集团	1,081,594	61,023,533.48	0.17
154	002027	分众传媒	12,599,438	60,981,279.92	0.17
155	600118	中国卫星	737,573	60,517,864.65	0.17
156	600019	宝钢股份	10,872,021	59,035,074.03	0.16
157	600760	中航沈飞	1,415,302	58,168,912.20	0.16
158	000807	云铝股份	2,592,279	57,393,057.06	0.16
159	601838	成都银行	3,171,269	56,131,461.30	0.15
160	600362	江西铜业	1,295,914	56,113,076.20	0.15
161	688183	生益电子	423,179	56,028,899.60	0.15
162	600104	上汽集团	5,738,057	56,003,436.32	0.15
163	600989	宝丰能源	2,746,400	55,834,312.00	0.15
164	601727	上海电气	7,859,900	55,019,300.00	0.15
165	600875	东方电气	1,905,200	54,812,604.00	0.15
166	300450	先导智能	1,344,280	54,739,081.60	0.15
167	002001	新 和 成	1,916,605	54,469,914.10	0.15
168	601825	沪农商行	7,220,900	54,084,541.00	0.15
169	601390	中国中铁	12,773,562	53,265,753.54	0.15
170	002422	科伦药业	1,377,965	53,079,211.80	0.15
171	601995	中金公司	1,459,100	52,746,465.00	0.15
172	603296	华勤技术	709,835	52,719,445.45	0.15

173	000538	云南白药	1,108,728	52,520,445.36	0.14
174	601377	兴业证券	8,621,546	52,074,137.84	0.14
175	600547	山东黄金	2,254,499	52,056,381.91	0.14
176	600795	国电电力	11,125,875	51,957,836.25	0.14
177	600015	华夏银行	7,943,789	50,760,811.71	0.14
178	600585	海螺水泥	2,993,840	50,745,588.00	0.14
179	601669	中国电建	10,743,077	50,492,461.90	0.14
180	601916	浙商银行	18,813,100	49,478,453.00	0.14
181	000166	申万宏源	11,228,926	49,407,274.40	0.14
182	002648	卫星化学	2,101,972	49,375,322.28	0.14
183	300316	晶盛机电	815,626	49,263,810.40	0.14
184	603893	瑞芯微	260,680	49,101,684.80	0.14
185	300015	爱尔眼科	5,807,027	47,966,043.02	0.13
186	601698	中国卫通	1,580,393	47,806,888.25	0.13
187	601066	中信建投	1,619,866	47,089,504.62	0.13
188	600346	恒力石化	2,637,034	46,701,872.14	0.13
189	601868	中国能建	17,452,400	46,597,908.00	0.13
190	600482	中国动力	1,415,356	46,423,676.80	0.13
191	601998	中信银行	6,611,713	45,819,171.09	0.13
192	002558	巨人网络	1,658,200	45,699,992.00	0.13
193	002311	海大集团	1,024,122	45,686,082.42	0.13
194	300418	昆仑万维	1,118,716	45,151,377.76	0.12
195	600066	宇通客车	1,656,000	44,397,360.00	0.12
196	000625	长安汽车	6,181,653	44,322,452.01	0.12
197	600426	华鲁恒升	1,844,639	44,123,764.88	0.12
198	600221	海航控股	32,071,600	43,296,660.00	0.12
199	002532	天山铝业	4,034,500	43,290,185.00	0.12
200	000157	中联重科	6,187,196	43,124,756.12	0.12
201	688036	传音控股	723,889	42,673,256.55	0.12
202	300803	指南针	458,259	42,008,602.53	0.12
203	600011	华能国际	5,486,100	41,639,499.00	0.11
204	600436	片仔癀	379,084	41,426,299.52	0.11
205	600438	通威股份	3,378,940	40,918,963.40	0.11
206	600048	保利发展	8,816,255	40,819,260.65	0.11
207	600115	中国东航	10,618,500	40,456,485.00	0.11
208	601077	渝农商行	6,620,400	40,450,644.00	0.11
209	002236	大华股份	2,443,606	40,295,062.94	0.11
210	002493	荣盛石化	3,738,116	40,184,747.00	0.11
211	600570	恒生电子	1,892,521	40,102,519.99	0.11
212	600886	国投电力	2,995,722	39,873,059.82	0.11
213	600188	兖矿能源	2,231,125	39,647,091.25	0.11
214	688047	龙芯中科	248,256	38,397,755.52	0.11
215	003816	中国广核	9,789,086	38,275,326.26	0.11

