

汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 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
§ 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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	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	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 净资产变动表	21
6.4 报表附注	23
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	66
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	66
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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注	66
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
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.....	68
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	69
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.....	69
10.8 其他重大事件	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	73
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	74
12.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富上证综合 ETF
场内简称	上证综合
基金主代码	510980
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 22 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	479,798,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 12 月 01 日

注：扩位证券简称：上证指数 ETF 汇添富。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金的股票投资主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资方法，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略。
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，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数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		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	(010) 66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588

传真	021-28932998	(010) 66105798
注册地址	上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	鲁伟铭	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告置备地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

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 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	32,669,538.90
本期利润	31,135,282.25
加权平均基金份额本期利润	0.0932
本期加权平均净值利润率	6.59%
本期基金份额净值增长率	4.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	205,542,949.40
期末可供分配基金份额利润	0.4284
期末基金资产净值	685,340,949.40
期末基金份额净值	1.4284
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	42.84%

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），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	5.57%	0.93%	5.20%	0.94%	0.37%	-0.01%
过去六个 月	4.26%	0.95%	3.16%	0.95%	1.10%	0.00%
过去一年	20.62%	0.82%	18.87%	0.83%	1.75%	-0.01%
自基金合 同生效起 至今	42.84%	1.02%	33.46%	1.04%	9.38%	-0.02%

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

汇添富上证综合ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023年11月22日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司、汇添富投资管理有限公司、汇添富基金销售（上海）有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人、QFII基金管理人、基金投资顾问、公募证券投资基金销售等业务资格。

汇添富基金自成立以来，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2026 上半年，汇添富基金新成立 30 只公开募集证券投资基金。截至 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 421 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
孙浩	本基金的基金经理	2023 年 12 月 12 日	—	6	国籍：中国。学历：北京大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格, CFA。从业经历：2020 年 7 月起任汇添富基金管理股份有限公司数量分析师。2023 年 8 月 29 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至 2026 年 5 月 26 日任中证

					上海国企交 易型开放 式指数证 券投资基 金联接基 金的基金 经理。2023 年 8 月 29 日 至 2025 年 3 月 18 日任汇 添富深证 300 交易型 开放式指 数证券投资 基金联接基 金的基金经 理。2023 年 8 月 29 日至 2026 年 6 月 11 日任中证 银行交易型 开放式指 数证券投资 基金联接基 金的基金经 理。2023 年 9 月 28 日至 今任中证长 三角一体化 发展主题交 易型开放 式指数证 券投资基 金联接基 金的基金经 理。2023 年 11 月 28 日 至 2026 年 5 月 26 日 任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互 通交易型开 放式指数证 券投资基 金联接基 金的
--	--	--	--	--	---

					基金经理。 2023 年 11 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至 2026 年 6 月 11 日任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2024 年 3 月
--	--	--	--	--	--

					12 日至 2024 年 12 月 26 日任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 26 日至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 4 日至 2025 年 8 月 11 日任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资
--	--	--	--	--	--

					基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 20 日至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 7 月 9 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2024 年 11 月 18 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 18 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 27 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开
--	--	--	--	--	---

					放式指数证 券投资基金 发起式联接 基金的基金 经理。2025 年 10 月 22 日至今任汇 添富中证 500 交易型 开放式指数 证券投资基金 的基金经 理。2026 年 5 月 26 日至 今任汇添富 中证 500 交 易型开放式 指数证券投资 基金联接 基金（LOF） 的基金经 理。2026 年 5 月 26 日至 今任汇添富 中证 A500 交 易型开放式 指数证券投资 基金联接 基金的基金 经理。
--	--	--	--	--	---

注:基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规

规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，力争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。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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% 的情况有 1 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年 A 股整体震荡上行，上证指数累计上涨 3.16%。分行业看，电子、通信、建材、基础化工板块涨幅领跑，消费者服务、农林牧渔、商贸零售、传媒板块表现垫底。中信一级行业涨跌幅首尾区间差值达 117.37%，市场结构性分化特征突出；风格维度成长风格显著占优，价值板块持续承压。

2026 年作为“十五五”规划开局之年，国内经济在政策红利释放、外部环境日趋复杂的双重背景下，呈现“总量增速边际走缓、行业结构分化持续加深”的运行特征。1—6 月规模以上工业增加值累计同比增长 5.4%，较一季度（1—3 月）6.1%的累计增速回落 0.7 个百分点，工业总量增速逐季走弱。高技术制造业是工业板块中唯一增速持续抬升的领域，一季度增加值累计同比增长 12.5%，上半年进一步升至 13.3%，累计增速提升 0.8 个百分点，产业升级动力充沛。6 月制造业 PMI 为 50.3%，较 5 月 50.0%小幅回升，与 4 月数值持平；指数连续三个月贴近荣枯线 50%，反映制造业仅处于弱修复区间。分项来看，新订单指数偏弱，意味着内需修复根基尚不稳固，企业生产主要依靠存量在手订单支撑。

需求端“三驾马车”走势大幅分化，出口是上半年经济的核心支撑，也是最大亮点。4、5、6 月单月出口同比增速分别达 14.0%、19.3%、27.0%，二季度出口持续高景气；1—6 月全国出口累计同比增长 17.6%，在全球外需整体疲软环境下充分彰显国内供应链韧性。本轮出口高增核心驱动为全球 AI 产业资本开支扩张，拉动国内科技产业链产品外需放量；半导体、通信设备、消费电子等高技术产品出口占比持续提升，出口结构正加速由劳动密集型向技术密集型转型。

消费修复力度持续偏弱。1—6 月社会消费品零售总额累计同比增长 1.3%，较一季度 2.4%的增速再度回落 1.1 个百分点。消费走弱核心原因是 2025 年以旧换新政策提前透支居民消费需求，2026 年上半年消费市场进入需求真空期。后续消费复苏节奏，将取决于居民收入预期改善与房地产市场企稳两大条件。

整体投资端持续承压，房地产投资为主要拖累项。1—6 月全国固定资产投资累计同比下降 5.7%，其中房地产开发投资累计同比下滑 18.0%，降幅较 1—5 月的 16.2%持续走阔。地产行业深度调整仍是压制整体投资的核心因素：虽然部分核心城市二手房量价边际回暖，但新房销售、投资数据依旧走弱，稳地产政策的托底成效尚未充分显现。制造业投资依托高技术产业拉动保持相对稳健，基建投资受益于财政前置发力与“十五五”储备项目落地具备一定韧性，但二者增长力度仍无法对冲地产下行带来的拖累。

物价层面，6 月 CPI 同比上涨 1.0%，上半年 CPI 累计同比约 1.0%，物价保持温和修复。PPI 二季度出现显著边际改善：6 月 PPI 同比升至 4.1%，较 3 月 0.5%大幅上行 3.6 个百分点，上半年 PPI 累计同比上涨 1.5%。PPI 快速上行，一方面源于中东地缘冲突推高国际油价带来的输入型成本压力，另一方面也佐证制造业内需边际回暖。

宏观基本面变化与 A 股市场走势形成清晰映射：高技术制造业长期高景气叠加政策持续加持，成为上半年市场核心主线，驱动电子、通信等成长赛道大幅走强。PPI 快速上行有望修复中游制造企业盈利预期，叠加“十五五”科技创新、产业升级政策持续落地，持续抬升市场对成长板块的风险偏好。反观传统制造、地产产业链，受投资下行、内需疲软制约，基本面修复动力不足，叠加消费复苏不及预期，价值板块整体表现疲软，最终造就市场极致的结构性分化行情。

