

---

# 华富中证稀有金属主题交易型开放式指数 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 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              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 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        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 38        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 42        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 44        |
| 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      | 44        |
| 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   | 44        |
| 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   | 44        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 44        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 44        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 44        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 44        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 46        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 46        |
| 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 .....   | 46        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>46</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 46        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 47        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 47        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 47        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....   | 47        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 48        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>49</b> |
| 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 ..... | 49        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 50        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>50</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 50        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 50        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 50        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                          |
|--------------|--------------------------|
| 基金名称         | 华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 华富中证稀有金属主题 ETF           |
| 场内简称         | 稀金属                      |
| 基金主代码        | 561800                   |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                   |
| 基金合同生效日      | 2021 年 8 月 11 日          |
| 基金管理人        | 华富基金管理有限公司               |
| 基金托管人        | 交通银行股份有限公司               |
| 报告期末基金份额总额   | 201,577,226.00 份         |
| 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         | 2021 年 8 月 24 日          |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证稀有金属主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.20% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 投资策略 | <p>（一）股票投资策略本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.20%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>（二）股指期货投资策略在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。</p> <p>（三）债券投资策略本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，基于本基金流动性管理的</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>需要投资于政府债券、央行票据和金融债等固定收益类品种，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。此外，本基金可投资于可转换债券和可交换债券，因为可转换债券和可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，且具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券和可交换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。</p> <p>（四）资产支持证券投资策略本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>（五）参与转融通证券出借业务策略为更好的实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要，参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况、组合风险收益情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。若相关转融通证券出借业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准为中证稀有金属主题指数收益率。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证稀有金属主题指数，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          |      | 华富基金管理有限公司                         | 交通银行股份有限公司              |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 林之懿                                | 方圆                      |
|             | 联系电话 | 021-68886996                       | 95559                   |
|             | 电子邮箱 | linzy@hffund.com                   | fangy_20@bankcomm.com   |
| 客户服务电话      |      | 400-700-8001                       | 95559                   |
| 传真          |      | 021-68887997                       | 021-62701216            |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层  | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号       |
| 邮政编码        |      | 200120                             | 200336                  |
| 法定代表人       |      | 余海春                                | 任德奇                     |

2.4 信息披露方式

|                |         |
|----------------|---------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
|----------------|---------|

|                   |                       |
|-------------------|-----------------------|
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | http://www.hffund.com |
| 基金中期报告置备地点        | 基金管理人及基金托管人的办公场所      |

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       | 38,924,884.18                       |
| 本期利润          | 35,619,724.64                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1608                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 13.97%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | 24.27%                              |
| 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      | 46,251,429.08                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2294                              |
| 期末基金资产净值      | 247,828,655.08                      |
| 期末基金份额净值      | 1.2294                              |
| 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   | 22.94%                              |

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）以上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，开放式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    | 15.98%   | 2.68%       | 14.28%     | 2.69%         | 1.70% | -0.01% |
| 过去六个月    | 24.27%   | 2.75%       | 22.70%     | 2.76%         | 1.57% | -0.01% |
| 过去一年     | 112.04%  | 2.53%       | 109.16%    | 2.54%         | 2.88% | -0.01% |
| 过去三年     | 85.71%   | 2.10%       | 81.70%     | 2.11%         | 4.01% | -0.01% |
| 自基金合同生效起 | 22.94%   | 2.13%       | 20.14%     | 2.16%         | 2.80% | -0.03% |

|    |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 至今 |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|

注：本基金业绩比较基准=中证稀有金属主题指数收益率。

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

华富中证稀有金属主题ETF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



注：本基金建仓期为 2021 年 8 月 11 日到 2022 年 2 月 11 日，建仓期结束各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关约定。

§ 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

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用融资担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永

鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富成长企业精选股票型证券投资基金、华富中债-安徽省公司信用类债券指数证券投资基金、华富 63 个月定期开放债券型证券投资基金、华富安华债券型证券投资基金、华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金、华富新能源股票型发起式证券投资基金、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金、华富中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、华富安盈一年持有期债券型证券投资基金、华富吉丰 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富富惠一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、华富中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华富匠心明选一年持有期混合型证券投资基金、华富富鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华富安业一年持有期债券型证券投资基金、华富消费成长股票型证券投资基金、华富中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、华富时代锐选混合型证券投资基金、华富吉富 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、华富匠心领航 18 个月持有期混合型证券投资基金、华富数字经济混合型证券投资基金、华富荣盛一年持有期混合型证券投资基金、华富吉禄 90 天滚动持有债券型证券投资基金、华富泰合平衡 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华富恒享纯债债券型证券投资基金、华富恒惠纯债债券型证券投资基金、华富半导体产业混合型发起式证券投资基金、华富祥晖 6 个月持有期债券型证券投资基金、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金、华富鼎信 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、华富新华中诚信红利价值指数型证券投资基金、华富吉福 120 天滚动持有债券型证券投资基金、华富中证港股通创新药指数型发起式证券投资基金、华富华证沪深港汽车制造主题指数型发起式证券投资基金、华富祥康 12 个月持有期债券型证券投资基金、华富富润债券型证券投资基金、华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华富沪深 300 指数增强型证券投资基金、华富富源三个月持有期债券型证券投资基金、华富医疗

创新混合型发起式证券投资基金、华富中证 A500 指数型证券投资基金、华富安顺一年持有期债券型证券投资基金、华富福盛一年持有期混合型证券投资基金、华富安康三个月持有期债券型证券投资基金、华富安和债券型证券投资基金、华富富泽六个月持有期债券型证券投资基金、华富安颐九个月持有期债券型证券投资基金、华富裕诚一年持有期债券型证券投资基金、华富天华货币市场基金、华富淳信稳健 3 个月持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）、华富安沣债券型证券投资基金、华富淳丰保守养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）共九十只基金。

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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 李孝华 | 本基金基金经理、指数投资部权益指数经理 | 2021 年 8 月 11 日 | -    | 十二年    | 南开大学经济学硕士、硕士研究生学历。历任金瑞期货研究所贵金属研究员、国泰安信息技术有限公司量化投资平台设计与开发员、华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理助理。2019 年 10 月加入华富基金管理有限公司，曾任基金经理助理，自 2021 年 6 月 28 日起任华富中证证券公司先锋策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 8 月 11 日起任华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 17 日起任华富中小企业 100 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 5 日起任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 2 月 9 日起任华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2023 年 3 月 24 日起任华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2025 年 1 月 15 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 2 月 18 日起任华富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2025 年 4 月 29 日起任华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2025 年 5 月 7 日起任华富新华中诚信红利价值指数型证券投资基金基金经理，自 2025 年 6 月 10 日起任华富华证沪深港汽车制造主题指数型发起式证券投资基金基 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                               |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 金经理，自 2025 年 7 月 25 日起任华富中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2025 年 8 月 19 日起任华富中证 A500 指数型证券投资基金基金经理，具有基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