216	002736	国信证券	3,820,218	38,163,977.82	0.11
217	605499	东鹏饮料	307,616	37,969,042.88	0.10
218	601360	三六零	4,366,890	37,948,274.10	0.10
219	601058	赛轮轮胎	3,279,500	37,812,635.00	0.10
220	000301	东方盛虹	3,295,819	37,737,127.55	0.10
221	600026	中远海能	2,081,700	37,345,698.00	0.10
222	002074	国轩高科	1,351,941	37,191,896.91	0.10
223	601901	方正证券	5,135,619	36,976,456.80	0.10
224	600009	上海机场	1,564,594	36,142,121.40	0.10
225	600196	复星医药	1,585,141	35,618,118.27	0.10
226	000768	中航西飞	1,730,226	35,435,028.48	0.10
227	000975	山金国际	2,076,141	35,294,397.00	0.10
228	601111	中国国航	5,816,047	35,187,084.35	0.10
229	601788	光大证券	2,435,458	35,143,658.94	0.10
230	600029	南方航空	6,725,187	34,836,468.66	0.10
231	600415	小商品城	3,422,750	34,775,140.00	0.10
232	601456	国联民生	3,919,352	34,647,071.68	0.10
233	600674	川投能源	2,431,124	34,449,027.08	0.09
234	600219	南山铝业	8,592,900	34,285,671.00	0.09
235	601186	中国铁建	5,742,044	34,165,161.80	0.09
236	601881	中国银河	2,713,000	34,102,410.00	0.09
237	600233	圆通速递	2,135,900	33,640,425.00	0.09
238	601877	正泰电器	1,341,544	33,632,508.08	0.09
239	601117	中国化学	4,570,400	33,592,440.00	0.09
240	301236	软通动力	774,456	32,875,657.20	0.09
241	600372	中航机载	3,018,173	32,747,177.05	0.09
242	601878	浙商证券	3,425,889	32,545,945.50	0.09
243	301269	华大九天	270,218	32,269,433.56	0.09
244	000963	华东医药	1,091,172	30,683,756.64	0.08
245	600741	华域汽车	1,968,580	30,552,361.60	0.08
246	002920	德赛西威	374,797	30,545,955.50	0.08
247	688506	百利天恒	102,243	30,062,509.29	0.08
248	000895	双汇发展	1,295,905	29,028,272.00	0.08
249	001979	招商蛇口	4,492,876	28,889,192.68	0.08
250	002304	洋河股份	739,375	28,207,156.25	0.08
251	601021	春秋航空	611,244	27,860,501.52	0.08
252	601898	中煤能源	2,283,177	27,809,095.86	0.08
253	300866	安克创新	265,685	27,764,082.50	0.08
254	601319	中国人保	3,989,300	26,967,668.00	0.07
255	600023	浙能电力	5,019,900	26,404,674.00	0.07
256	600039	四川路桥	3,258,020	25,477,716.40	0.07
257	601800	中国交建	4,437,623	25,338,827.33	0.07
258	000002	万科 A	8,378,842	24,801,372.32	0.07

