

嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数 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：广发证券股份有限公司

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。

基金托管人广发证券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	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 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	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	48
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
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	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实上证综合增强策略 ETF
场内简称	上证增强（扩位证券简称：上证指数增强 ETF 嘉实）
基金主代码	562810
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 3 月 5 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	47,951,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易场所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 3 月 13 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数，实现基金资产的长期增值。本基金力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以上证综合指数为本基金的标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 具体投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	上证综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭松	罗琦
	联系电话	(010)65215588	020-66338888
	电子邮箱	service@jsfund.cn	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95575
传真		(010)65215588	020-87553363-6847
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆	广东省广州市黄埔区中新广州

	家嘴环路 1318 号 1806A 单元	知识城腾飞一街 2 号 618 室
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	广州市天河区马场路 26 号广发 证券大厦 34 楼
邮政编码	100020	510627
法定代表人	经雷	林传辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	2,607,000.53
本期利润	3,088,838.50
加权平均基金份额本期利润	0.0801
本期加权平均净值利润率	6.87%
本期基金份额净值增长率	4.73%
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	9,829,334.23
期末可供分配基金份额利润	0.2050
期末基金资产净值	57,780,334.23
期末基金份额净值	1.2050
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	21.98%

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

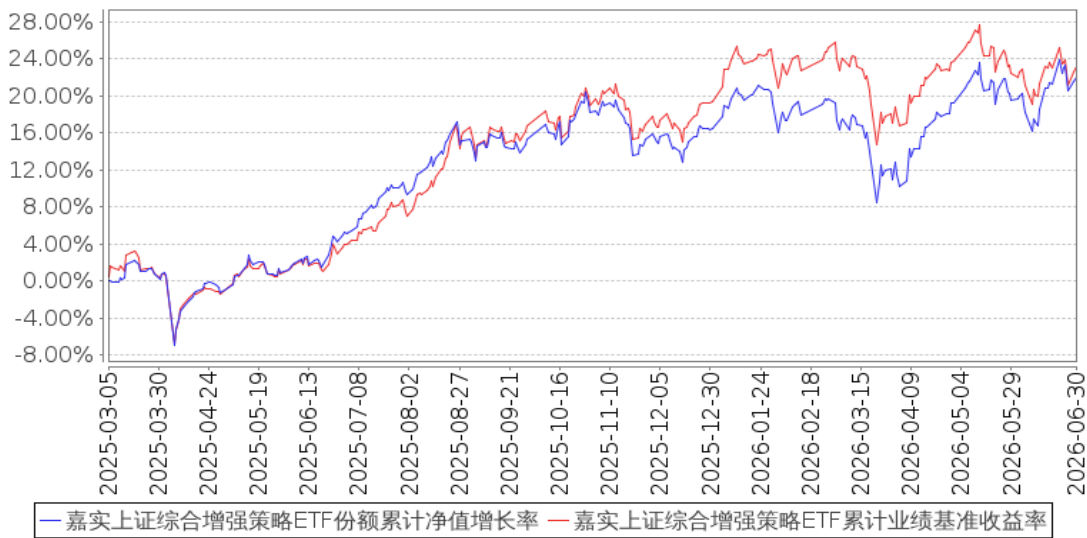
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.88%	1.00%	5.20%	0.94%	4.68%	0.06%
过去六个月	4.73%	1.01%	3.16%	0.95%	1.57%	0.06%
过去一年	16.26%	0.85%	18.87%	0.83%	-2.61%	0.02%
自基金合同生效起至今	21.98%	0.89%	23.17%	0.88%	-1.19%	0.01%

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

嘉实上证综合增强策略ETF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

(2025年03月05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		
尚可	本基金、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实创业板增强策略 ETF、嘉实中证 A50ETF、嘉实中证 A50ETF 联接、嘉实上证科创板综合 ETF、嘉实国证自由现金流 ETF、嘉实中证诚通国企数字经济 ETF、嘉实上证科创板综合 ETF 联接、嘉实上证科创	2025 年 3 月 5 日	-	6 年	2020 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部任研究员。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	板综合增强策略ETF、嘉实上证自由现金流ETF联接、嘉实上证科创板人工智能ETF发起联接、嘉实上证科创板200ETF基金经理				
张楠	本基金基金经理	2025年3月5日	-	14年	2012年1月加入嘉实基金管理有限公司从事投资模型研究和投资组合管理工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实上证综合增强策略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

本报告期内，A 股市场整体稳健上行，大盘核心指数之一沪深 300 指数在上半年上涨超过 7%，科技板块代表指数之一科创 50 涨幅超过 60%，中小盘代表指数之一中证 1000 上涨超过 15%，充分显示了今年上半年度 A 股市场积极向好的整体态势。期间，受外部风险传导影响，A 股在三月份经历了一定程度的波动，但投资者情绪积极，A 股市场韧性较强，在经历了三月份国际地缘冲突引发的波动后，二季度内强势修复且进一步深化了科创与成长的结构性情行，在后半程呈现出“科技主导、极致分化”的特征，反应出 A 股市场的韧性。

一季度内，在一月份政策宽松预期下，沪指突破 4100 点，AI 半导体等科技领涨下全市场上扬，进入二月份市场出现震荡分歧，板块轮动加速，资金出现成长向低估值的切换，至三月份霍尔木兹海峡紧张局势加剧导致国际油价飙升，美联储降息预期压缩引发全球流动性收紧，全球风险偏好骤降。上游资源供应链稳定性、资源尤其是原油价格、国际海峡通航风险等，及货币环境、市场估值预期空间等，多维度引发市场情绪从乐观亢奋快速转为避险谨慎。除国际原油价格上涨对国内中下游制造业利润的挤压外，国内 PPI、北向资金三月净流出等多重因素，也引致市场内结构切换加快，出现了较为剧烈的系统性转向。