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

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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%的情形。

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 股市场经历了一轮“预期升温—外部扰动—风险修复—极致分化”的完整行情演绎。

2026 年一季度，市场整体“先扬后抑”。1 月在政策与流动性双重驱动下迎来“开门红”，上证指数一度突破 4100 点；2 月从普涨转向结构性分化，进入区间震荡；3 月受美以伊冲突爆发及霍尔木兹海峡风险骤升等地缘政治因素扰动，全球风险偏好急剧降温，A 股随之调整。当季上证

指数、沪深 300、科创 50 和创业板指分别下跌 1.94%、3.89%、6.54% 和 0.57%。

进入 2026 年二季度，随着美以伊冲突影响渐趋消退，全球风险偏好明显回升，主要指数录得可观涨幅，中证 A 股、沪深 300、中证 500 和中证 1000 分别上涨 12.1%、11.9%、18.56% 和 15.62%。然而，指数繁荣之下，结构分化达到极致：31 个申万一级行业中仅 6 个录得正收益，其中电子、通信、建筑材料和机械设备 4 个行业收益超过 2%，其余 25 个行业均告负，其中 13 个行业跌幅逾 10%，赚钱效应高度集中于少数方向。

本基金作为跟踪 CS 稀有金属指数的 ETF 基金产品，报告期间继续保持了对基准的紧密跟踪。受益于市场的整体回暖以及稀有金属权重品种战略资源地位及价格重心的抬升带来的基本面持续改善，CS 稀有金属指数整体表现较好，2026 年上半年上涨 22.7%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本期末，本基金份额净值为 1.2294 元，累计基金份额净值为 1.2294 元。报告期，本基金份额净值增长率为 24.27%，同期业绩比较基准收益率为 22.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年 A 股在外部地缘冲击与国内基本面韧性之间反复拉锯，指数层面先抑后扬，但收益分布非常不均。经过二季度的极致演绎后，市场短期已积蓄较强的风格再平衡需求。

华富中证稀有金属主题 ETF 作为市面首只跟踪稀有金属板块的 ETF 产品，未来将继续遵循合同约定，保持对基准指数的紧密跟踪。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，基金托管人在华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，华富基金管理有限公司在华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华富基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富中证稀有金属主题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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 1,035,906.52           | 802,154.16               |
| 结算备付金    |         | 714,973.86             | 421,068.77               |
| 存出保证金    |         | 71,151.24              | 80,293.38                |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 247,045,999.43         | 162,955,864.01           |
| 其中：股票投资  |         | 247,045,999.43         | 162,955,864.01           |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资 |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资    |         | -                      | -                        |
| 其他投资     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产   | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 应收清算款    |         | 706,461.46             | 2,332,872.34             |

|           |          |                   |                     |
|-----------|----------|-------------------|---------------------|
| 应收股利      |          | -                 | -                   |
| 应收申购款     |          | -                 | -                   |
| 递延所得税资产   |          | -                 | -                   |
| 其他资产      | 6.4.7.8  | 60,492.63         | -                   |
| 资产总计      |          | 249,634,985.14    | 166,592,252.66      |
| 负债和净资产    | 附注号      | 本期末<br>2026年6月30日 | 上年度末<br>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     |          | 556,438.40        | 1,949,921.84        |
| 应付赎回款     |          | -                 | -                   |
| 应付管理人报酬   |          | 99,791.94         | 73,909.85           |
| 应付托管费     |          | 19,958.40         | 14,781.95           |
| 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  | 1,130,141.32      | 742,364.63          |
| 负债合计      |          | 1,806,330.06      | 2,780,978.27        |
| 净资产:      |          |                   |                     |
| 实收基金      | 6.4.7.10 | 201,577,226.00    | 165,577,226.00      |
| 未分配利润     | 6.4.7.12 | 46,251,429.08     | -1,765,951.61       |
| 净资产合计     |          | 247,828,655.08    | 163,811,274.39      |
| 负债和净资产总计  |          | 249,634,985.14    | 166,592,252.66      |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2294 元，基金份额总额 201,577,226.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华富中证稀有金属主题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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|-----------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入   |          | 36,526,857.40                            | 9,267,275.55                                  |
| 1. 利息收入   |          | 3,277.66                                 | 833.39                                        |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 3,277.66                                 | 833.39                                        |
| 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）          |            | 38,224,561.09 | -2,483,876.32 |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14   | 37,239,819.33 | -3,111,899.66 |
| 基金投资收益                     |            | -             | -             |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.15   | -             | -             |
| 资产支持证券投资                   | 6.4.7.16   | -             | -             |
| 收益                         |            |               |               |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.17   | -             | -             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.18   | -             | -             |
| 股利收益                       | 6.4.7.19   | 984,741.76    | 628,023.34    |
| 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   | -3,305,159.54 | 11,743,033.92 |
| 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   | 1,604,178.19  | 7,284.56      |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 907,132.76    | 403,063.15    |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 625,859.46    | 216,603.96    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 125,171.88    | 43,320.80     |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -             | -             |
| 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   | 156,101.42    | 143,138.39    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 35,619,724.64 | 8,864,212.40  |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 35,619,724.64 | 8,864,212.40  |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 35,619,724.64 | 8,864,212.40  |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华富中证稀有金属主题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                                | 165,577,226.00                  | -      | -1,765,951.61  | 163,811,274.39  |
| 二、本期期初净资产                                | 165,577,226.00                  | -      | -1,765,951.61  | 163,811,274.39  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 36,000,000.00                   | -      | 48,017,380.69  | 84,017,380.69   |
| （一）、综合收益总额                               | -                               | -      | 35,619,724.64  | 35,619,724.64   |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>（净资产减少以“-”号填列）  | 36,000,000.00                   | -      | 12,397,656.05  | 48,397,656.05   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 345,500,000.00                  | -      | 61,562,726.17  | 407,062,726.17  |
| 2. 基金赎回款                                 | -309,500,000.00                 | -      | -49,165,070.12 | -358,665,070.12 |
| （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                                | 201,577,226.00                  | -      | 46,251,429.08  | 247,828,655.08  |
| 项目                                       | 上年度可比期间                         |        |                |                 |
|                                          | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |                |                 |
|                                          | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                                | 158,577,226.00                  | -      | -75,913,062.14 | 82,664,163.86   |
| 二、本期期初净资产                                | 158,577,226.00                  | -      | -75,913,062.14 | 82,664,163.86   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -7,000,000.00                   | -      | 12,221,198.71  | 5,221,198.71    |
| （一）、综合收益总额                               | -                               | -      | 8,864,212.40   | 8,864,212.40    |

|                                          |                |   |                |                |
|------------------------------------------|----------------|---|----------------|----------------|
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -7,000,000.00  | - | 3,356,986.31   | -3,643,013.69  |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 56,000,000.00  | - | -25,397,127.50 | 30,602,872.50  |
| 2. 基金赎回款                                 | -63,000,000.00 | - | 28,754,113.81  | -34,245,886.19 |
| (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                                | 151,577,226.00 | - | -63,691,863.43 | 87,885,362.57  |