上证指数 ETF 汇添富跟踪上证指数，上证指数是 A 股历史最悠久的股价指数，是宏观经济的晴雨表，经过 2020 年的修订，在新股延迟纳入、剔除风险警示股和纳入科创板证券三个方面进行了全新升级，具有更好的投资属性。本基金采用抽样复制方法，在严控跟踪误差的前提下，通过量化多因子和风险模型来追求稳健适度的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 4.26%，同期业绩比较基准收益率为 3.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济结构性分化格局预计延续，A 股市场依旧以结构性机会为主。电子、通信等成长板块上半年累计涨幅较大，当前估值处于相对高位，短期资金博弈或将加剧板块波动，但高技术制造业产业升级中长期逻辑未发生改变，叠加 PPI 上行持续修复中游制造盈利，电子、通信、高端装备等成长赛道仍具备较强配置价值，后续业绩增长有望逐步消化当前高估值。消费、地产链板块则仍需等待内需回暖、稳增长托底政策显效的明确信号。

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、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估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策

权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,921,666.21	1,643,268.54
结算备付金		328,489.93	308,647.33
存出保证金		4,885.03	3,523.96
交易性金融资产	6.4.7.2	681,556,933.19	392,859,263.81
其中：股票投资		681,427,924.52	392,859,263.81
基金投资		-	-
债券投资		129,008.67	-
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		-	-
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	6.4.7.6	-	-
资产总计		686,811,974.36	394,814,703.64
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,006,994.54	64,897.34
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		279,675.45	200,323.80
应付托管费		55,935.08	40,064.77
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.39	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.7	128,419.50	220,255.82
负债合计		1,471,024.96	525,541.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	479,798,000.00	287,798,000.00
未分配利润	6.4.7.9	205,542,949.40	106,491,161.91
净资产合计		685,340,949.40	394,289,161.91
负债和净资产总计		686,811,974.36	394,814,703.64

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4284 元，基金份额总额 479,798,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日 至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		32,610,346.53	21,298,029.40
1. 利息收入		5,300.77	2,157.78
其中：存款利息收入	6.4.7.10	5,300.77	2,157.78
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）		34,322,688.54	20,789,353.79
其中：股票投资收益	6.4.7.11	29,025,713.80	16,286,440.81
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8.32	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	5,296,966.42	4,502,912.98
以摊余成本计量的金融 资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.18	-1,534,256.65	639,867.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.19	-183,386.13	-133,349.83
减：二、营业总支出		1,475,064.28	1,162,308.28

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,160,893.41	894,114.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	232,178.62	178,822.87
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	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		0.04	-
8. 其他费用	6.4.7.21	81,992.21	89,371.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,135,282.25	20,135,721.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,135,282.25	20,135,721.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		31,135,282.25	20,135,721.12

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	287,798,000.00	106,491,161.91	394,289,161.91
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	287,798,000.00	106,491,161.91	394,289,161.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	192,000,000.00	99,051,787.49	291,051,787.49
（一）、综合收益总额	-	31,135,282.25	31,135,282.25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	192,000,000.00	67,916,505.24	259,916,505.24

其中：1. 基金申购款	999,000,000.00	399,463,475.79	1,398,463,475.79
2. 基金赎回款	-807,000,000.00	-331,546,970.55	-1,138,546,970.55
（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）	-	-	-
四、本期期末净资产	479,798,000.00	205,542,949.40	685,340,949.40
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	383,798,000.00	52,530,069.89	436,328,069.89
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	383,798,000.00	52,530,069.89	436,328,069.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-162,000,000.00	-11,679,138.69	-173,679,138.69
（一）、综合收益总额	-	20,135,721.12	20,135,721.12
（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）	-162,000,000.00	-31,814,859.81	-193,814,859.81
其中：1. 基金申购款	312,000,000.00	28,869,525.18	340,869,525.18
2. 基金赎回款	-474,000,000.00	-60,684,384.99	-534,684,384.99
（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	221,798,000.00	40,850,931.20	262,648,931.20

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>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</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

汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2023〕1732 号文《关于准予汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 11 月 22 日生效。首次设立基金募集规模为 464,798,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 70015647_B10 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

2. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税。金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加

的单位外）及地方教育附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

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

5. 个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	4,921,666.21
等于：本金	4,921,173.45
加：应计利息	492.76

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	4,921,666.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		672,836,925.29	-	681,427,924.52	8,590,999.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	129,000.00	8.67	129,008.67	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	129,000.00	8.67	129,008.67	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		672,965,925.29	8.67	681,556,933.19	8,590,999.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	46,596.64
其中：交易所市场	46,596.64
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	22,315.49
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	128,419.50

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	287,798,000.00	287,798,000.00
本期申购	999,000,000.00	999,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-807,000,000.00	-807,000,000.00
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	479,798,000.00	479,798,000.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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	104,571,854.48	1,919,307.43	106,491,161.91
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	104,571,854.48	1,919,307.43	106,491,161.91
本期利润	32,669,538.90	-1,534,256.65	31,135,282.25
本期基金份额交易产生的变动数	90,523,697.32	-22,607,192.08	67,916,505.24
其中：基金申购款	435,654,305.85	-36,190,830.06	399,463,475.79
基金赎回款	-345,130,608.53	13,583,637.98	-331,546,970.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	227,765,090.70	-22,222,141.30	205,542,949.40

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	4,613.64
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	678.86
其他	8.27
合计	5,300.77

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,142,622.25
股票投资收益——赎回差价收入	19,883,091.55
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	29,025,713.80

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	191,508,326.26
减：卖出股票成本总额	182,173,646.04
减：交易费用	192,057.97
买卖股票差价收入	9,142,622.25

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,138,546,970.55
减：现金支付赎回款总额	3,702,346.03
减：赎回股票成本总额	1,114,961,532.97
减：交易费用	—
赎回差价收入	19,883,091.55

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	8.32
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	8.32

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,296,966.42
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	5,296,966.42

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,534,256.65
——股票投资	-1,534,256.65

——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	-
——期货投资	-
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	-1,534,256.65

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-183,386.13
其他	-
合计	-183,386.13

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	133.00
指数使用费	-
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师	-

费	
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	36.35
合计	81,992.21

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金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。

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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,160,893.41	894,114.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	280,727.15	171,949.50
应支付基金管理人的净管理费	880,166.26	722,164.76

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	232,178.62	178,822.87

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
东方证券股份有	1,669,000.00	0.35	1,669,000.00	0.58

限公司				
-----	--	--	--	--

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	4,921,666.21	4,613.64	931,645.31	1,525.72

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
603293	埃泰克汽车电子	2026 年 04 月 09 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	25	837.25	848.25	
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	72	997.92	5,289.12	

603435	嘉德利	2026年05月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	61	961.36	2,849.31	
688797	臻宝科技	2026年06月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	99	4,411.44	46,398.33	
688811	有研金属复材	2026年04月01日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	480	3,076.80	11,582.40	
6.4.12.1.2 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
113706	金帝转债	2026年06月16日	17个交易日	新债流通受限	100.00	100.01	400	40,000.00	40,002.81	
118069	爱科转债	2026年06月12日	18个交易日	新债流通受限	100.00	100.01	550	55,000.00	55,004.82	
118072	鼎通转债	2026年06月25日	16个交易日	新债流通受限	100.00	100.00	340	34,000.00	34,001.04	