二季度内，A 股走势呈现震荡上行格局。在经受住三月份中东冲突的影响后，市场风险偏好回升，科技股强势回暖，沪指在五月上旬突破 4200 点。情绪上，市场交易活跃，沪深两市的股票日均成交额达到 2 万亿高位水平。风格上，各成长类指数大幅领跑，科创 50 涨幅超 75%，创成长涨幅超 70%，创业板指也连续突破历史新高。相比之下，上证指数、沪深 300 等宽基大盘偏价值高分红风格的指数表现更加稳健。成长与价值、红利之间的“跷跷板”效应显著，在科创相关主题上行的背景下，中证红利指数二季度下跌 12.32%。板块上，电子、通信等科技板块涨幅居前，传统消费板块则持续走弱，行业分化显著，受全球 AI 资本开支扩张驱动，AI 硬件与算力基建板块内的半导体、光通信、PCB、先进封装等 AI 上游硬件受市场青睐，市场积极的投资情绪还覆盖到包括人形机器人、商业航天、固态电池等各类科技前沿或产业化加速的主题上。

宏观经济层面，报告期内国内经济运行整体平稳，预计上半年 GDP 增速维持在相应水平范围

之内，企业盈利预期逐步改善，但内需依然弱势、居民负债表仍在修复中。国内货币政策保持稳健偏适度宽松，央行通过各类工具维护流动性合理充裕，为实体经济和资本市场提供了资金面的支撑。产业政策方面聚焦新质生产力方向，国家密集调研人工智能、高端装备等领域，对前沿科技的布局、政策支持、技术突破、产业化加速等方面的积极预期更强。此外，本轮 AI 前沿领域的持续推进带来全球产业共振，包括前期对软件企业的压制、AI 模型能力不断升级带来应用落地的加速以及 AI 巨头持续加大算力基础设施投资，引致全球半导体周期复苏，带动全球范围内包括 A 股相关的领域的强劲表现。在上半年内，科技板块尤其是光通信、半导体、AI 产业链等领域处于持续高景气，消费板块则相对弱势。

本组合在投资策略上，采用数量化投资流程，通过建立多维度约束保证组合的纪律化构造，包括相对基准指数的行业中性、个股权重偏离约束、风险标的控制，组合按现代投资学理论构造，认为风险回报角度上各类风险溢价的长期存在，并由此控制组合相应敞口。本组合基准指数为上证综指，基准指数成分股数量超过 2200 只股票，组合控制并实现了跟踪误差等指标。本组合在报告期内侧重稳健盈利和低波特征，保持相对基准指数的行业中性。

本季度报告期内，本基金作为对上证综指进行增强的场内 ETF 产品，组合在管理中积极保持合规范围内的仓位水平，力争给投资者提供一个在包括价值、红利等核心维度上实现上证综指本身特征、对上证综指进行有效跟踪，并力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数以实现增强的投资工具。

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 1.2050 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.73%，业绩比较基准收益率为 3.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年内，在全球范围内资本市场都对前沿科技保持了极高的关注，AI 领域凭借大量资本支出、技术突破、商业模式创新，以及各国的政策支持，保持了高速成长。在 A 股范围内，传统行业则相对科技板块处于弱势，这种分化并非短暂的风格漂移或热点追逐，是经济新旧动能转换在资本市场的直接映射，但资本市场会放大经济转换的幅度，并将预期过早的反应在市场内，从而在预期与业绩兑现、交易拥挤与热点扩散、估值敏感与风格博弈等多方面结构性演化过程中，带来市场上行过程中的不断波动。

站在当前时点，国内 A 股在经历了上半年成长风格的走强后，投资者的参与度和积极情绪大幅提振。在实体经济的基础层面，国内经济结构升级和内循环的推进，是重要的内在驱动力，在更长期的背景下，逆全球化趋势对我国的技术自主创新、产业链可控的推动，新技术的市场化以

及工业领域内的数字化和智能化转型，对外出口持续扩大的全球份额，都是国内中长期经济发展的成长性保证。对下半年的 GDP 增速整体预期稳健，支撑因素包括存量政策加快落地、投资和消费的结构性+技术性的修复等，当前时点观察增量政策的必要性和可能性不大。

随着产业结构和经济驱动来源的演化，当前自上而下看待宏观经济和企业盈利的框架和视角逐步多元和立体化，已经与当年的土地财政-信贷社融-地产投资周期发生了巨大的转变，前沿科技、高端制造业、资源品、电力基础设施等部门对经济周期的影响力在显著提升。我们对国内经济的产业结构升级、新兴科技推进、政策支持提振都继续持有积极的信心和预期，并对 A 股市场的稳健与韧性保持乐观。

投资理念上，我们认为以经济运行与资本市场客观规律及经过论证的学术研究建立特征，以流程化建立自动化系统，以纪律化方式规避基金经理的主观判断，是长期角度较为稳健的投资方法之一，通过分散化投资和面向基准严格约束，确保遂行基金本身投资理念。后续，我们将根据合同要求，保持高仓位水平，坚持数量化框架的纪律化操作，并积极扩展数据调整优化模型，控制风险，并根据 A 股风格结构的变化适时适量调整组合的风格结构，希望取得更好的投资效果，回馈投资者。