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:

余海春

曹华玮

束庆斌

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

华富中证稀有金属主题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[2021]2236号《关于准予华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由华富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《华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 305,072,000.00 元(含募集股票市值),经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0785 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 305,077,226.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 5,226.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华富基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]360 号文审核同意,本基金于 2021 年 8 月 24 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等)、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%,股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为中证稀有金属主题指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照企业会计准则及其应用指南、准则解释及其他相关规定(包括《资产管理产品相关会计处理规定》)(以下统称企业会计准则)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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》《证券投资基金会计核算业务指引》基金合同和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

#### 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,同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作,真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净资产变动等有关信息。

#### 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1,035,906.52           |
| 等于：本金          | 1,035,635.05           |
| 加：应计利息         | 271.47                 |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 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         | -                      |
| 合计             | 1,035,906.52           |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |      |                |               |
|---------------|------------------------|------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 226,658,216.42         | -    | 247,045,999.43 | 20,387,783.01 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -    | -              | -             |
| 债券            | -                      | -    | -              | -             |
| 交易所市场         | -                      | -    | -              | -             |

|        |       |                |   |                |               |
|--------|-------|----------------|---|----------------|---------------|
|        | 银行间市场 | -              | - | -              | -             |
|        | 合计    | -              | - | -              | -             |
| 资产支持证券 |       | -              | - | -              | -             |
| 基金     |       | -              | - | -              | -             |
| 其他     |       | -              | - | -              | -             |
| 合计     |       | 226,658,216.42 | - | 247,045,999.43 | 20,387,783.01 |

注：股票投资的公允价值和公允价值变动均包含可退替代款估值增值。

#### 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。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 应收利息  | -                      |
| 其他应收款 | -                      |
| 待摊费用  | 60,492.63              |
| 合计    | 60,492.63              |

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>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      | 50,431.06              |
| 其中：交易所市场    | 50,431.06              |
| 银行间市场       | -                      |

|               |              |
|---------------|--------------|
| 应付利息          | -            |
| 应付审计费         | 24,795.19    |
| 应退替代款         | 965,490.71   |
| 应付信息披露费       | 59,507.37    |
| 应付 IOPV 计算发布费 | 29,916.99    |
| 合计            | 1,130,141.32 |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 165,577,226.00                        | 165,577,226.00  |
| 本期申购          | 345,500,000.00                        | 345,500,000.00  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -309,500,000.00                       | -309,500,000.00 |
| 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           | 201,577,226.00                        | 201,577,226.00  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 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           | 11,661,696.39  | -13,427,648.00 | -1,765,951.61  |
| 本期期初           | 11,661,696.39  | -13,427,648.00 | -1,765,951.61  |
| 本期利润           | 38,924,884.18  | -3,305,159.54  | 35,619,724.64  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 143,154.38     | 12,254,501.67  | 12,397,656.05  |
| 其中：基金申购款       | 53,380,151.60  | 8,182,574.57   | 61,562,726.17  |
| 基金赎回款          | -53,236,997.22 | 4,071,927.10   | -49,165,070.12 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 50,729,734.95  | -4,478,305.87  | 46,251,429.08  |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           |                                       |
| 活期存款利息收入  | 2,337.96                              |
| 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 | 788.32                                |

|    |          |
|----|----------|
| 其他 | 151.38   |
| 合计 | 3,277.66 |

注：“其他”包含结算保证金利息收入及认申购款利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>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 | 31,442,532.42              |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 5,797,286.91               |
| 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               | 37,239,819.33              |

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 215,607,303.50             |
| 减：卖出股票成本总额 | 183,941,712.97             |
| 减：交易费用     | 223,058.11                 |
| 买卖股票差价收入   | 31,442,532.42              |

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 358,665,070.12             |
| 减：现金支付赎回款总额 | 205,528,877.12             |
| 减：赎回股票成本总额  | 147,338,906.09             |
| 减：交易费用      | —                          |
| 赎回差价收入      | 5,797,286.91               |

##### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

##### 6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 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   | 984,741.76                      |
| 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            | 984,741.76                      |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -3,305,159.54                         |
| 股票投资                   | -3,305,159.54                         |
| 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                     | -3,305,159.54                         |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                     |
| 替代损益    | 1,604,178.19                          |
| 合计      | 1,604,178.19                          |

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 审计费用       | 24,795.19                             |
| 信息披露费      | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金    | -                                     |
| 中登服务费      | 59,507.37                             |
| 银行费用       | 2,374.50                              |
| IOPV 计算发布费 | 9,916.99                              |
| 合计         | 156,101.42                            |

6.4.7.20 分部报告

无。

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没有发生变化。

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         |
|--------------------|-----------------|
| 华富基金管理有限公司         | 基金管理人           |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”） | 基金托管人           |
| 华安证券股份有限公司（“华安证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                         |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例（%） | 成交金额                                       | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>（%） |
| 华安证券  | 25,941,652.20                         | 5.63                    | 44,926,318.63                              | 100.00                  |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                   |                   |              |                     |
|-------|----------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|       | 2026年1月1日至2026年6月30日 |                   |              |                     |
|       | 当期<br>佣金             | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 华安证券  | 4,823.16             | 5.63              | 3,356.11     | 6.65                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间              |                   |              |                     |
|       | 2025年1月1日至2025年6月30日 |                   |              |                     |
|       | 当期<br>佣金             | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 华安证券  | 8,355.18             | 100.00            | 2,808.69     | 100.00              |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费等费用后的净额列示。

2. 根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，本产品交易佣金仅用于支付向证券公司租用交易单元所产生的费用。

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                   | 上年度可比期间              |
|------------------|----------------------|----------------------|
|                  | 2026年1月1日至2026年6月30日 | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 625,859.46           | 216,603.96           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 96,921.22            | 21,804.40            |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 528,938.24           | 194,799.56           |

注：基金管理费按前一日基金资产净值0.5%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金管理费，E为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2026年1月1日至2026年6月30日 | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 125,171.88           | 43,320.80            |

注：基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法  $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金托管费，E为前一日基金资产净值）。