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
688072	拓荆科技	2026年06月29日	重大事项停牌	832.00	2026年07月13日	890.99	2,480	1,207,921.85	2,063,360.00	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开

放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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 06 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							

货币资金	4,921,666.21	-	-	-	-	-	4,921,666.21
结算备付金	328,489.93	-	-	-	-	-	328,489.93
存出保证金	4,885.03	-	-	-	-	-	4,885.03
交易性金融资产	-	-	129,008.67	-	-	681,427,924.52	681,556,933.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,255,041.17	-	129,008.67	-	-	681,427,924.52	686,811,974.36
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	-	-	-	-	-	1,006,994.54	1,006,994.54
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	279,675.45	279,675.45
应付托管费	-	-	-	-	-	55,935.08	55,935.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资	-	-	-	-	-	-	-

顾问费							
应交税费	-	-	-	-	-	0.39	0.39
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	128,419.50	128,419.50
负债总计	-	-	-	-	-	1,471,024.96	1,471,024.96
利率敏感度缺口	5,255,041.17	-	129,008.67	-	-	679,956,899.56	685,340,949.40
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,643,268.54	-	-	-	-	-	1,643,268.54
结算备付金	308,647.33	-	-	-	-	-	308,647.33
存出保证金	3,523.96	-	-	-	-	-	3,523.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	392,859,263.81	392,859,263.81
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,955,439.83	-	-	-	-	392,859,263.81	394,814,703.64
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	-	-	-	-	-	64,897.34	64,897.34
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	200,323.80	200,323.80
应付托管费	-	-	-	-	-	40,064.77	40,064.77
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	-	-	-	-	-	220,255.82	220,255.82
负债总计	-	-	-	-	-	525,541.73	525,541.73
利率敏感度缺口	1,955,439.83	-	-	-	-	392,333,722.08	394,289,161.91

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	681,427,924.52	99.43	392,859,263.81	99.64
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	129,008.67	0.02	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	681,556,933.19	99.45	392,859,263.81	99.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	上证综合指数上涨 5%	33,948,110.46	19,201,267.91
	上证综合指数下跌 5%	-33,948,110.46	-19,201,267.91

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日
第一层次	679,297,597.11
第二层次	2,192,368.67
第三层次	66,967.41
合计	681,556,933.19

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-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”章节中所列示情况外，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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	681,427,924.52	99.22
	其中：股票	681,427,924.52	99.22
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	129,008.67	0.02
	其中：债券	129,008.67	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	5,250,156.14	0.76
8	其他各项资产	4,885.03	0.00
9	合计	686,811,974.36	100.00

注：此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”章节的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

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	925,892.00	0.14
B	采矿业	52,312,672.15	7.63
C	制造业	339,535,164.36	49.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,893,982.89	3.92
E	建筑业	7,828,294.00	1.14
F	批发和零售业	8,042,624.34	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	21,003,856.00	3.06
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,914,676.24	7.72
J	金融业	144,534,829.49	21.09

K	房地产业	6,625,508.00	0.97
L	租赁和商务服务业	2,432,610.80	0.35
M	科学研究和技术服务业	10,162,621.04	1.48
N	水利、环境和公共设施管理业	5,315,533.44	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	679,574.00	0.10
Q	卫生和社会工作	502,169.36	0.07
R	文化、体育和娱乐业	1,323,157.00	0.19
S	综合	329,000.00	0.05
	合计	681,362,165.11	99.42

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	-	-
C	制造业	66,967.41	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	66,967.41	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	601288	农业银行	4,293,700	26,062,759.00	3.80
2	601988	中国银行	3,662,200	20,947,784.00	3.06
3	601857	中国石油	1,854,200	16,094,456.00	2.35
4	600519	贵州茅台	13,400	15,885,566.00	2.32
5	601138	工业富联	211,600	15,266,940.00	2.23
6	688256	寒武纪科技	8,235	13,139,354.25	1.92
7	688041	海光信息	24,516	9,078,274.80	1.32
8	600036	招商银行	234,400	8,321,200.00	1.21
9	601628	中国人寿	233,900	8,268,365.00	1.21
10	601088	中国神华	192,000	7,495,680.00	1.09
11	603629	利通电子	41,900	7,492,139.00	1.09
12	600183	生益科技	42,300	7,334,820.00	1.07
13	600900	长江电力	275,600	7,295,132.00	1.06
14	605376	博迁新材	24,500	6,646,850.00	0.97
15	601318	中国平安	125,500	5,991,370.00	0.87
16	688172	燕东微电子 股份	69,611	5,823,656.26	0.85
17	601899	紫金矿业	227,100	5,709,294.00	0.83
18	601658	邮储银行	1,058,500	5,218,405.00	0.76

19	603259	药明康德	41,200	5,129,812.0 0	0.75
20	601328	交通银行	785,400	5,050,122.0 0	0.74
21	688012	中微半导体 设备	10,338	4,843,353.0 0	0.71
22	600028	中国石化	1,085,500	4,841,330.0 0	0.71
23	601728	中国电信	904,300	4,693,317.0 0	0.68
24	688549	中巨芯科技	123,501	4,546,071.8 1	0.66
25	688008	澜起科技	14,238	4,412,356.2 0	0.64
26	688200	华峰测控	8,194	4,302,669.4 0	0.63
27	600030	中信证券	145,000	4,165,850.0 0	0.61
28	601166	兴业银行	249,300	4,128,408.0 0	0.60
29	688521	芯原微电子	10,412	3,864,309.6 8	0.56
30	600276	恒瑞医药	69,700	3,627,188.0 0	0.53
31	600549	厦门钨业	42,300	3,603,960.0 0	0.53
32	603993	洛阳钼业	198,473	3,483,201.1 5	0.51
33	688001	苏州华兴源 创科技	39,509	3,385,921.3 0	0.49
34	600989	宝丰能源	164,500	3,344,285.0 0	0.49
35	688519	南亚新材料	8,555	3,251,242.2 0	0.47
36	600522	中天科技	53,500	3,246,380.0 0	0.47
37	603986	兆易创新	3,900	3,178,500.0 0	0.46
38	601998	中信银行	456,900	3,166,317.0 0	0.46
39	603989	艾华集团	58,900	3,092,250.0 0	0.45
40	600160	巨化股份	56,200	2,979,162.0 0	0.43

41	601066	中信建投	101,700	2,956,419.0 0	0.43
42	600406	国电南瑞	127,500	2,913,375.0 0	0.43
43	688515	裕太微电子	11,349	2,823,177.2 4	0.41
44	600000	浦发银行	319,900	2,754,339.0 0	0.40
45	601211	国泰海通	151,102	2,750,056.4 0	0.40
46	600584	长电科技	25,900	2,681,945.0 0	0.39
47	688419	耐科装备	33,378	2,625,179.7 0	0.38
48	688380	中微半导	39,254	2,587,231.1 4	0.38
49	601319	中国人保	380,300	2,570,828.0 0	0.38
50	601601	中国太保	89,100	2,541,132.0 0	0.37
51	605118	力鼎光电	68,400	2,386,476.0 0	0.35
52	688002	睿创微纳	15,418	2,385,010.4 2	0.35
53	688677	青岛海泰新光	23,561	2,382,723.9 3	0.35
54	600309	万华化学	34,600	2,366,986.0 0	0.35
55	601225	陕西煤业	115,564	2,351,727.4 0	0.34
56	688295	中复神鹰碳纤维	37,972	2,298,824.8 8	0.34
57	601816	京沪高铁	503,300	2,279,949.0 0	0.33
58	600919	江苏银行	209,500	2,258,410.0 0	0.33
59	601939	建设银行	231,700	2,231,271.0 0	0.33
60	603380	易德龙	48,700	2,195,883.0 0	0.32
61	688103	国力电子	28,791	2,142,338.3 1	0.31
62	603288	海天味业	63,600	2,108,976.0 0	0.31