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

报告期内，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2026 年 1 月 7 日至 2026 年 3 月 22 日，2026 年 3 月 27 日至 2026 年 6 月 7 日；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，嘉实基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何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

本基金托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实上证综合增强策略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	1,932,947.56	611,755.46
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	56,247,144.77	51,855,108.38
其中：股票投资		56,238,144.12	51,855,108.38
基金投资		-	-
债券投资		9,000.65	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		58,180,092.33	52,466,863.84
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		325,010.72	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		21,340.73	23,970.71
应付托管费		4,268.15	4,794.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	49,138.50	142,110.00
负债合计		399,758.10	170,874.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	47,951,000.00	45,451,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	9,829,334.23	6,844,988.98
净资产合计		57,780,334.23	52,295,988.98
负债和净资产总计		58,180,092.33	52,466,863.84

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2050 元，基金份额总额 47,951,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实上证综合增强策略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	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,271,193.17	12,317,977.88
1. 利息收入		887.30	98,468.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	887.30	98,468.94
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）		2,758,129.86	10,459,643.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,334,104.12	9,585,156.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	0.65	-
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	424,025.09	874,487.27
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	481,837.97	1,759,864.96
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	30,338.04	-
减：二、营业总支出		182,354.67	404,453.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	111,463.46	283,926.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	22,292.71	56,785.40
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	48,598.50	63,741.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,088,838.50	11,913,524.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		3,088,838.50	11,913,524.40

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,088,838.50	11,913,524.40

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实上证综合增强策略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	45,451,000.00	-	6,844,988.98	52,295,988.98
二、本期期初净资产	45,451,000.00	-	6,844,988.98	52,295,988.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,500,000.00	-	2,984,345.25	5,484,345.25
（一）、综合收益总额	-	-	3,088,838.50	3,088,838.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列)	2,500,000.00	-	-104,493.25	2,395,506.75
其中：1. 基金申购款	67,500,000.00	-	10,220,594.08	77,720,594.08
2. 基金赎回款	-65,000,000.00	-	-10,325,087.33	-75,325,087.33
（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	47,951,000.00	-	9,829,334.23	57,780,334.23
项目	上年度可比期间 2025 年 3 月 5 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-

二、本期期初净资产	727,951,000.00	-	-	727,951,000.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-677,500,000.00	-	2,483,078.80	-675,016,921.20
(一)、综合收益总额	-	-	11,913,524.40	11,913,524.40
(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)	-677,500,000.00	-	-9,430,445.60	-686,930,445.60
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-677,500,000.00	-	-9,430,445.60	-686,930,445.60
(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	50,451,000.00	-	2,483,078.80	52,934,078.80

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

嘉实上证综合增强策略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[2023]1511号《关于准予嘉实国企主题混合型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2024]1146号《关于准予嘉实国企主题混合型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《嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证

券投资基金基金合同》于 2025 年 3 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 727,951,000.00 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，基金托管人为广发证券股份有限公司。

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	41,383.18
等于：本金	41,355.86
加：应计利息	27.32
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	1,891,564.38
等于：本金	1,891,529.99
加：应计利息	34.39
减：坏账准备	-
合计	1,932,947.56

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		55,227,633.19	-	56,238,144.12	1,010,510.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,000.00	0.65	9,000.65	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,000.00	0.65	9,000.65	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		55,236,633.19	0.65	56,247,144.77	1,010,510.93

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	-

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	48,598.50
其他	540.00
合计	49,138.50

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	45,451,000.00	45,451,000.00
本期申购	67,500,000.00	67,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-65,000,000.00	-65,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	47,951,000.00	47,951,000.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 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	7,864,012.59	-1,019,023.61	6,844,988.98
本期期初	7,864,012.59	-1,019,023.61	6,844,988.98
本期利润	2,607,000.53	481,837.97	3,088,838.50
本期基金份额交易产生的变动数	1,452,431.14	-1,556,924.39	-104,493.25
其中：基金申购款	15,219,388.22	-4,998,794.14	10,220,594.08
基金赎回款	-13,766,957.08	3,441,869.75	-10,325,087.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,923,444.26	-2,094,110.03	9,829,334.23

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	490.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	396.69
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	887.30

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	2,608,020.48
股票投资收益——赎回差价收入	-273,916.36
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	2,334,104.12

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	189,663,778.03
减：卖出股票成本总额	186,865,696.39
减：交易费用	190,061.16
买卖股票差价收入	2,608,020.48

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	75,325,087.33
减：现金支付赎回款总额	10,373,726.97
减：赎回股票成本总额	65,225,276.72
减：交易费用	-
赎回差价收入	-273,916.36

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

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	0.65

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	424,025.09
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	424,025.09

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	481,837.97
股票投资	481,837.97
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	481,837.97

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	30,338.04
合计	30,338.04

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	8,926.92
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	48,598.50

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
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	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 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	111,463.46	283,926.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	34,539.03	120,320.96
应支付基金管理人的净管理费	76,924.43	163,605.90

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 0.50%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×0.50%/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 3 月 5 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,292.71	56,785.40

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

6.4.10.3 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（%）
广发证券	4,647,700.00	9.69	-	-

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 3 月 5 日（基金合同生效日） 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
广发证券股份有限公司_活期	41,383.18	490.61	423,589.74	52,705.59

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118069	爱	2026	1 个月	新债	100.00	100.01	70	7,000.00	7,000.61	-

	科转债	年6月12日	内(含)	未上市						
118071	华峰转债	2026年6月24日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.04	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688260	昀冢科技	2026年6月26日	重大事项停牌	144.00	2026年7月1日	132.00	411	36,833.82	59,184.00	-