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

本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有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<br>2026 年 6 月 30 日 |                             | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                             |
|-------|------------------------|-----------------------------|--------------------------|-----------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例（%） | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例（%） |
| 华安证券  | 877,600.00             | 0.44                        | 500,000.00               | 0.30                        |

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |
|-------|---------------------------------------|----------|--------------------------------------------|--------|
|       | 期末余额                                  | 当期利息收入   | 期末余额                                       | 当期利息收入 |
| 交通银行  | 1,035,906.52                          | 2,337.96 | 655,211.62                                 | 699.61 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |       |                 |           |        |       |        |          |           |           |    |
|----------------------|-------|-----------------|-----------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称  | 成功认购日           | 受限期       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 001220               | 世盟股份  | 2026 年 1 月 27 日 | 6 个月      | 新股流通受限 | 28.00 | 27.78  | 47       | 1,316.00  | 1,305.66  | -  |
| 001237               | 惠康科技  | 2026 年 5 月 15 日 | 6 个月      | 新股流通受限 | 53.26 | 58.74  | 117      | 6,231.42  | 6,872.58  | -  |
| 001248               | 华润新能源 | 2026 年 6 月 24 日 | 6 个月      | 新股流通受限 | 10.11 | 10.11  | 8,007    | 80,950.77 | 80,950.77 | -  |
| 001248               | 华润新能源 | 2026 年 6 月 24 日 | 1-6 个月（含） | 新股流通受限 | 10.11 | 10.11  | 3,431    | 34,687.41 | 34,687.41 | -  |
| 001257               | 盛龙股份  | 2026 年 3 月 24 日 | 6 个月      | 新股流通受限 | 7.82  | 20.74  | 1,164    | 9,102.48  | 24,141.36 | -  |
| 001312               | 福恩股份  | 2026 年 4 月 14 日 | 6 个月      | 新股流通受限 | 18.38 | 16.78  | 100      | 1,838.00  | 1,678.00  | -  |
| 001365               | 天海电子  | 2026 年 5 月 11 日 | 6 个月      | 新股流通受限 | 27.19 | 31.31  | 271      | 7,368.49  | 8,485.01  | -  |
| 001393               | 维通利   | 2026 年 5 月 8 日  | 6 个月      | 新股流通受限 | 30.38 | 38.99  | 198      | 6,015.24  | 7,720.02  | -  |
| 001399               | 惠科    | 2026 年 6 月      | 6 个月      | 新股流通   | 10.12 | 27.73  | 1,194    | 12,083.28 | 33,109.62 | -  |

|        |      |                  |      |        |       |        |     |           |            |   |
|--------|------|------------------|------|--------|-------|--------|-----|-----------|------------|---|
|        | 股份   | 月 16 日           |      | 受限     |       |        |     |           |            |   |
| 301513 | 尚水智能 | 2026 年 4 月 10 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.66 | 50.96  | 138 | 3,679.08  | 7,032.48   | - |
| 301531 | 春光集团 | 2026 年 4 月 28 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 13.30 | 51.56  | 290 | 3,857.00  | 14,952.40  | - |
| 301599 | 理奇智能 | 2026 年 4 月 22 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 13.91 | 32.47  | 350 | 4,868.50  | 11,364.50  | - |
| 301666 | 大普微  | 2026 年 4 月 8 日   | 6 个月 | 新股流通受限 | 46.08 | 463.33 | 436 | 20,090.88 | 202,011.88 | - |
| 301669 | 高特电子 | 2026 年 6 月 2 日   | 6 个月 | 新股流通受限 | 7.08  | 28.40  | 500 | 3,540.00  | 14,200.00  | - |
| 301680 | 固德电材 | 2026 年 2 月 27 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 58.00 | 112.16 | 74  | 4,292.00  | 8,299.84   | - |
| 301682 | 宏明电子 | 2026 年 3 月 18 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 69.66 | 160.06 | 276 | 19,226.16 | 44,176.56  | - |
| 301687 | 新广益  | 2025 年 12 月 24 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 21.93 | 77.78  | 136 | 2,982.48  | 10,578.08  | - |
| 301696 | 三瑞智能 | 2026 年 3 月 31 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 24.68 | 86.80  | 171 | 4,220.28  | 14,842.80  | - |
| 601112 | 振石股份 | 2026 年 1 月 21 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 11.18 | 17.59  | 169 | 1,889.42  | 2,972.71   | - |
| 603284 | 林平   | 2026 年 2         | 6 个月 | 新股流通   | 37.88 | 34.87  | 36  | 1,363.68  | 1,255.32   | - |

|        |      |                 |      |        |       |          |       |           |            |   |
|--------|------|-----------------|------|--------|-------|----------|-------|-----------|------------|---|
|        | 发展   | 月 3 日           |      | 受限     |       |          |       |           |            |   |
| 603293 | 埃泰克  | 2026 年 4 月 9 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 33.49 | 33.93    | 51    | 1,707.99  | 1,730.43   | - |
| 603352 | 至信股份 | 2026 年 1 月 8 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 21.88 | 25.52    | 56    | 1,225.28  | 1,429.12   | - |
| 603435 | 嘉德利  | 2026 年 5 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 15.76 | 46.71    | 104   | 1,639.04  | 4,857.84   | - |
| 603459 | 红板科技 | 2026 年 3 月 31 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 17.70 | 84.32    | 177   | 3,132.90  | 14,924.64  | - |
| 688635 | 长进光子 | 2026 年 5 月 20 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 40.98 | 308.19   | 116   | 4,753.68  | 35,750.04  | - |
| 688781 | 视涯科技 | 2026 年 3 月 18 日 | 9 个月 | 新股流通受限 | 22.68 | 42.16    | 2,738 | 62,097.84 | 115,434.08 | - |
| 688808 | 联讯仪器 | 2026 年 4 月 16 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 81.88 | 1,584.33 | 70    | 5,731.60  | 110,903.10 | - |
| 688811 | 有研新材 | 2026 年 4 月 1 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 6.41  | 24.13    | 834   | 5,345.94  | 20,124.42  | - |
| 688813 | 泰金新能 | 2026 年 3 月 24 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.28 | 172.09   | 213   | 5,597.64  | 36,655.17  | - |
| 688816 | 易思维  | 2026 年 2 月 4 日  | 6 个月 | 新股流通受限 | 55.95 | 57.10    | 74    | 4,140.30  | 4,225.40   | - |
| 688820 | 盛合   | 2026 年 4        | 6 个月 | 新股流通   | 19.68 | 141.49   | 400   | 7,872.00  | 56,596.00  | - |

|  |        |           |  |    |  |  |  |  |  |  |
|--|--------|-----------|--|----|--|--|--|--|--|--|
|  | 晶<br>微 | 月 13<br>日 |  | 受限 |  |  |  |  |  |  |
|--|--------|-----------|--|----|--|--|--|--|--|--|