259	688223	晶科能源	5,125,367	24,345,493.25	0.07
260	601633	长城汽车	1,556,323	23,484,914.07	0.06
261	600588	用友网络	2,555,401	23,458,581.18	0.06
262	001965	招商公路	2,537,292	23,241,594.72	0.06
263	600600	青岛啤酒	444,565	23,219,629.95	0.06
264	603369	今世缘	931,874	22,094,732.54	0.06
265	600027	华电国际	4,939,700	21,981,665.00	0.06
266	601618	中国中冶	8,909,110	21,738,228.40	0.06
267	302132	中航成飞	369,158	21,529,294.56	0.06
268	603260	合盛硅业	444,668	21,459,677.68	0.06
269	601607	上海医药	1,392,600	21,446,040.00	0.06
270	300628	亿联网络	632,128	21,378,568.96	0.06
271	600061	国投资本	3,214,830	21,057,136.50	0.06
272	600918	中泰证券	3,949,780	21,012,829.60	0.06
273	000617	中油资本	3,148,451	20,748,292.09	0.06
274	600025	华能水电	2,323,765	20,658,270.85	0.06
275	300832	新产业	491,148	20,628,216.00	0.06
276	300251	光线传媒	1,825,800	20,248,122.00	0.06
277	600085	同仁堂	861,124	19,900,575.64	0.05
278	600930	华电新能	4,165,569	19,869,764.13	0.05
279	601059	信达证券	1,215,800	19,683,802.00	0.05
280	688472	阿特斯	1,815,552	19,644,272.64	0.05
281	600515	海南机场	7,117,300	19,501,402.00	0.05
282	000999	华润三九	828,378	18,630,221.22	0.05
283	600803	新奥股份	1,161,100	18,345,380.00	0.05
284	600018	上港集团	3,775,250	17,819,180.00	0.05
285	600845	宝信软件	1,068,954	17,776,705.02	0.05
286	300122	智飞生物	1,492,556	17,447,979.64	0.05
287	300999	金龙鱼	743,428	17,292,135.28	0.05
288	300896	爱美客	187,391	16,340,495.20	0.04
289	000596	古井贡酒	202,458	16,156,148.40	0.04
290	000708	中信特钢	1,258,243	15,879,026.66	0.04
291	688009	中国通号	3,224,723	15,349,681.48	0.04
292	601018	宁波港	4,863,200	15,319,080.00	0.04
293	688303	大全能源	808,048	14,084,276.64	0.04
294	601238	广汽集团	2,765,065	14,046,530.20	0.04
295	001280	中国铀业	204,900	13,666,830.00	0.04
296	300413	芒果超媒	931,828	13,632,643.64	0.04
297	301165	锐捷网络	165,520	13,316,084.00	0.04
298	603392	万泰生物	475,199	12,816,117.03	0.04
299	601136	首创证券	682,400	9,519,480.00	0.03
300	001391	国货航	1,822,300	7,416,761.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688795	摩尔线程	10,828	7,329,906.32	0.02
2	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.00
3	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.00
4	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
5	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
6	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
7	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
8	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
9	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
10	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
11	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
12	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
13	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
14	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
15	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
16	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
17	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
18	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
19	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
20	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
21	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
22	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
23	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
24	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
25	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
26	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
27	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
28	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
29	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	688012	中微公司	1,946,749,506.02	0.99
2	688271	联影医疗	623,472,987.28	0.32
3	688041	海光信息	575,306,092.04	0.29
4	002371	北方华创	571,979,579.65	0.29
5	300750	宁德时代	561,160,065.99	0.28
6	688521	芯原股份	496,214,731.34	0.25

7	301308	江波龙	462,918,082.36	0.23
8	300502	新易盛	432,515,007.20	0.22
9	600519	贵州茅台	402,109,002.48	0.20
10	000988	华工科技	377,881,233.61	0.19
11	300308	中际旭创	342,376,184.95	0.17
12	601318	中国平安	338,237,210.31	0.17
13	688396	华润微	308,675,640.67	0.16
14	688072	拓荆科技	299,567,785.53	0.15
15	601899	紫金矿业	273,479,298.96	0.14
16	688036	传音控股	269,247,517.52	0.14
17	600436	片仔癀	264,989,828.88	0.13
18	600036	招商银行	264,960,885.83	0.13
19	300274	阳光电源	257,868,155.04	0.13
20	688183	生益电子	229,848,657.46	0.12

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	600519	贵州茅台	5,853,165,497.38	2.97
2	601318	中国平安	4,587,957,561.10	2.33
3	601899	紫金矿业	4,129,765,743.48	2.10
4	600036	招商银行	3,333,701,553.34	1.69
5	688012	中微公司	3,074,297,806.54	1.56
6	688041	海光信息	2,321,616,206.75	1.18
7	600900	长江电力	2,295,955,847.60	1.16
8	601166	兴业银行	2,231,558,075.48	1.13
9	688256	寒武纪	2,178,570,260.65	1.11
10	600030	中信证券	1,921,266,255.54	0.97
11	601138	工业富联	1,845,523,269.53	0.94
12	600276	恒瑞医药	1,827,530,788.75	0.93
13	688981	中芯国际	1,781,954,040.91	0.90
14	603986	兆易创新	1,773,639,471.77	0.90
15	603259	药明康德	1,764,531,190.43	0.90
16	601398	工商银行	1,686,591,809.92	0.86
17	688008	澜起科技	1,587,742,225.97	0.81
18	601211	国泰海通	1,517,953,123.35	0.77
19	601288	农业银行	1,395,570,994.90	0.71
20	603993	洛阳钼业	1,363,426,424.56	0.69