63	688072	拓荆科技	2,480	2,063,360.0 0	0.30
64	688069	德林海环保	54,904	2,051,213.4 4	0.30
65	688668	鼎通科技	5,486	2,047,923.8 0	0.30
66	601919	中远海控	154,400	2,047,344.0 0	0.30
67	601668	中国建筑	467,900	2,030,686.0 0	0.30
68	601985	中国核电	224,700	2,029,041.0 0	0.30
69	600909	华安证券	180,200	2,002,022.0 0	0.29
70	603267	鸿远电子	25,600	1,983,488.0 0	0.29
71	601336	新华保险	32,100	1,915,086.0 0	0.28
72	600641	先导基电	47,900	1,909,294.0 0	0.28
73	600999	招商证券	88,700	1,871,570.0 0	0.27
74	688512	慧智微电子	116,973	1,868,058.8 1	0.27
75	600176	中国巨石	25,300	1,843,864.0 0	0.27
76	688207	格灵深瞳	91,286	1,834,848.6 0	0.27
77	603678	火炬电子	22,100	1,834,300.0 0	0.27
78	601818	光大银行	634,100	1,832,549.0 0	0.27
79	601005	重庆钢铁	1,573,000	1,824,680.0 0	0.27
80	600025	华能水电	204,200	1,815,338.0 0	0.26
81	600887	伊利股份	75,200	1,801,792.0 0	0.26
82	688052	纳芯微电子	6,139	1,769,935.0 9	0.26
83	600497	驰宏锌锗	143,400	1,736,574.0 0	0.25
84	601012	隆基绿能	129,600	1,700,352.0 0	0.25

85	688261	东微半导体	15,733	1,650,863.6 9	0.24
86	601009	南京银行	164,300	1,624,927.0 0	0.24
87	601168	西部矿业	59,600	1,617,544.0 0	0.24
88	688981	中芯国际	10,162	1,613,928.8 4	0.24
89	688020	方邦股份	6,460	1,612,416.0 0	0.24
90	688702	盛科通信	4,074	1,588,819.2 6	0.23
91	600031	三一重工	90,300	1,560,384.0 0	0.23
92	600186	莲花控股	110,900	1,552,600.0 0	0.23
93	600690	海尔智家	75,700	1,545,037.0 0	0.23
94	688188	上海柏楚电 子科技	14,457	1,542,561.9 0	0.23
95	600739	辽宁成大	150,700	1,523,577.0 0	0.22
96	600547	山东黄金	65,500	1,512,395.0 0	0.22
97	600936	北投科技	349,100	1,501,130.0 0	0.22
98	600150	中国船舶	44,414	1,500,749.0 6	0.22
99	603050	科林电气	76,200	1,490,472.0 0	0.22
100	601065	江西省盐业 集团	221,281	1,484,795.5 1	0.22
101	600875	东方电气	51,300	1,475,901.0 0	0.22
102	603501	豪威集团	15,300	1,451,205.0 0	0.21
103	688158	优刻得科技	39,278	1,443,859.2 8	0.21
104	600809	山西汾酒	13,200	1,443,684.0 0	0.21
105	601229	上海银行	165,900	1,440,012.0 0	0.21
106	688027	科大国盾量 子	2,855	1,438,948.5 5	0.21

107	601898	中煤能源	117,700	1,433,586.0 0	0.21
108	601366	利群股份	443,500	1,432,505.0 0	0.21
109	601766	中国中车	272,300	1,415,960.0 0	0.21
110	601633	长城汽车	92,400	1,394,316.0 0	0.20
111	600050	中国联通	347,400	1,389,600.0 0	0.20
112	601958	金钼股份	48,900	1,374,579.0 0	0.20
113	600038	中直股份	54,000	1,365,660.0 0	0.20
114	600019	宝钢股份	250,900	1,362,387.0 0	0.20
115	603256	宏和科技	5,100	1,353,183.0 0	0.20
116	603519	立霸股份	88,100	1,347,930.0 0	0.20
117	688182	灿勤科技	31,013	1,335,729.9 1	0.19
118	688506	百利天恒药 业	4,508	1,325,487.2 4	0.19
119	688183	生益电子	10,006	1,324,794.4 0	0.19
120	600089	特变电工	58,400	1,314,000.0 0	0.19
121	688681	科汇电力自 动化	92,993	1,300,042.1 4	0.19
122	603328	依顿电子	102,800	1,288,084.0 0	0.19
123	600104	上汽集团	131,200	1,280,512.0 0	0.19
124	600075	新疆天业	315,300	1,273,812.0 0	0.19
125	688629	四川华丰科 技	6,695	1,255,379.4 5	0.18
126	688508	芯朋微电子	13,440	1,249,382.4 0	0.18
127	603893	瑞芯微	6,600	1,243,176.0 0	0.18
128	600029	南方航空	239,500	1,240,610.0 0	0.18

129	688259	创耀通信科技	31,684	1,239,478.08	0.18
130	688213	思特威电子科技	11,524	1,233,874.68	0.18
131	600330	天通股份	39,920	1,231,132.80	0.18
132	600926	杭州银行	85,000	1,228,250.00	0.18
133	600699	均胜电子	56,700	1,225,287.00	0.18
134	603085	天成自控	112,200	1,219,614.00	0.18
135	600018	上港集团	258,200	1,218,704.00	0.18
136	603936	博敏电子	45,400	1,212,634.00	0.18
137	600760	中航沈飞	29,500	1,212,450.00	0.18
137	601600	中国铝业	147,500	1,212,450.00	0.18
139	603019	中科曙光	11,300	1,211,699.00	0.18
140	603661	恒林股份	29,800	1,192,000.00	0.17
141	600115	中国东航	309,400	1,178,814.00	0.17
142	600116	三峡水利	208,700	1,168,720.00	0.17
143	600015	华夏银行	182,400	1,165,536.00	0.17
144	600660	福耀玻璃	23,000	1,160,120.00	0.17
145	601169	北京银行	236,200	1,157,380.00	0.17
146	600886	国投电力	86,700	1,153,977.00	0.17
147	600905	三峡能源	310,700	1,152,697.00	0.17
148	601727	上海电气	164,100	1,148,700.00	0.17
149	600590	泰豪科技	113,400	1,145,340.00	0.17
150	601375	中原证券	284,800	1,136,352.00	0.17