注：实际可流通日以该证券公告为准。本报告期间若有除权，认购价格为除权后价格，数量为期末实际持有数量。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无未到期交易所市场债券正回购。

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面临的風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。本基金管理人已建立董事會領導下的架構清晰、控制有效、系統全面、切實可行的風險控制體系，並設定適當的風險限額及內部控制流程，通過可靠的管理及信息系統持續監控上述各類風險。

董事會下設風險管理委員會，負責對公司風險管理制度進行審查並提供諮詢和建議。總經理下設投資決策委員會和風險控制委員會，負責對公司经营及基金運作中的風險進行研究、評估和監控。公司設督察長，組織、指導公司監察稽核工作，監督檢查基金及公司運作的合法合規情況和公司的內部風險控制情況。公司設有獨立的风险管理部、監察稽核部，對公司各部門內部風險控制制度的建立和落實情況進行檢查，對公司的內部風險控制制度的合理性、有效性進行分析，提出改進意見，上報總經理，通報督察長。

6.4.13.2 信用風險

信用風險是指基金在交易過程中因交易對手未履行合約責任，或者基金所投資證券之發行人出現違約、拒絕支付到期本息等情況，導致基金資產損失和收益變化的風險。

本基金的基金管理人在交易前對交易對手的資信狀況進行了充分的評估。本基金的銀行存款均存放於信用良好的銀行，因而與銀行存款相關的信用風險不重大。本基金在交易所進行的交易均以中國證券登記結算有限責任公司為交易對手完成證券交收和款項清算，違約可能性很小；在銀行間同業市場進行交易前均對交易對手進行信用評估並對證券交割方式進行限制以控制相應的信用

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

本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的债券

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末和上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的债券

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 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《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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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未来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<br>2026年6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              | 1,035,906.52 | -     | -      | -    | -    | -              | 1,035,906.52   |
| 结算备付金             | 714,973.86   | -     | -      | -    | -    | -              | 714,973.86     |
| 存出保证金             | 71,151.24    | -     | -      | -    | -    | -              | 71,151.24      |
| 交易性金融资产           | -            | -     | -      | -    | -    | 247,045,999.43 | 247,045,999.43 |
| 衍生金融资产            | -            | -     | -      | -    | -    | -              | -              |
| 买入返售金融资产          | -            | -     | -      | -    | -    | -              | -              |
| 债权投资              | -            | -     | -      | -    | -    | -              | -              |
| 应收股利              | -            | -     | -      | -    | -    | -              | -              |
| 应收申购款             | -            | -     | -      | -    | -    | -              | -              |
| 应收清算款             | -            | -     | -      | -    | -    | 706,461.46     | 706,461.46     |
| 其他资产              | -            | -     | -      | -    | -    | 60,492.63      | 60,492.63      |
| 资产总计              | 1,822,031.62 | -     | -      | -    | -    | 247,812,953.52 | 249,634,985.14 |
| 负债                |              |       |        |      |      |                |                |
| 应付赎回款             | -            | -     | -      | -    | -    | -              | -              |
| 应付管理人报酬           | -            | -     | -      | -    | -    | 99,791.94      | 99,791.94      |
| 应付托管费             | -            | -     | -      | -    | -    | 19,958.40      | 19,958.40      |
| 应付清算款             | -            | -     | -      | -    | -    | 556,438.40     | 556,438.40     |
| 卖出回购金融资产款         | -            | -     | -      | -    | -    | -              | -              |
| 应付销售服务费           | -            | -     | -      | -    | -    | -              | -              |

|                          |              |        |          |       |       |                |                |
|--------------------------|--------------|--------|----------|-------|-------|----------------|----------------|
| 应付投资顾问费                  | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应付利润                     | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应交税费                     | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 其他负债                     | -            | -      | -        | -     | -     | 1,130,141.32   | 1,130,141.32   |
| 负债总计                     | -            | -      | -        | -     | -     | 1,806,330.06   | 1,806,330.06   |
| 利率敏感度缺口                  | 1,822,031.62 | -      | -        | -     | -     | 246,006,623.46 | 247,828,655.08 |
| 上年度末<br>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                     | 802,154.16   | -      | -        | -     | -     | -              | 802,154.16     |
| 结算备付金                    | 421,068.77   | -      | -        | -     | -     | -              | 421,068.77     |
| 存出保证金                    | 80,293.38    | -      | -        | -     | -     | -              | 80,293.38      |
| 交易性金融资产                  | -            | -      | -        | -     | -     | 162,955,864.01 | 162,955,864.01 |
| 衍生金融资产                   | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 买入返售金融资产                 | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 债权投资                     | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应收股利                     | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应收申购款                    | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应收清算款                    | -            | -      | -        | -     | -     | 2,332,872.34   | 2,332,872.34   |
| 其他资产                     | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 资产总计                     | 1,303,516.31 | -      | -        | -     | -     | 165,288,736.35 | 166,592,252.66 |
| 负债                       |              |        |          |       |       |                |                |
| 应付赎回款                    | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应付管理人报酬                  | -            | -      | -        | -     | -     | 73,909.85      | 73,909.85      |
| 应付托管费                    | -            | -      | -        | -     | -     | 14,781.95      | 14,781.95      |
| 应付清算款                    | -            | -      | -        | -     | -     | 1,949,921.84   | 1,949,921.84   |
| 卖出回购金融资产款                | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应付销售服务费                  | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应付投资顾问费                  | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |
| 应付利润                     | -            | -      | -        | -     | -     | -              | -              |

|         |              |   |   |   |   |                |                |
|---------|--------------|---|---|---|---|----------------|----------------|
| 应交税费    | -            | - | - | - | - | -              | -              |
| 其他负债    | -            | - | - | - | - | 742,364.63     | 742,364.63     |
| 负债总计    | -            | - | - | - | - | 2,780,978.27   | 2,780,978.27   |
| 利率敏感度缺口 | 1,303,516.31 | - | - | - | - | 162,507,758.08 | 163,811,274.39 |

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净值无重大影响（上期末：同）。

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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.20%，年跟踪误差不超过 2%。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

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<br>2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 247,045,999.43         | 99.68            | 162,955,864.01           | 99.48            |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -                | -                        | -                |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                      | -                | -                        | -                |
| 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     | 247,045,999.43 | 99.68 | 162,955,864.01 | 99.48 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                       |                             |                   |
|----|-----------------------|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 1. 除业绩比较基准外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） |
|    | 业绩比较基准上升百分之五          | 12,537,605.07               | 8,045,699.11      |
|    | 业绩比较基准下降百分之五          | -12,537,605.07              | -8,045,699.11     |