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	9,000.65	-
未评级	-	-
合计	9,000.65	-

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合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	1,932,947.56	-	-	-	1,932,947.56
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	9,000.65	56,238,144.12	56,247,144.77
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	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,932,947.56	-	9,000.65	56,238,144.12	58,180,092.33
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	-	-	-	325,010.72	325,010.72
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	21,340.73	21,340.73
应付托管费	-	-	-	4,268.15	4,268.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	49,138.50	49,138.50

负债总计	-	-	-	399,758.10	399,758.10
利率敏感度缺口	1,932,947.56	-	9,000.65	55,838,386.02	57,780,334.23
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	611,755.46	-	-	-	611,755.46
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	51,855,108.38	51,855,108.38
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	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	611,755.46	-	-	51,855,108.38	52,466,863.84
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	23,970.71	23,970.71
应付托管费	-	-	-	4,794.15	4,794.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	142,110.00	142,110.00
负债总计	-	-	-	170,874.86	170,874.86
利率敏感度缺口	611,755.46	-	-	51,684,233.52	52,295,988.98

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	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	130.00	-
	市场利率上升 25 个基点	-127.83	-

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	56,238,144.12	97.33	51,855,108.38	99.16
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	56,238,144.12	97.33	51,855,108.38	99.16

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%	3,004,541.25	2,458,388.25
	业绩比较基准下降 5%	-3,004,541.25	-2,458,388.25

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	56,178,960.12	51,847,945.78
第二层次	68,184.65	-
第三层次	-	7,162.60
合计	56,247,144.77	51,855,108.38

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	56,238,144.12	96.66
	其中：股票	56,238,144.12	96.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,000.65	0.02
	其中：债券	9,000.65	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,932,947.56	3.32
8	其他各项资产	-	-
9	合计	58,180,092.33	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	-	-
B	采矿业	3,646,959.00	6.31
C	制造业	24,193,622.20	41.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,091,919.00	3.62
E	建筑业	674,648.00	1.17
F	批发和零售业	906,006.00	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	1,618,301.00	2.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,841,936.81	4.92
J	金融业	11,078,744.00	19.17
K	房地产业	244,571.00	0.42
L	租赁和商务服务业	433,732.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	1,207,402.54	2.09
N	水利、环境和公共设施管理业	130,536.84	0.23
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	225,176.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	49,293,554.39	85.31

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	61,344.00	0.11
B	采矿业	197,831.00	0.34

C	制造业	5,729,156.40	9.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	134,720.00	0.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	104,430.00	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	61,056.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	255,914.00	0.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	200,846.00	0.35
M	科学研究和技术服务业	22,542.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	177,576.00	0.31
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	6,945,415.40	12.02

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	601398	工商银行	237,200	1,677,004.00	2.90
2	601138	工业富联	21,200	1,529,580.00	2.65
3	601288	农业银行	236,100	1,433,127.00	2.48
4	600519	贵州茅台	1,000	1,185,490.00	2.05
5	601857	中国石油	113,800	987,784.00	1.71
6	601988	中国银行	169,400	968,968.00	1.68
7	603986	兆易创新	1,100	896,500.00	1.55
8	600900	长江电力	32,700	865,569.00	1.50
9	688256	寒武纪	498	794,583.90	1.38
10	600036	招商银行	20,400	724,200.00	1.25

11	688041	海光信息	1,954	723,566.20	1.25
12	601899	紫金矿业	24,600	618,444.00	1.07
13	600028	中国石化	130,500	582,030.00	1.01
14	601318	中国平安	10,700	510,818.00	0.88
15	601872	招商轮船	27,900	490,203.00	0.85
16	601211	国泰海通	26,800	487,760.00	0.84
17	603259	药明康德	3,900	485,589.00	0.84
18	600183	生益科技	2,600	450,840.00	0.78
19	600030	中信证券	15,600	448,188.00	0.78
20	600999	招商证券	21,000	443,100.00	0.77
21	601658	邮储银行	89,800	442,714.00	0.77
22	601628	中国人寿	12,400	438,340.00	0.76
23	688409	富创精密	1,427	437,018.75	0.76
24	600150	中国船舶	12,700	429,133.00	0.74
25	688766	普冉股份	554	424,696.40	0.74
26	603993	洛阳钼业	23,600	414,180.00	0.72
27	600487	亨通光电	3,700	404,558.00	0.70
28	600309	万华化学	5,900	403,619.00	0.70
29	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.65
30	688002	睿创微纳	2,376	367,543.44	0.64
31	601088	中国神华	9,300	363,072.00	0.63
32	600346	恒力石化	20,400	361,284.00	0.63
33	601998	中信银行	51,800	358,974.00	0.62
34	688525	佰维存储	718	355,216.14	0.61
35	603799	华友钴业	7,200	347,472.00	0.60
36	601166	兴业银行	20,400	337,824.00	0.58
37	600026	中远海能	18,800	337,272.00	0.58
38	601939	建设银行	35,000	337,050.00	0.58
39	600233	圆通速递	21,200	333,900.00	0.58
40	600989	宝丰能源	16,400	333,412.00	0.58
41	688521	芯原股份	890	330,314.60	0.57
42	601601	中国太保	11,100	316,572.00	0.55
43	601117	中国化学	42,700	313,845.00	0.54
44	600372	中航机载	28,800	312,480.00	0.54
45	600499	科达制造	22,600	311,880.00	0.54
46	600196	复星医药	13,700	307,839.00	0.53
47	688981	中芯国际	1,915	304,140.30	0.53
48	601360	三六零	34,200	297,198.00	0.51
49	600919	江苏银行	27,500	296,450.00	0.51
50	600741	华域汽车	18,900	293,328.00	0.51
51	600352	浙江龙盛	23,900	289,429.00	0.50
52	688200	华峰测控	540	283,554.00	0.49
53	601888	中国中免	5,200	279,292.00	0.48