151	600642	申能股份	129,200	1,127,916.0 0	0.16
152	601991	大唐发电	158,500	1,122,180.0 0	0.16
153	600166	福田汽车	384,500	1,118,895.0 0	0.16
154	600346	恒力石化	62,700	1,110,417.0 0	0.16
155	600489	中金黄金	61,200	1,104,660.0 0	0.16
156	601528	瑞丰银行	249,000	1,100,580.0 0	0.16
157	603005	晶方科技	20,400	1,098,948.0 0	0.16
158	601607	上海医药	71,100	1,094,940.0 0	0.16
159	688025	杰普特光电	2,304	1,082,880.0 0	0.16
160	600512	腾达建设	578,500	1,081,795.0 0	0.16
161	603323	苏农银行	278,687	1,078,518.6 9	0.16
162	688093	世华科技	28,924	1,067,295.6 0	0.16
163	601688	华泰证券	51,500	1,061,930.0 0	0.15
164	688202	美迪西生物 医药	13,052	1,053,426.9 2	0.15
165	688566	吉贝尔药业	40,970	1,048,422.3 0	0.15
166	601877	正泰电器	41,800	1,047,926.0 0	0.15
167	600378	昊华科技	13,900	1,047,782.0 0	0.15
168	688063	派能科技	19,474	1,037,379.9 8	0.15
169	600893	航发动力	26,900	1,031,346.0 0	0.15
170	603916	苏博特	75,100	1,025,866.0 0	0.15
171	688111	金山办公	4,801	1,022,853.0 5	0.15
172	600499	科达制造	73,900	1,019,820.0 0	0.15

173	603167	渤海轮渡	118,800	1,018,116.0 0	0.15
174	601995	中金公司	28,100	1,015,815.0 0	0.15
175	688550	瑞联新材料	17,512	1,013,069.2 0	0.15
176	600011	华能国际	133,000	1,009,470.0 0	0.15
177	600210	紫江企业	161,900	1,003,780.0 0	0.15
178	600415	小商品城	98,700	1,002,792.0 0	0.15
179	605499	东鹏饮料	8,106	1,000,523.5 8	0.15
180	601669	中国电建	212,700	999,690.00	0.15
181	688114	华大智造	19,570	999,635.60	0.15
182	688390	固德威电源	9,108	988,309.08	0.14
183	600500	中化国际	126,200	988,146.00	0.14
184	601881	中国银河	78,500	986,745.00	0.14
185	600177	雅戈尔	130,100	979,653.00	0.14
186	600064	南京高科	137,100	977,523.00	0.14
187	688113	联测科技	27,838	977,113.80	0.14
188	688123	聚辰半导体	4,564	970,306.40	0.14
189	600795	国电电力	207,200	967,624.00	0.14
190	688689	常州银河微电	14,938	966,787.36	0.14
191	600675	中华企业	469,100	966,346.00	0.14
192	600111	北方稀土	20,000	961,000.00	0.14
193	600716	凤凰股份	285,100	957,936.00	0.14
194	600098	广州发展	162,000	957,420.00	0.14
195	603317	天味食品	73,500	956,235.00	0.14
196	601127	赛力斯	15,600	955,500.00	0.14
197	600352	浙江龙盛	78,900	955,479.00	0.14
198	603160	汇顶科技	15,400	950,334.00	0.14
199	601677	明泰铝业	56,700	941,220.00	0.14
200	600332	白云山	46,900	939,876.00	0.14
201	601901	方正证券	130,100	936,720.00	0.14
202	603199	九华旅游	29,700	925,452.00	0.14
203	603797	联泰环保	246,600	924,750.00	0.13
204	603071	物产环能	83,500	923,510.00	0.13
205	601577	长沙银行	105,800	921,518.00	0.13
206	688077	大地熊新材料	34,669	918,381.81	0.13

207	601108	财通证券	106,000	916,900.00	0.13
208	688533	上声电子股份	43,726	912,124.36	0.13
209	688558	国盛智科股份	27,489	903,288.54	0.13
210	600061	国投资本	137,800	902,590.00	0.13
211	688023	安恒信息	24,529	900,704.88	0.13
212	601868	中国能建	336,900	899,523.00	0.13
213	603166	福达股份	67,200	898,464.00	0.13
214	688080	映翰通网络	20,691	894,885.75	0.13
215	601018	宁波港	283,800	893,970.00	0.13
216	603195	公牛集团	22,675	887,726.25	0.13
217	600563	法拉电子	4,600	877,680.00	0.13
218	603920	世运电路	18,200	874,328.00	0.13
219	603057	上海紫燕食品	39,200	874,160.00	0.13
220	600496	精工钢构	281,200	871,720.00	0.13
221	601880	辽港股份	626,500	864,570.00	0.13
222	688015	交控科技	56,152	863,617.76	0.13
223	603444	吉比特	2,400	860,208.00	0.13
224	600585	海螺水泥	50,600	857,670.00	0.13
225	688616	西力科技	84,820	856,682.00	0.13
226	601226	华电科工	134,200	853,512.00	0.12
227	601555	东吴证券	107,700	852,984.00	0.12
228	605168	三人行	16,745	847,966.80	0.12
229	605020	永和股份	20,800	846,976.00	0.12
230	688106	金宏气体	20,412	846,689.76	0.12
231	601963	重庆银行	83,400	840,672.00	0.12
232	600282	南钢股份	182,900	839,511.00	0.12
233	600741	华域汽车	53,800	834,976.00	0.12
234	600310	广西能源	196,000	827,120.00	0.12
235	688799	华纳大药厂	18,318	821,928.66	0.12
236	600908	无锡银行	161,700	821,436.00	0.12
237	688686	奥普特科技	4,865	819,217.35	0.12
238	603663	三祥新材	8,500	818,550.00	0.12
239	605006	山东玻纤	38,600	814,074.00	0.12
240	600188	兖矿能源	45,480	808,179.60	0.12
241	601390	中国中铁	193,600	807,312.00	0.12
242	603038	华立股份	51,300	800,280.00	0.12
243	600020	中原高速	216,500	798,885.00	0.12
244	688112	鼎阳科技	10,745	789,327.70	0.12
245	600016	民生银行	244,700	787,934.00	0.11
246	603118	共进股份	65,009	787,258.99	0.11

247	600037	歌华有线	125,100	784,377.00	0.11
248	600109	国金证券	89,200	783,176.00	0.11
249	600269	赣粤高速	195,900	779,682.00	0.11
250	601128	常熟银行	131,070	762,827.40	0.11
251	600004	白云机场	104,800	760,848.00	0.11
252	603187	海容冷链	66,100	759,489.00	0.11
253	601117	中国化学	102,900	756,315.00	0.11
254	600048	保利发展	158,900	735,707.00	0.11
255	688428	诺诚健华	25,839	735,636.33	0.11
256	600035	楚天高速	217,600	733,312.00	0.11
257	603799	华友钴业	15,000	723,900.00	0.11
258	603379	三美股份	9,500	720,955.00	0.11
259	603927	中科软	56,280	715,318.80	0.10
260	603197	保隆科技	25,500	712,470.00	0.10
261	600776	东方通信	54,200	712,188.00	0.10
262	601006	大秦铁路	154,200	710,862.00	0.10
263	600339	中油工程	230,000	706,100.00	0.10
264	600420	国药现代	88,605	704,409.75	0.10
265	688100	威胜信息	22,873	699,685.07	0.10
266	688163	赛伦生物	14,185	692,369.85	0.10
267	601101	昊华能源	65,300	689,568.00	0.10
268	600469	风神股份	125,800	684,352.00	0.10
269	688105	诺唯赞生物	39,443	684,336.05	0.10
270	688208	道通科技	27,157	684,084.83	0.10
271	600863	华能蒙电	144,900	681,030.00	0.10
272	688416	恒烁股份	4,852	679,280.00	0.10
273	688557	兰剑智能	21,805	676,609.15	0.10
274	600988	赤峰黄金	25,500	671,160.00	0.10
275	688267	中触媒股份	33,540	660,738.00	0.10
276	688653	康希通信	37,888	658,493.44	0.10
277	600392	盛和资源	22,100	657,917.00	0.10
278	601860	紫金银行	271,200	656,304.00	0.10
279	603111	康尼机电	115,600	654,296.00	0.10
280	600803	新奥股份	41,400	654,120.00	0.10
281	600918	中泰证券	122,400	651,168.00	0.10
282	600961	株冶集团	20,100	651,039.00	0.09
283	600517	国网英大	138,800	649,584.00	0.09
284	600032	浙江新能	91,900	647,895.00	0.09
285	603297	永新光学	4,400	646,580.00	0.09
286	601100	恒立液压	6,000	645,360.00	0.09
287	600997	开滦股份	134,000	636,500.00	0.09
288	688223	晶科能源	132,333	628,581.75	0.09
289	688355	明志科技	32,635	628,223.75	0.09