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<br>2026年6月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 246,112,732.19    | 162,809,633.99      |
| 第二层次          | 115,638.18        | -                   |
| 第三层次          | 817,629.06        | 146,230.02          |
| 合计            | 247,045,999.43    | 162,955,864.01      |

#### 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证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证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，确定相关证券的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

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 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应收款项和其他金融负债，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

无。

## § 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              | 247,045,999.43 | 98.96         |
|    | 其中：股票             | 247,045,999.43 | 98.96         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -             |
|    | 其中：债券             | -              | -             |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,750,880.38   | 0.70          |
| 8  | 其他各项资产            | 838,105.33     | 0.34          |
| 9  | 合计                | 249,634,985.14 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|---------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -       | -             |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| B | 采矿业              | 37,257,904.70  | 15.03 |
| C | 制造业              | 206,428,609.97 | 83.29 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,332,506.00   | 0.94  |
| 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               | 246,019,020.67 | 99.27 |

### 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              | 24,141.36  | 0.01         |
| C  | 制造业              | 877,876.78 | 0.35         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 115,638.18 | 0.05         |
| E  | 建筑业              | —          | —            |
| F  | 批发和零售业           | —          | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,305.66   | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —          | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —          | —            |
| J  | 金融业              | —          | —            |

|   |               |              |      |
|---|---------------|--------------|------|
| K | 房地产业          | -            | -    |
| L | 租赁和商务服务业      | -            | -    |
| M | 科学研究和技术服务业    | 8,016.78     | 0.00 |
| 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            | 1,026,978.76 | 0.41 |

### 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  | 603993 | 洛阳钼业 | 1,324,614 | 23,246,975.70 | 9.38         |
| 2  | 600111 | 北方稀土 | 386,900   | 18,590,545.00 | 7.50         |
| 3  | 000792 | 盐湖股份 | 483,300   | 14,590,827.00 | 5.89         |
| 4  | 600549 | 厦门钨业 | 168,100   | 14,322,120.00 | 5.78         |
| 5  | 000657 | 中钨高新 | 138,620   | 13,268,706.40 | 5.35         |
| 6  | 002460 | 赣锋锂业 | 172,017   | 11,249,911.80 | 4.54         |
| 7  | 603799 | 华友钴业 | 230,314   | 11,114,953.64 | 4.48         |
| 8  | 002466 | 天齐锂业 | 157,500   | 9,657,900.00  | 3.90         |
| 9  | 002428 | 云南锗业 | 79,100    | 9,506,238.00  | 3.84         |
| 10 | 300390 | 天华新能 | 88,410    | 8,267,219.10  | 3.34         |
| 11 | 002738 | 中矿资源 | 110,076   | 6,493,383.24  | 2.62         |
| 12 | 000960 | 锡业股份 | 149,600   | 6,386,424.00  | 2.58         |
| 13 | 600392 | 盛和资源 | 211,800   | 6,305,286.00  | 2.54         |
| 14 | 000831 | 中国稀土 | 112,785   | 6,258,439.65  | 2.53         |
| 15 | 600206 | 有研新材 | 89,700    | 5,974,020.00  | 2.41         |
| 16 | 002240 | 盛新锂能 | 111,500   | 4,998,545.00  | 2.02         |
| 17 | 000962 | 东方钨业 | 47,100    | 4,267,260.00  | 1.72         |
| 18 | 688122 | 西部超导 | 67,843    | 4,261,218.83  | 1.72         |
| 19 | 601958 | 金钼股份 | 143,100   | 4,022,541.00  | 1.62         |
| 20 | 002056 | 横店东磁 | 123,100   | 3,752,088.00  | 1.51         |
| 21 | 600259 | 中稀有色 | 35,200    | 3,576,672.00  | 1.44         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 22 | 002497 | 雅化集团 | 175,200 | 3,568,824.00 | 1.44 |
| 23 | 000060 | 中金岭南 | 468,400 | 3,545,788.00 | 1.43 |
| 24 | 300811 | 铂科新材 | 37,152  | 3,525,353.28 | 1.42 |
| 25 | 002756 | 永兴材料 | 57,180  | 3,238,675.20 | 1.31 |
| 26 | 300748 | 金力永磁 | 104,100 | 3,211,485.00 | 1.30 |
| 27 | 002378 | 章源钨业 | 91,330  | 3,057,728.40 | 1.23 |
| 28 | 603663 | 三祥新材 | 31,600  | 3,043,080.00 | 1.23 |
| 29 | 002149 | 西部材料 | 51,700  | 2,792,317.00 | 1.13 |
| 30 | 002192 | 融捷股份 | 31,200  | 2,789,280.00 | 1.13 |
| 31 | 600961 | 株冶集团 | 80,600  | 2,610,634.00 | 1.05 |
| 32 | 002176 | 江特电机 | 255,700 | 2,559,557.00 | 1.03 |
| 33 | 000629 | 钒钛股份 | 698,400 | 2,332,656.00 | 0.94 |
| 34 | 000155 | 川能动力 | 194,700 | 2,332,506.00 | 0.94 |
| 35 | 000970 | 中科三环 | 145,255 | 2,206,423.45 | 0.89 |
| 36 | 002167 | 东方锆业 | 92,900  | 2,050,303.00 | 0.83 |
| 37 | 600366 | 宁波韵升 | 115,300 | 1,692,604.00 | 0.68 |
| 38 | 000762 | 西藏矿业 | 62,900  | 1,679,430.00 | 0.68 |
| 39 | 001280 | 中国铀业 | 20,600  | 1,374,020.00 | 0.55 |
| 40 | 600456 | 宝钛股份 | 43,200  | 1,181,520.00 | 0.48 |
| 41 | 300224 | 正海磁材 | 85,300  | 1,137,049.00 | 0.46 |
| 42 | 600478 | 科力远  | 199,100 | 1,003,464.00 | 0.40 |
| 43 | 002057 | 中钢天源 | 80,200  | 996,886.00   | 0.40 |
| 44 | 000795 | 英洛华  | 98,100  | 848,565.00   | 0.34 |
| 45 | 688190 | 云路股份 | 7,146   | 648,213.66   | 0.26 |
| 46 | 002978 | 安宁股份 | 22,200  | 568,986.00   | 0.23 |
| 47 | 603072 | 天和磁材 | 14,100  | 552,720.00   | 0.22 |
| 48 | 300127 | 银河磁体 | 19,500  | 545,025.00   | 0.22 |
| 49 | 301622 | 英思特  | 9,400   | 442,740.00   | 0.18 |
| 50 | 688750 | 金天钛业 | 22,364  | 371,913.32   | 0.15 |