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	23,338,762,717.18
卖出股票收入（成交）总额	124,628,572,611.86

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

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金投资股指期货将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。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

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	186,797,683.00
2	应收清算款	171,768,200.84
3	应收股利	4,842,600.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	363,408,483.84

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	7,329,906.32	0.02	新股锁定
2	001248	华润新能源	595,206.03	0.00	新股锁定
2	001248	华润新能源	255,085.41	0.00	新发未上市
3	301666	大普微	565,262.60	0.00	新股锁定
4	688820	盛合晶微	338,302.59	0.00	新股锁定
5	688790	昂瑞微	293,237.55	0.00	新股锁定

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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
68,391	101,463.89	6,153,990,898.00	88.68	785,225,778.00	11.32

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	1,410,428,920.00	20.33

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,400.00	0.00

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2012 年 5 月 7 日) 基金份额总额	19,333,307,392.00
本报告期期初基金份额总额	40,818,816,676.00
本报告期基金总申购份额	2,813,400,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	36,693,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,939,216,676.00

§ 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，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
招商证券股份有限公司	2	30,618,629,589.24	20.69	1,099,340.77	20.69	—
方正证券股份有限公司	2	23,161,039,673.82	15.65	831,570.68	15.65	—
光大证券股份有限公司	2	19,702,175,082.33	13.32	707,369.95	13.32	—
平安证券股份有限公司	4	18,678,248,301.57	12.62	670,584.22	12.62	—
国信证券股份有限公司	1	17,633,477,057.37	11.92	633,098.98	11.92	—
中信证券股份有限公司	8	14,987,815,409.56	10.13	538,086.60	10.13	—
中信建投证券股份有限公司	4	10,377,968,688.98	7.01	372,711.11	7.02	—
广发证券股份有限公司	6	6,922,112,883.34	4.68	248,521.12	4.68	—
中国银河证券股份有限公司	3	3,868,137,696.40	2.61	138,860.25	2.61	—
国泰海通证券股份有限公司	7	2,014,027,664.92	1.36	72,321.18	1.36	—

渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国新证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-

有限责任 公司						
华林证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华龙证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	6	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
联储证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
摩根大通 证券(中 国)有限公 司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
山西证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	3	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
天府证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
万联证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限	2	-	-	-	-	-

公司						
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	2	-	-	-	-	-
粤开证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	5	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

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，本基金退租以下交易单元：渤海证券股份有限公司退租交易单元 1 个。国泰海通证券股份有限公司退租交易单元 1 个。国新证券股份有限公司退租交易单元 2 个。信达证券股份有限公司退租交易单元 2 个。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：摩根大通证券(中国)有限公司新增交易单元 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 (%)
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
财通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长城证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
诚通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-

东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
国海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国新证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华创证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华林证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华龙证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

华泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华西证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
联储证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券 (中国) 有限公 司	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
山西证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
天府证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
万联证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

西部证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
西南证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
湘财证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
信达证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
粤开证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
浙商证 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	-	-	-	-	-	-
中航证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
中山证 券有限	-	-	-	-	-	-

责任公司						
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

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	关于嘉实沪深 300ETF 基金经理变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 14 日
2	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金新增山西证券股份有限公司为流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 21 日
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 23 日
4	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 26 日
5	关于嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	证券时报、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 16 日
6	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、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 29 日
7	嘉实基金管理有限公司关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、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 24 日
8	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、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
9	嘉实基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	证券时报、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 29 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 (%)
联接基金	1	2026-06-29 至 2026-06-30	1,533,528,920.00	27,000,000.00	150,100,000.00	1,410,428,920.00	20.33
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；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

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) 中国证监会批准嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实沪深 300 交易型开放式指数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