290	601825	沪农商行	83,700	626,913.00	0.09
291	601997	贵阳银行	122,000	625,860.00	0.09
292	603885	吉祥航空	60,700	624,603.00	0.09
293	603876	鼎胜新材	24,000	624,240.00	0.09
294	603311	金海高科	17,000	623,050.00	0.09
295	603310	巍华新材	42,300	621,387.00	0.09
296	603558	健盛集团	55,800	618,822.00	0.09
297	600995	南网储能	50,100	616,230.00	0.09
298	603105	芯能科技	90,200	614,262.00	0.09
299	603309	维力医疗	54,400	610,368.00	0.09
300	600623	华谊集团	75,400	608,478.00	0.09
301	603713	密尔克卫	8,500	604,945.00	0.09
302	688006	浙江杭可科技	16,470	601,978.50	0.09
303	600266	城建发展	153,800	601,358.00	0.09
304	688249	晶合集成	10,172	600,453.16	0.09
305	601827	三峰环境	82,200	597,594.00	0.09
306	688526	武汉科前生物	48,524	587,140.40	0.09
307	688185	康希诺生物	11,467	584,702.33	0.09
308	600867	通化东宝	72,400	582,096.00	0.08
309	600548	深高速	71,500	581,295.00	0.08
310	688439	振华风光	12,581	581,242.20	0.08
311	603368	柳药集团	39,400	577,998.00	0.08
312	603456	九洲药业	42,200	576,452.00	0.08
313	603416	信捷电气	10,900	576,283.00	0.08
314	688126	上海硅产业集团	14,443	576,131.27	0.08
315	603383	顶点软件	21,656	575,183.36	0.08
316	600261	阳光照明	186,700	575,036.00	0.08
317	600985	淮北矿业	40,600	570,430.00	0.08
318	600114	东睦股份	15,100	570,176.00	0.08
319	600998	九州通	120,786	566,486.34	0.08
320	601368	绿城水务	138,300	565,647.00	0.08
321	600598	北大荒	52,100	564,764.00	0.08
322	600885	宏发股份	16,280	561,497.20	0.08
323	688459	哈铁科技	67,252	560,209.16	0.08
324	600377	宁沪高速	48,000	555,360.00	0.08
325	600966	博汇纸业	115,800	553,524.00	0.08
326	603788	宁波高发	40,100	553,380.00	0.08
327	603018	华设集团	107,060	550,288.40	0.08
328	603387	基蛋生物	72,600	548,856.00	0.08
329	601111	中国国航	90,400	546,920.00	0.08

330	603995	甬金股份	23,400	543,114.00	0.08
331	603578	三星新材	46,200	542,850.00	0.08
332	603390	通达电气	51,800	540,792.00	0.08
333	600009	上海机场	23,400	540,540.00	0.08
334	600655	豫园股份	129,800	533,478.00	0.08
335	603897	长城科技	16,400	532,344.00	0.08
336	603237	五芳斋实业	42,700	528,626.00	0.08
337	600583	海油工程	104,500	525,635.00	0.08
338	603345	安井食品	6,500	521,235.00	0.08
339	601882	海天精工	25,700	519,911.00	0.08
340	600845	宝信软件	31,140	517,858.20	0.08
341	603982	泉峰汽车	91,900	513,721.00	0.07
342	603025	大豪科技	37,500	511,500.00	0.07
343	688552	航天南湖	18,110	509,434.30	0.07
344	603500	祥和实业	43,800	508,956.00	0.07
345	688180	君实生物	15,025	508,145.50	0.07
346	600131	国网信通	34,700	506,620.00	0.07
347	688819	天能电池集团股份	22,810	506,382.00	0.07
348	600372	中航机载	46,600	505,610.00	0.07
349	600251	冠农股份	58,500	505,440.00	0.07
350	688222	成都先导	15,658	502,778.38	0.07
351	600763	通策医疗	14,822	502,169.36	0.07
352	688132	邦彦技术股份	37,854	497,780.10	0.07
353	688067	爱威科技	24,687	497,443.05	0.07
354	600600	青岛啤酒	9,500	496,185.00	0.07
355	600410	华胜天成	31,000	490,730.00	0.07
356	600449	宁夏建材	43,500	486,330.00	0.07
357	688029	南微医学科技	6,682	479,767.60	0.07
358	600132	重庆啤酒	11,600	479,080.00	0.07
359	688619	罗普特科技	29,486	478,557.78	0.07
360	688060	江苏云涌电子科技	14,539	478,187.71	0.07
361	688391	钜泉科技	13,284	476,497.08	0.07
362	603170	宝立食品科技	42,100	475,730.00	0.07
363	688187	时代电气	6,904	474,028.64	0.07
364	601788	光大证券	32,700	471,861.00	0.07
365	688571	杭华油墨股份	53,915	471,756.25	0.07
366	688271	联影医疗	4,658	471,529.34	0.07

367	688591	泰凌微	13,629	468,565.02	0.07
368	601158	重庆水务	120,100	463,586.00	0.07
369	603330	天洋新材	59,800	462,852.00	0.07
370	600196	复星医药	20,500	460,635.00	0.07
371	600562	国睿科技	21,700	460,474.00	0.07
372	600307	酒钢宏兴	331,100	460,229.00	0.07
373	601163	三角轮胎	36,200	459,378.00	0.07
374	601808	中海油服	42,300	457,263.00	0.07
375	605123	派克新材	4,700	455,947.00	0.07
376	600780	通宝能源	77,600	454,736.00	0.07
377	603766	隆鑫通用	37,900	452,147.00	0.07
378	603899	晨光股份	21,900	451,797.00	0.07
379	600987	航民股份	74,600	451,330.00	0.07
380	600323	瀚蓝环境	16,400	450,344.00	0.07
381	603700	宁水集团	38,300	444,663.00	0.06
382	603213	镇洋发展	32,100	443,943.00	0.06
383	600827	百联股份	59,900	443,859.00	0.06
384	601198	东兴证券	32,600	443,034.00	0.06
385	603737	三棵树	18,220	439,102.00	0.06
386	600862	中航高科	24,300	438,129.00	0.06
387	603707	健友股份	61,700	436,219.00	0.06
388	600597	光明乳业	71,700	435,219.00	0.06
389	688538	和辉光电	167,151	434,592.60	0.06
390	688363	华熙生物	12,093	432,566.61	0.06
391	603867	新化股份	12,900	432,021.00	0.06
392	605258	协和电子	12,700	430,276.00	0.06
393	601866	中远海发	193,700	428,077.00	0.06
394	600436	片仔癀	3,900	426,192.00	0.06
395	603569	长久物流	80,000	424,000.00	0.06
396	601003	柳钢股份	125,700	423,609.00	0.06
397	688798	艾为电子	5,736	420,563.52	0.06
398	600643	爱建集团	113,300	420,343.00	0.06
399	601096	宏盛华源铁 塔集团	96,500	418,810.00	0.06
400	603639	海利尔	40,687	403,615.04	0.06
401	688522	纳睿雷达科 技	20,136	403,122.72	0.06
402	603728	鸣志电器	6,600	402,072.00	0.06
403	603006	联明股份	28,200	401,850.00	0.06
404	600732	爱旭股份	29,000	401,650.00	0.06
405	688636	智明达电子	11,042	400,051.66	0.06
406	688429	时创能源	39,241	399,865.79	0.06
407	600935	华塑股份	169,500	398,325.00	0.06