### 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  | 301666 | 大普微   | 436    | 202,011.88 | 0.08         |
| 2  | 001248 | 华润新能源 | 11,438 | 115,638.18 | 0.05         |
| 3  | 688781 | 视涯科技  | 2,738  | 115,434.08 | 0.05         |
| 4  | 688808 | 联讯仪器  | 70     | 110,903.10 | 0.04         |
| 5  | 001399 | 惠科股份  | 2,984  | 101,451.82 | 0.04         |
| 6  | 688820 | 盛合晶微  | 400    | 56,596.00  | 0.02         |
| 7  | 301682 | 宏明电子  | 276    | 44,176.56  | 0.02         |
| 8  | 688813 | 泰金新能  | 213    | 36,655.17  | 0.01         |
| 9  | 688635 | 长进光子  | 116    | 35,750.04  | 0.01         |
| 10 | 001257 | 盛龙股份  | 1,164  | 24,141.36  | 0.01         |
| 11 | 688811 | 有研复材  | 834    | 20,124.42  | 0.01         |

|    |        |      |     |           |      |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 12 | 301531 | 春光集团 | 290 | 14,952.40 | 0.01 |
| 13 | 603459 | 红板科技 | 177 | 14,924.64 | 0.01 |
| 14 | 301696 | 三瑞智能 | 171 | 14,842.80 | 0.01 |
| 15 | 301669 | 高特电子 | 500 | 14,200.00 | 0.01 |
| 16 | 301599 | 理奇智能 | 350 | 11,364.50 | 0.00 |
| 17 | 301687 | 新广益  | 136 | 10,578.08 | 0.00 |
| 18 | 301667 | 纳百川  | 139 | 10,052.48 | 0.00 |
| 19 | 001365 | 天海电子 | 271 | 8,485.01  | 0.00 |
| 20 | 301680 | 固德电材 | 74  | 8,299.84  | 0.00 |
| 21 | 001393 | 维通利  | 198 | 7,720.02  | 0.00 |
| 22 | 301513 | 尚水智能 | 138 | 7,032.48  | 0.00 |
| 23 | 001237 | 惠康科技 | 117 | 6,872.58  | 0.00 |
| 24 | 301449 | 天溯计量 | 144 | 5,572.80  | 0.00 |
| 25 | 603435 | 嘉德利  | 104 | 4,857.84  | 0.00 |
| 26 | 688816 | 易思维  | 74  | 4,225.40  | 0.00 |
| 27 | 001369 | 双欣材料 | 281 | 3,799.12  | 0.00 |
| 28 | 603248 | 锡华科技 | 166 | 3,500.94  | 0.00 |
| 29 | 601112 | 振石股份 | 169 | 2,972.71  | 0.00 |
| 30 | 001396 | 誉帆科技 | 69  | 2,443.98  | 0.00 |
| 31 | 603293 | 埃泰克  | 51  | 1,730.43  | 0.00 |
| 32 | 001312 | 福恩股份 | 100 | 1,678.00  | 0.00 |
| 33 | 603352 | 至信股份 | 56  | 1,429.12  | 0.00 |
| 34 | 001220 | 世盟股份 | 47  | 1,305.66  | 0.00 |
| 35 | 603284 | 林平发展 | 36  | 1,255.32  | 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  | 000792 | 盐湖股份 | 28,362,689.50 | 17.31          |
| 2  | 002460 | 赣锋锂业 | 20,082,679.15 | 12.26          |
| 3  | 002466 | 天齐锂业 | 16,971,028.41 | 10.36          |
| 4  | 002738 | 中矿资源 | 16,367,209.80 | 9.99           |
| 5  | 000657 | 中钨高新 | 13,254,708.13 | 8.09           |
| 6  | 000831 | 中国稀土 | 11,677,120.40 | 7.13           |
| 7  | 000960 | 锡业股份 | 11,278,087.22 | 6.88           |
| 8  | 300390 | 天华新能 | 9,603,382.10  | 5.86           |
| 9  | 002240 | 盛新锂能 | 9,120,864.20  | 5.57           |
| 10 | 002428 | 云南锗业 | 8,946,740.00  | 5.46           |
| 11 | 300748 | 金力永磁 | 7,505,042.47  | 4.58           |
| 12 | 002497 | 雅化集团 | 6,874,015.40  | 4.20           |
| 13 | 300811 | 铂科新材 | 6,778,079.00  | 4.14           |
| 14 | 000060 | 中金岭南 | 6,321,951.00  | 3.86           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 15 | 002192 | 融捷股份 | 5,090,254.72 | 3.11 |
| 16 | 000155 | 川能动力 | 4,827,411.72 | 2.95 |
| 17 | 002056 | 横店东磁 | 4,714,483.40 | 2.88 |
| 18 | 002176 | 江特电机 | 4,625,643.00 | 2.82 |
| 19 | 002756 | 永兴材料 | 4,465,718.00 | 2.73 |
| 20 | 000629 | 钒钛股份 | 4,446,029.00 | 2.71 |
| 21 | 002378 | 章源钨业 | 4,319,018.00 | 2.64 |
| 22 | 000762 | 西藏矿业 | 4,292,546.00 | 2.62 |
| 23 | 002149 | 西部材料 | 3,801,738.74 | 2.32 |
| 24 | 000970 | 中科三环 | 3,790,165.00 | 2.31 |
| 25 | 000962 | 东方钽业 | 3,728,201.00 | 2.28 |

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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  | 000792 | 盐湖股份 | 25,054,067.41 | 15.29          |
| 2  | 002460 | 赣锋锂业 | 18,193,870.00 | 11.11          |
| 3  | 002466 | 天齐锂业 | 15,383,652.14 | 9.39           |
| 4  | 002738 | 中矿资源 | 13,896,743.75 | 8.48           |
| 5  | 000657 | 中钨高新 | 11,815,100.94 | 7.21           |
| 6  | 000831 | 中国稀土 | 10,142,547.80 | 6.19           |
| 7  | 000960 | 锡业股份 | 9,562,385.00  | 5.84           |
| 8  | 300390 | 天华新能 | 9,523,988.40  | 5.81           |
| 9  | 002428 | 云南锗业 | 8,915,768.51  | 5.44           |
| 10 | 002240 | 盛新锂能 | 8,400,389.24  | 5.13           |
| 11 | 300748 | 金力永磁 | 6,405,757.00  | 3.91           |
| 12 | 300811 | 铂科新材 | 6,297,799.00  | 3.84           |
| 13 | 002497 | 雅化集团 | 6,064,343.00  | 3.70           |
| 14 | 000060 | 中金岭南 | 5,361,038.00  | 3.27           |
| 15 | 002192 | 融捷股份 | 4,856,698.00  | 2.96           |
| 16 | 000155 | 川能动力 | 4,456,334.00  | 2.72           |
| 17 | 002056 | 横店东磁 | 4,250,676.07  | 2.59           |
| 18 | 002176 | 江特电机 | 4,225,528.00  | 2.58           |
| 19 | 002756 | 永兴材料 | 4,099,413.00  | 2.50           |
| 20 | 000762 | 西藏矿业 | 3,901,066.83  | 2.38           |
| 21 | 000629 | 钒钛股份 | 3,828,150.00  | 2.34           |
| 22 | 002378 | 章源钨业 | 3,825,297.00  | 2.34           |
| 23 | 002149 | 西部材料 | 3,501,023.00  | 2.14           |
| 24 | 000962 | 东方钽业 | 3,295,539.00  | 2.01           |
| 25 | 000970 | 中科三环 | 3,282,927.00  | 2.00           |