54	600236	桂冠电力	31,400	275,692.00	0.48
55	603233	大参林	18,000	270,540.00	0.47
56	688702	盛科通信	690	269,093.10	0.47
57	601688	华泰证券	13,000	268,060.00	0.46
58	688396	华润微	2,708	264,165.40	0.46
59	603966	法兰泰克	30,720	250,368.00	0.43
60	601009	南京银行	25,100	248,239.00	0.43
61	601226	华电科工	38,400	244,224.00	0.42
62	600218	全柴动力	33,700	243,314.00	0.42
63	603676	卫信康	29,900	240,695.00	0.42
64	601995	中金公司	6,600	238,590.00	0.41
65	600803	新奥股份	14,100	222,780.00	0.39
66	603663	三祥新材	2,300	221,490.00	0.38
67	600157	永泰能源	129,400	208,334.00	0.36
68	600176	中国巨石	2,800	204,064.00	0.35
69	688127	蓝特光学	2,075	202,520.00	0.35
70	601279	英利汽车	66,200	201,910.00	0.35
71	600887	伊利股份	8,300	198,868.00	0.34
72	600995	南网储能	15,400	189,420.00	0.33
73	688385	复旦微电	2,580	183,928.20	0.32
74	601169	北京银行	36,400	178,360.00	0.31
75	688235	百济神州	698	177,717.78	0.31
76	600648	外高桥	21,900	174,981.00	0.30
77	600971	恒源煤电	25,200	173,880.00	0.30
78	603018	华设集团	33,160	170,442.40	0.29
79	688387	信科移动	8,462	167,886.08	0.29
80	600016	民生银行	52,000	167,440.00	0.29
81	688045	必易微	2,055	166,002.90	0.29
82	601011	宝泰隆	62,800	164,536.00	0.28
83	601869	长飞光纤	300	163,770.00	0.28
84	600667	太极实业	5,400	157,572.00	0.27
85	605117	德业股份	1,480	157,146.40	0.27
86	600489	中金黄金	8,600	155,230.00	0.27
87	603648	畅联股份	18,000	154,440.00	0.27
88	688049	炬芯科技	3,168	148,610.88	0.26
89	688599	天合光能	10,466	147,779.92	0.26
90	601999	出版传媒	26,300	145,176.00	0.25
91	688146	中船特气	411	143,845.89	0.25
92	603192	汇得科技	8,300	140,602.00	0.24
93	688012	中微公司	298	139,613.00	0.24
94	603019	中科曙光	1,300	139,399.00	0.24
95	688347	华虹宏力	411	138,219.30	0.24
96	603186	华正新材	600	135,180.00	0.23

97	605151	西上海	7,600	133,836.00	0.23
98	688299	长阳科技	7,938	132,643.98	0.23
99	603569	长久物流	24,900	131,970.00	0.23
100	688061	灿瑞科技	2,654	131,824.18	0.23
101	600725	云维股份	42,400	131,016.00	0.23
102	600397	江钨装备	4,600	125,258.00	0.22
103	603068	博通集成	3,100	124,713.00	0.22
104	603678	火炬电子	1,500	124,500.00	0.22
105	600584	长电科技	1,200	124,260.00	0.22
106	688211	中科微至	3,507	120,710.94	0.21
107	603823	百合花	2,200	120,054.00	0.21
108	600685	中船防务	4,700	119,568.00	0.21
109	688472	阿特斯	10,807	116,931.74	0.20
110	688230	芯导科技	1,472	116,008.32	0.20
111	605589	圣泉集团	1,800	114,426.00	0.20
112	688778	厦钨新能	2,102	114,348.80	0.20
113	600000	浦发银行	13,200	113,652.00	0.20
114	688111	金山办公	533	113,555.65	0.20
115	688339	亿华通	6,034	112,835.80	0.20
116	601728	中国电信	21,600	112,104.00	0.19
117	600941	中国移动	1,300	111,969.00	0.19
118	603115	海星股份	900	110,223.00	0.19
119	688505	复旦张江	14,861	109,674.18	0.19
120	688349	三一重能	7,212	109,478.16	0.19
121	603288	海天味业	3,300	109,428.00	0.19
122	688592	司南导航	2,618	108,489.92	0.19
123	688119	中钢洛耐	22,727	107,953.25	0.19
124	688285	高铁电气	14,866	106,589.22	0.18
125	603515	欧普照明	6,300	102,942.00	0.18
126	600110	诺德股份	6,800	102,612.00	0.18
127	601668	中国建筑	23,500	101,990.00	0.18
128	688300	联瑞新材	411	100,448.40	0.17
129	603773	沃格光电	600	97,782.00	0.17
130	603408	建霖家居	10,000	96,500.00	0.17
131	688223	晶科能源	20,143	95,679.25	0.17
132	688257	新锐股份	923	94,053.70	0.16
133	688025	杰普特	200	94,000.00	0.16
134	600886	国投电力	7,000	93,170.00	0.16
135	601236	红塔证券	13,600	92,752.00	0.16
136	603688	石英股份	1,100	90,871.00	0.16
137	600295	鄂尔多斯	8,400	90,048.00	0.16
138	688662	富信科技	534	89,712.00	0.16
139	603093	南华期货	4,900	88,935.00	0.15