408	600582	天地科技	89,000	396,050.00	0.06
409	688582	芯动联科	5,982	388,830.00	0.06
410	600854	春兰股份	95,000	386,650.00	0.06
411	688018	乐鑫科技	3,017	385,934.64	0.06
412	601083	锦江航运	38,700	384,678.00	0.06
413	600873	梅花生物	52,300	384,405.00	0.06
414	689009	九号公司	10,055	383,598.25	0.06
415	601518	吉林高速	135,900	380,520.00	0.06
416	603638	艾迪精密	16,200	379,890.00	0.06
417	603325	博隆技术	7,500	379,650.00	0.06
418	603043	广州酒家	30,600	379,440.00	0.06
419	603596	伯特利	15,254	378,909.36	0.06
420	600395	盘江股份	82,300	375,288.00	0.05
421	600821	金开新能	59,600	372,500.00	0.05
422	600906	财达证券	49,900	372,254.00	0.05
423	688443	智翔金泰	15,911	369,930.75	0.05
424	601990	南京证券	56,000	367,920.00	0.05
425	600054	黄山旅游	34,000	366,180.00	0.05
426	601966	玲珑轮胎	35,900	365,821.00	0.05
427	688321	微芯生物	13,856	364,828.48	0.05
428	600100	同方股份	53,200	364,420.00	0.05
429	603305	旭升集团	29,900	362,388.00	0.05
430	600380	健康元	38,400	361,728.00	0.05
431	601118	海南橡胶	73,400	361,128.00	0.05
432	603035	常熟汽饰	33,700	357,894.00	0.05
433	688238	和元生物	65,452	354,749.84	0.05
434	603699	纽威股份	7,000	352,100.00	0.05
435	605098	行动教育	6,500	352,040.00	0.05
436	688584	上海合晶硅材料	9,792	352,022.40	0.05
437	601717	中创智领	25,200	350,532.00	0.05
438	600820	隧道股份	66,600	346,986.00	0.05
439	601702	华峰铝业	24,562	346,324.20	0.05
440	600523	贵航股份	32,800	346,040.00	0.05
441	600125	铁龙物流	67,400	341,718.00	0.05
442	688133	泰坦股份	16,025	338,608.25	0.05
443	600391	航发科技	10,100	337,845.00	0.05
444	601900	南方传媒	31,100	337,746.00	0.05
445	603861	白云电器	26,100	336,951.00	0.05
446	600023	浙能电力	63,900	336,114.00	0.05
447	600770	综艺股份	47,800	334,600.00	0.05
448	688389	深圳普门科技	33,855	331,440.45	0.05

449	688092	爱科科技股份	15,574	330,791.76	0.05
450	600834	申通地铁	50,000	329,000.00	0.05
451	600848	上海临港	43,900	328,811.00	0.05
452	600661	昂立教育	47,400	327,534.00	0.05
453	688050	爱博诺德医疗	8,873	323,420.85	0.05
454	688379	华光新材	3,843	322,927.29	0.05
455	603070	万控智造	25,400	319,532.00	0.05
456	600535	天士力	23,400	309,582.00	0.05
457	601689	拓普集团	5,455	307,771.10	0.04
458	603786	科博达	7,500	306,825.00	0.04
459	688131	皓元医药	3,242	306,693.20	0.04
460	600861	北京人力	24,800	302,560.00	0.04
461	688565	力源科技	32,002	302,418.90	0.04
462	603659	璞泰来	10,400	300,872.00	0.04
463	603233	大参林	20,000	300,600.00	0.04
464	601236	红塔证券	43,200	294,624.00	0.04
465	600717	天津港	75,300	292,917.00	0.04
466	601928	凤凰传媒	32,600	286,554.00	0.04
467	601016	节能风电	73,800	286,344.00	0.04
468	600363	联创光电	8,000	286,240.00	0.04
469	603270	金帝精密科技股份	8,500	284,835.00	0.04
470	600039	四川路桥	36,000	281,520.00	0.04
471	601888	中国中免	5,200	279,292.00	0.04
472	601858	中国科传	16,100	278,691.00	0.04
473	600633	浙数文化	27,200	276,896.00	0.04
474	601800	中国交建	47,800	272,938.00	0.04
475	600612	老凤祥	8,300	266,845.00	0.04
476	600382	广东明珠	39,300	264,489.00	0.04
477	600928	西安银行	79,100	258,657.00	0.04
478	600010	宝钢股份	110,100	245,523.00	0.04
479	688613	奥精医疗	17,256	243,482.16	0.04
480	688678	福立旺精密	10,060	243,150.20	0.04
481	603689	皖天然气	34,673	240,283.89	0.04
482	688343	云天励飞股份	2,913	237,875.58	0.03
483	600787	中储股份	56,700	237,006.00	0.03
484	603466	风语筑	24,200	236,918.00	0.03
485	688303	大全能源	13,332	232,376.76	0.03
486	603887	城地香江	24,700	230,698.00	0.03
487	603408	建霖家居	23,800	229,670.00	0.03

488	603201	常润股份	16,420	229,223.20	0.03
489	601061	中信金属	21,200	228,324.00	0.03
490	688728	格科微有限公司	10,813	227,505.52	0.03
491	600486	扬农化工	4,474	226,831.80	0.03
492	600968	海油发展	67,900	226,107.00	0.03
493	601865	福莱特	21,500	225,965.00	0.03
494	600983	惠而浦	32,200	223,146.00	0.03
495	688305	科德数控	3,377	220,416.79	0.03
496	600356	恒丰纸业	29,500	218,595.00	0.03
497	603172	浙江万丰股份	13,300	218,519.00	0.03
498	603855	华荣股份	12,500	216,625.00	0.03
499	605056	咸亨国际	13,100	209,600.00	0.03
500	600628	新世界	36,900	207,747.00	0.03
501	600570	恒生电子	9,800	207,662.00	0.03
502	688599	天合光能	14,441	203,906.92	0.03
503	603602	纵横通信	18,500	203,870.00	0.03
504	600718	东软集团	27,500	199,100.00	0.03
505	688609	广东九联科技	18,025	198,455.25	0.03
506	603357	设计总院	32,100	195,168.00	0.03
507	603816	顾家家居	8,700	194,532.00	0.03
508	688137	近岸蛋白	5,368	193,248.00	0.03
509	600398	海澜之家	36,600	191,418.00	0.03
510	688088	虹软科技	5,366	190,761.30	0.03
511	603151	邦基科技股份有限公司	17,300	190,127.00	0.03
512	600750	华润江中	8,600	189,802.00	0.03
513	600853	龙建股份	62,100	188,784.00	0.03
514	600609	金杯汽车	59,800	186,576.00	0.03
515	603282	亚光科技股份有限公司	13,000	185,510.00	0.03
516	603611	诺力股份	11,400	184,566.00	0.03
517	605001	威奥股份	33,800	184,210.00	0.03
518	605577	龙版传媒	20,800	183,248.00	0.03
519	600588	用友网络	19,900	182,682.00	0.03
520	600221	海航控股	135,300	182,655.00	0.03
521	601156	东航物流	11,300	182,156.00	0.03
522	600429	三元股份	44,600	180,184.00	0.03
523	688327	云从科技	14,351	178,813.46	0.03
524	603236	移远通信	3,420	175,001.40	0.03
525	688128	中国电器研	7,326	173,919.24	0.03