140	600105	永鼎股份	1,300	87,724.00	0.15
141	688030	山石网科	5,529	87,302.91	0.15
142	603358	华达科技	2,000	87,000.00	0.15
143	600884	杉杉股份	6,400	86,720.00	0.15
144	600795	国电电力	18,400	85,928.00	0.15
145	601006	大秦铁路	18,600	85,746.00	0.15
146	688603	天承科技	411	85,467.45	0.15
147	688265	南模生物	2,470	85,437.30	0.15
148	688152	麒麟信安	3,108	85,407.84	0.15
149	603267	鸿远电子	1,100	85,228.00	0.15
150	600522	中天科技	1,400	84,952.00	0.15
151	601919	中远海控	6,400	84,864.00	0.15
152	688366	昊海生科	2,856	82,452.72	0.14
153	603013	亚普股份	5,200	82,108.00	0.14
154	603929	亚翔集成	300	81,606.00	0.14
155	600019	宝钢股份	14,900	80,907.00	0.14
156	688536	思瑞浦	222	80,827.98	0.14
157	601567	三星电气	5,400	80,676.00	0.14
158	601019	山东出版	12,500	80,000.00	0.14
159	601878	浙商证券	8,400	79,800.00	0.14
160	600377	宁沪高速	6,800	78,676.00	0.14
161	605208	永茂泰	4,900	78,155.00	0.14
162	603700	宁水集团	6,700	77,787.00	0.13
163	688717	艾罗能源	936	77,285.52	0.13
164	688383	新益昌	411	77,284.44	0.13
165	688526	科前生物	6,380	77,198.00	0.13
166	688629	华丰科技	411	77,066.61	0.13
167	601298	青岛港	9,400	75,670.00	0.13
168	688533	上声电子	3,610	75,304.60	0.13
169	601225	陕西煤业	3,700	75,295.00	0.13
170	600320	振华重工	18,100	74,753.00	0.13
171	601229	上海银行	8,600	74,648.00	0.13
172	603179	新泉股份	1,500	74,475.00	0.13
173	688084	晶品特装	1,476	74,213.28	0.13
174	605499	东鹏饮料	600	74,058.00	0.13
175	600419	天润乳业	9,700	73,429.00	0.13
176	688489	三未信安	3,223	73,162.10	0.13
177	688531	日联科技	411	73,092.24	0.13
178	688143	长盈通	411	72,286.68	0.13
179	688088	虹软科技	2,030	72,166.50	0.12
180	601233	桐昆股份	3,300	71,445.00	0.12
181	688301	奕瑞科技	575	71,300.00	0.12
182	603183	建研院	20,000	71,000.00	0.12

183	688001	华兴源创	823	70,531.10	0.12
184	603755	日辰股份	3,100	70,339.00	0.12
185	603182	嘉华股份	6,100	69,540.00	0.12
186	688681	科汇股份	4,965	69,410.70	0.12
187	603075	热威股份	3,100	69,316.00	0.12
188	688686	奥普特	411	69,208.29	0.12
189	688478	晶升股份	780	69,069.00	0.12
190	605001	威奥股份	12,600	68,670.00	0.12
191	600596	新安股份	4,300	68,628.00	0.12
192	688420	美腾科技	3,256	68,603.92	0.12
193	688113	联测科技	1,951	68,480.10	0.12
194	600015	华夏银行	10,700	68,373.00	0.12
195	688468	科美诊断	11,915	67,796.35	0.12
196	600235	民丰特纸	13,500	67,095.00	0.12
197	603385	惠达卫浴	13,700	66,856.00	0.12
198	605122	四方新材	6,200	66,836.00	0.12
199	600007	中国国贸	3,500	66,430.00	0.11
200	688067	爱威科技	3,272	65,930.80	0.11
201	600692	亚通股份	12,100	65,703.00	0.11
202	600099	林海股份	8,200	65,436.00	0.11
203	603506	南都物业	7,000	65,380.00	0.11
204	603931	格林达	1,100	65,340.00	0.11
205	603041	美思德	6,300	65,331.00	0.11
206	600189	泉阳泉	8,600	64,758.00	0.11
207	688638	誉辰智能	2,069	64,490.73	0.11
208	600051	宁波联合	11,300	63,619.00	0.11
209	600268	国电南自	5,400	62,748.00	0.11
210	688728	格科微	2,932	61,689.28	0.11
211	688528	秦川物联	6,713	61,356.82	0.11
212	688188	柏楚电子	575	61,352.50	0.11
213	688426	康为世纪	3,315	60,797.10	0.11
214	600011	华能国际	7,900	59,961.00	0.10
215	600230	沧州大化	4,600	59,892.00	0.10
216	603319	美湖股份	1,800	59,778.00	0.10
217	601702	华峰铝业	4,200	59,220.00	0.10
218	688260	昀冢科技	411	59,184.00	0.10
219	601077	渝农商行	9,600	58,656.00	0.10
220	600188	兖矿能源	3,300	58,641.00	0.10
221	688370	从麟科技	2,802	58,617.84	0.10
222	603706	东方环宇	3,300	57,057.00	0.10
223	605198	安德利	900	57,024.00	0.10
224	688248	南网科技	823	56,935.14	0.10
225	605567	春雪食品	6,900	55,131.00	0.10

226	688757	胜科纳米	823	54,894.10	0.10
227	600816	建元信托	22,400	54,656.00	0.09
228	688103	国力电子	734	54,616.94	0.09
229	603489	八方股份	1,900	53,124.00	0.09
230	603256	宏和科技	200	53,066.00	0.09
231	688003	天准科技	411	52,320.30	0.09
232	688395	正弦电气	2,346	51,846.60	0.09
233	600938	中国海油	1,900	51,585.00	0.09
234	603083	剑桥科技	200	50,974.00	0.09
235	688308	欧科亿	277	50,361.37	0.09
236	688511	天微电子	1,653	49,937.13	0.09
237	600395	盘江股份	10,900	49,704.00	0.09
238	600177	雅戈尔	6,600	49,698.00	0.09
239	688616	西力科技	4,908	49,570.80	0.09
240	603283	赛腾股份	600	48,588.00	0.08
241	688291	金橙子	823	48,129.04	0.08
242	601328	交通银行	7,400	47,582.00	0.08
243	600064	南京高科	6,600	47,058.00	0.08
244	688092	爱科科技	2,205	46,834.20	0.08
245	688278	特宝生物	823	44,771.20	0.08
246	603797	联泰环保	11,700	43,875.00	0.08
247	601898	中煤能源	3,500	42,630.00	0.07
248	600925	苏能股份	10,500	42,105.00	0.07
249	688095	福昕软件	705	41,898.15	0.07
250	688271	联影医疗	411	41,605.53	0.07
251	688677	海泰新光	411	41,564.43	0.07
252	688382	益方生物	2,257	40,626.00	0.07
253	601366	利群股份	12,400	40,052.00	0.07
254	600918	中泰证券	7,500	39,900.00	0.07
255	688131	皓元医药	411	38,880.60	0.07
256	603214	爱婴室	3,200	38,752.00	0.07
257	603101	汇嘉时代	6,200	38,688.00	0.07
258	688508	芯朋微	411	38,206.56	0.07
259	688096	京源环保	2,858	38,182.88	0.07
260	601528	瑞丰银行	8,600	38,012.00	0.07
261	688786	悦安新材	823	37,923.84	0.07
262	600530	交大昂立	7,600	37,468.00	0.06
263	688190	云路股份	411	37,281.81	0.06
264	688386	泛亚微透	411	36,924.24	0.06
265	605155	西大门	3,100	36,704.00	0.06
266	688676	金盘科技	411	34,787.04	0.06
267	603037	凯众股份	3,400	34,068.00	0.06
268	600674	川投能源	2,400	34,008.00	0.06

269	688036	传音控股	561	33,070.95	0.06
270	600429	三元股份	7,900	31,916.00	0.06
271	688719	爱科赛博	411	31,647.00	0.05
272	603102	百合股份	1,000	31,570.00	0.05
273	600231	凌钢股份	19,500	31,005.00	0.05
274	603199	九华旅游	900	28,044.00	0.05
275	603091	众鑫股份	560	27,311.20	0.05
276	688565	力源科技	2,772	26,195.40	0.05
277	601607	上海医药	1,500	23,100.00	0.04
278	688698	伟创电气	411	21,556.95	0.04
279	601186	中国铁建	3,300	19,635.00	0.03
280	688231	隆达股份	534	19,613.82	0.03
281	605123	派克新材	200	19,402.00	0.03
282	600426	华鲁恒升	700	16,744.00	0.03
283	600546	山煤国际	1,500	16,395.00	0.03
284	600968	海油发展	4,800	15,984.00	0.03

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	301536	星辰科技	3,000	386,130.00	0.67
2	002643	万润股份	11,700	245,115.00	0.42
3	301165	锐捷网络	2,800	225,260.00	0.39
4	002384	东山精密	800	209,880.00	0.36
5	300014	亿纬锂能	2,800	182,084.00	0.32
6	300867	圣元环保	9,800	177,576.00	0.31
7	002202	金风科技	7,300	174,470.00	0.30
8	000792	盐湖股份	5,600	169,064.00	0.29
9	002841	视源股份	4,600	158,838.00	0.27
10	300750	宁德时代	400	157,204.00	0.27
11	000651	格力电器	4,000	150,000.00	0.26
12	300054	鼎龙股份	1,400	148,358.00	0.26
13	000655	金岭矿业	23,100	146,916.00	0.25
14	300512	中亚股份	21,000	143,220.00	0.25
15	300933	中辰股份	23,500	142,880.00	0.25
16	002722	物产金轮	12,100	142,659.00	0.25
17	300908	仲景食品	6,310	139,072.40	0.24
18	002479	富春环保	32,000	134,720.00	0.23
19	002398	垒知集团	34,300	128,625.00	0.22
20	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.22
21	002010	传化智联	26,200	117,114.00	0.20
22	002558	巨人网络	4,200	115,752.00	0.20
23	002990	盛视科技	1,400	110,600.00	0.19
24	300373	扬杰科技	700	110,061.00	0.19