		究院			
526	603066	音飞储存	17,500	170,800.00	0.02
527	688311	盟升电子	6,497	170,156.43	0.02
528	600369	西南证券	42,100	169,242.00	0.02
529	603787	新日股份	18,600	169,074.00	0.02
530	600195	中牧股份	28,600	168,740.00	0.02
531	600529	山东药玻	9,100	167,895.00	0.02
532	600480	凌云股份	20,000	166,200.00	0.02
533	600300	维维股份	58,900	166,098.00	0.02
534	600572	康恩贝	42,200	165,424.00	0.02
535	688326	经纬恒润	2,328	165,008.64	0.02
536	600606	绿地控股	134,500	162,745.00	0.02
537	688318	财富趋势	2,265	161,517.15	0.02
538	603583	捷昌驱动	6,800	155,040.00	0.02
539	688590	新致软件	12,428	154,480.04	0.02
540	600325	华发股份	64,300	148,533.00	0.02
541	603511	爱慕股份	12,700	146,050.00	0.02
542	688382	益方生物科技	7,940	142,920.00	0.02
543	600866	星湖科技	31,500	138,285.00	0.02
544	688579	地纬智能	17,825	135,291.75	0.02
545	688435	英方软件	4,218	134,976.00	0.02
546	600764	中国海防	7,200	125,496.00	0.02
547	600438	通威股份	9,600	116,256.00	0.02
548	603185	弘元绿能	6,800	113,492.00	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	688797	臻宝科技	99	46,398.33	0.01
2	688811	有研金属复材	480	11,582.40	0.00
3	603407	长裕集团	72	5,289.12	0.00
4	603435	嘉德利	61	2,849.31	0.00
5	603293	埃泰克汽车电子	25	848.25	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	688256	寒武纪科技	14,761,406.39	3.74
2	600519	贵州茅台	5,575,552.00	1.41
3	688012	中微半导体设备	4,749,822.60	1.20
4	688008	澜起科技	4,377,132.13	1.11
5	688521	芯原微电子	4,144,415.87	1.05
6	603629	利通电子	3,789,459.00	0.96
7	688200	华峰测控	3,564,222.63	0.90
8	688515	裕太微电子	3,230,969.38	0.82
9	688188	上海柏楚电子科技	2,902,045.76	0.74
10	688519	南亚新材料	2,900,129.49	0.74
11	688027	科大国盾量子	2,819,232.63	0.72
12	603986	兆易创新	2,710,079.00	0.69
13	688002	睿创微纳	2,670,474.19	0.68
14	688041	海光信息	2,611,798.76	0.66
15	688213	思特威电子科技	2,460,033.97	0.62
16	688668	鼎通科技	2,368,343.02	0.60
17	688183	生益电子	2,188,010.13	0.55
18	688052	纳芯微电子	2,186,987.37	0.55
19	688981	中芯国际	2,083,703.63	0.53
20	603893	瑞芯微	2,076,213.00	0.53

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪科技	10,974,686.41	2.78
2	600519	贵州茅台	6,747,444.00	1.71
3	688008	澜起科技	6,159,825.70	1.56
4	688012	中微半导体设备	4,025,921.93	1.02
5	688002	睿创微纳	3,286,151.64	0.83
6	688041	海光信息	3,271,690.79	0.83
7	688521	芯原微电子	3,266,430.74	0.83
8	603893	瑞芯微	2,638,887.00	0.67
9	688200	华峰测控	2,608,808.96	0.66

10	688515	裕太微电子	2,461,398.13	0.62
11	688508	芯朋微电子	2,361,373.66	0.60
12	688183	生益电子	2,298,798.95	0.58
13	688261	东微半导体	2,273,179.70	0.58
14	688519	南亚新材料	2,168,743.50	0.55
15	688027	科大国盾量子	2,126,526.77	0.54
16	688188	上海柏楚电子科技	1,942,264.18	0.49
17	688202	美迪西生物医药	1,883,597.34	0.48
18	605499	东鹏饮料	1,867,822.00	0.47
19	603986	兆易创新	1,853,830.00	0.47
20	688439	振华风光	1,847,862.32	0.47

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	209,827,472.31
卖出股票收入（成交）总额	191,508,326.26

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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）	129,008.67	0.02
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	129,008.67	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	公允价值	占基金资产
----	------	------	----	------	-------

					净值比例 (%)
1	118069	爱科转债	550	55,004.82	0.01
2	113706	金帝转债	400	40,002.81	0.01
3	118072	鼎通转债	340	34,001.04	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、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、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	4,885.03
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,885.03

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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	688797	臻宝科技	46,398.33	0.01	新股流通受限
2	688811	有研金属复材	11,582.40	0.00	新股流通受限
3	603407	长裕集团	5,289.12	0.00	新股流通受限
4	603435	嘉德利	2,849.31	0.00	新股流通受限
5	603293	埃泰克汽车电子	848.25	0.00	新股流通受限

§ 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(%)
30,941	15,506.87	28,512,899.	5.94	451,285,101	94.06

		00		.00	
--	--	----	--	-----	--

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 11 月 22 日）基金份额总额	464,798,000.00
本报告期期初基金份额总额	287,798,000.00
本报告期基金总申购份额	999,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	807,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	479,798,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（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

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
银河证券	5	234,200,917.68	58.37	41,207.11	58.37	
国泰海通	4	88,766,183.95	22.12	15,616.61	22.12	
广发证券	1	27,567,809.69	6.87	4,849.06	6.87	
国信证券	2	20,339,951.94	5.07	3,579.17	5.07	

光大证券	1	11,888,833.03	2.96	2,091.45	2.96	
招商证券	4	10,999,608.70	2.74	1,934.92	2.74	
兴业证券	1	3,934,465.53	0.98	692.21	0.98	
中信建投证券	1	3,535,838.29	0.88	622.02	0.88	
长江证券	1	-	-	-	-	
东方证券	4	-	-	-	-	
东吴证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	
高盛中国	1	-	-	-	-	
国都证券	1	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国投证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
华鑫证券	3	-	-	-	-	
上海证券	1	-	-	-	-	
申万宏源证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
中金财富	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
中银国际	1	-	-	-	-	

注:此处的佣金指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券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

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		基金交易	
	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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
银河证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中金财 富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司,租用其交易单元。
- (2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限,需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。
- (6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估,根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商,与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内退租 1 家证券公司的 2 个交易单元:国新证券(上交所单元,深交所单元)。

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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加世纪证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 12 日

2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金公司为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 02 月 26 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加万和证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 公司网站, 上证报	2026 年 03 月 16 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2025 年度)	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 03 月 31 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 03 月 31 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 04 月 22 日
8	2025 年度汇添富基金管理股份有限公司以股东身份 (通过公募基金持股) 参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026 年 04 月 30 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛 (北京) 基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上证报	2026 年 06 月 06 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者超过 20%的情况

注: 无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日