25	300592	华凯易佰	5,900	104,430.00	0.18
26	300223	北京君正	400	99,560.00	0.17
27	002532	天山铝业	9,200	98,716.00	0.17
28	301526	国际复材	1,900	88,673.00	0.15
29	300213	佳讯飞鸿	14,200	86,052.00	0.15
30	002027	分众传媒	17,300	83,732.00	0.14
31	002810	山东赫达	3,100	76,570.00	0.13
32	002083	孚日股份	7,200	75,528.00	0.13
33	300568	星源材质	4,000	74,880.00	0.13
34	300438	鹏辉能源	900	74,565.00	0.13
35	003016	欣贺股份	11,800	72,334.00	0.13
36	301200	大族数控	200	72,130.00	0.12
37	301308	江波龙	100	70,380.00	0.12
38	002574	明牌珠宝	16,900	70,135.00	0.12
39	002028	思源电气	400	69,200.00	0.12
40	000973	佛塑科技	4,800	68,880.00	0.12
41	000703	恒逸石化	5,000	67,850.00	0.12
42	301013	利和兴	900	65,025.00	0.11
43	000636	风华高科	900	65,016.00	0.11
44	300503	昊志机电	700	64,610.00	0.11
45	002838	道恩股份	2,100	64,302.00	0.11
46	000949	新乡化纤	10,000	63,400.00	0.11
47	300843	胜蓝股份	400	62,500.00	0.11
48	002493	荣盛石化	5,800	62,350.00	0.11
49	300432	富临精工	3,100	62,279.00	0.11
50	002772	众兴菌业	5,400	61,344.00	0.11
51	002120	韵达股份	9,600	61,056.00	0.11
52	301188	力诺药包	900	60,210.00	0.10
53	300888	稳健医疗	2,100	58,779.00	0.10
54	002391	长青股份	11,900	57,953.00	0.10
55	301511	德福科技	400	57,540.00	0.10
56	002079	苏州固锔	3,700	55,611.00	0.10
57	003036	泰坦股份	600	55,494.00	0.10
58	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.10
59	002460	赣锋锂业	800	52,320.00	0.09
60	001203	大中矿业	1,700	50,915.00	0.09
61	300570	太辰光	200	49,342.00	0.09
62	300835	龙磁科技	200	45,898.00	0.08
63	301568	思泰克	400	44,640.00	0.08
64	300776	帝尔激光	200	42,992.00	0.07
65	301486	致尚科技	200	41,664.00	0.07
66	002881	美格智能	1,100	40,084.00	0.07
67	300811	铂科新材	400	37,956.00	0.07

68	300681	英搏尔	1,300	37,206.00	0.06
69	002090	金智科技	3,800	33,592.00	0.06
70	301319	唯特偶	200	33,466.00	0.06
71	300959	线上线下	200	29,562.00	0.05
72	300779	惠城环保	560	28,112.00	0.05
73	002160	常铝股份	7,200	26,352.00	0.05
74	300797	钢研纳克	1,700	22,542.00	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,024,072.00	3.87
2	601398	工商银行	1,614,376.00	3.09
3	300308	中际旭创	1,494,501.00	2.86
4	600028	中国石化	1,304,119.00	2.49
5	603937	丽岛新材	1,187,598.00	2.27
6	688013	天臣医疗	1,168,339.24	2.23
7	603259	药明康德	1,115,133.80	2.13
8	600183	生益科技	1,062,991.00	2.03
9	688206	概伦电子	1,049,638.48	2.01
10	688256	寒武纪	1,047,038.00	2.00
11	601211	国泰海通	1,046,335.00	2.00
12	688439	振华风光	1,036,761.08	1.98
13	600233	圆通速递	1,031,844.00	1.97
14	600030	中信证券	1,030,237.00	1.97
15	688153	唯捷创芯	1,015,189.53	1.94
16	603993	洛阳钼业	1,011,722.00	1.93
17	601138	工业富联	1,008,839.00	1.93
18	601899	紫金矿业	983,061.00	1.88
19	601288	农业银行	976,706.00	1.87
20	600741	华域汽车	971,068.00	1.86

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	2,157,213.00	4.13
2	600183	生益科技	1,685,124.00	3.22
3	601398	工商银行	1,618,880.00	3.10
4	601857	中国石油	1,539,500.00	2.94
5	300308	中际旭创	1,512,460.00	2.89
6	601991	大唐发电	1,473,056.00	2.82
7	601899	紫金矿业	1,303,006.00	2.49
8	688256	寒武纪	1,278,964.72	2.45

9	603259	药明康德	1,207,065.00	2.31
10	603937	丽岛新材	1,185,317.00	2.27
11	600030	中信证券	1,177,586.00	2.25
12	688013	天臣医疗	1,141,232.97	2.18
13	601088	中国神华	1,130,026.00	2.16
14	603968	醋化股份	1,124,822.00	2.15
15	600236	桂冠电力	1,097,928.00	2.10
16	600522	中天科技	1,070,098.00	2.05
17	688206	概伦电子	1,041,755.70	1.99
18	688772	珠海冠宇	1,023,416.33	1.96
19	688439	振华风光	1,021,664.18	1.95
20	688153	唯捷创芯	1,015,046.98	1.94

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	191,147,590.84
卖出股票收入（成交）总额	189,663,778.03

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	9,000.65	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,000.65	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118069	爱科转债	70	7,000.61	0.01
2	118071	华峰转债	20	2,000.04	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 只债券。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/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
无。

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

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 (%)
2,107	22,757.95	14,259,997.00	29.74	33,691,003.00	70.26

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	100.00	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 (2025 年 3 月 5 日) 基金份额总额	727,951,000.00
本报告期期初基金份额总额	45,451,000.00
本报告期基金总申购份额	67,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	65,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	47,951,000.00

§ 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，本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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，本基金托管人不涉及公募基金托管业务的诉讼。

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，本基金托管人的专门基金托管部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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 (%)	
金融街证券股份有限公司	5	380,811,368.87	100.00	70,789.97	100.00	—

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。

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 (%)
金融街证券股	—	—	—	—	—	—

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关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	证券日报、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
2	关于嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证券日报、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 27 日
3	关于嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 13 日
4	关于嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 20 日
5	关于嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 15 日
6	关于嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 29 日
7	关于嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	证券日报、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 5 日
8	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

- (4) 《嘉实上证综合增强策略交易型开放式指数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) 报告期内嘉实上证综合增强策略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