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

### 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 | 246,490,540.52 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 215,607,303.50 |

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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

#### 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，中国北方稀土(集团)高科技股份有限公司曾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。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | 71,151.24  |
| 2  | 应收清算款 | 706,461.46 |
| 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  | 60,492.63  |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 838,105.33 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|-------|-------------|--------------|----------|
| 1  | 301666 | 大普微   | 202,011.88  | 0.08         | 新股流通受限   |
| 2  | 001248 | 华润新能源 | 115,638.18  | 0.05         | 新股流通受限   |
| 3  | 688781 | 视涯科技  | 115,434.08  | 0.05         | 新股流通受限   |
| 4  | 688808 | 联讯仪器  | 110,903.10  | 0.04         | 新股流通受限   |
| 5  | 001399 | 惠科股份  | 33,109.62   | 0.01         | 新股流通受限   |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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 (%) |
| 10,168       | 19,824.67     | 33,097,623.00 | 16.42      | 168,479,603.00 | 83.58      |

### 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 | 0.00       | 0.0000       |

注：本报告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                  |

注：本期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本开放式基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                |
|----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2021 年 8 月 11 日) 基金份额总额 | 305,077,226.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 165,577,226.00 |
| 本报告期基金总申购份额                      | 345,500,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 309,500,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额                     | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                     | 201,577,226.00 |

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

本报告期内未召开持有人大会。

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

本报告期内，基金管理人重大人事变动情况如下：

2026 年 3 月 27 日，经公司董事会审议批准，由公司总经理曹华玮先生代为履行督察长职务，代行期限不超过六个月。

2026 年 6 月 30 日，经公司董事会审议批准，免去尹培俊先生公司副总经理职务。

报告期内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

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

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，本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

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

本报告期内，管理人不存在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

本报告期内，管理人相关从业人员不存在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，托管人不存在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不存在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 (%) |    |
| 国信证券 | 1      | 434,987,774.98 | 94.37            | 80,870.01 | 94.37          | -  |
| 华安证券 | 4      | 25,941,652.20  | 5.63             | 4,823.16  | 5.63           | -  |

注：1）根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称“规定”）（证监会公告[2024]3 号），我公司在综合比较多家证券经营机构的财务状况、经营状况后，选择了财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易服务能力较强的券商租用了基金专用交易单元进行证券投资或委托证券公司办理证券投资。

2）我公司自 2024 年 7 月 1 日起执行法规关于佣金比例的规定，本产品本报告期内佣金比例符合法规有关要求。

3）此处的佣金指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券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

4）本报告期本基金租用券商交易单元无变更。

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(%) |
| 国信证券 | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 华安证券 | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |

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  | 华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 1 月 22 日 |
| 2  | 华富基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告      | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 1 月 22 日 |
| 3  | 华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新      | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 3 月 6 日  |
| 4  | 关于华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金变更基金扩位简称的公告   | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 3 月 6 日  |
| 5  | 华富基金管理有限公司关于总经理代为履行督察长职务的公告             | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2026 年 3 月 28 日 |
| 6  | 华富基金管理有限公司旗下基金 2025                     | 中国证监会基金电子披            | 2026 年 3 月 31 日 |

|    |                                                    |                               |                 |
|----|----------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|
|    | 年年度报告提示性公告                                         | 露网站及基金管理人网<br>站               |                 |
| 7  | 华富基金管理有限公司旗下公募基金<br>通过证券公司证券交易及佣金支付情<br>况（2025 年度） | 中国证监会基金电子披<br>露网站及基金管理人网<br>站 | 2026 年 3 月 31 日 |
| 8  | 华富中证稀有金属主题交易型开放式<br>指数证券投资基金 2025 年年度报告            | 中国证监会基金电子披<br>露网站及基金管理人网<br>站 | 2026 年 3 月 31 日 |
| 9  | 华富基金管理有限公司关于终止浦领<br>基金销售有限公司办理相关销售业务<br>的公告        | 中国证监会基金电子披<br>露网站及基金管理人网<br>站 | 2026 年 4 月 22 日 |
| 10 | 华富中证稀有金属主题交易型开放式<br>指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报<br>告    | 中国证监会基金电子披<br>露网站及基金管理人网<br>站 | 2026 年 4 月 22 日 |
| 11 | 华富基金管理有限公司旗下基金 2026<br>年第 1 季度报告提示性公告              | 中国证监会基金电子披<br>露网站及基金管理人网<br>站 | 2026 年 4 月 22 日 |
| 12 | 公募基金管理人华富基金管理有限公<br>司对外行使投票表决权（2025 年度）<br>情况信息披露  | 中国证监会基金电子披<br>露网站及基金管理人网<br>站 | 2026 年 4 月 23 日 |
| 13 | 华富基金管理有限公司旗下部分 ETF<br>增加一级交易商的公告                   | 中国证监会基金电子披<br>露网站及基金管理人网<br>站 | 2026 年 5 月 28 日 |
| 14 | 华富基金管理有限公司旗下 ETF 增加<br>一级交易商的公告                    | 中国证监会基金电子披<br>露网站及基金管理人网<br>站 | 2026 年 6 月 11 日 |
| 15 | 华富基金管理有限公司旗下 ETF 增加<br>一级交易商的公告                    | 中国证监会基金电子披<br>露网站及基金管理人网<br>站 | 2026 年 6 月 17 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者<br>类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                     |          |          |          | 报告期末持有基金情况 |                 |
|-----------|----------------|-------------------------------------|----------|----------|----------|------------|-----------------|
|           | 序号             | 持有基金份额<br>比例达到或者<br>超过 20%的时<br>间区间 | 期初<br>份额 | 申购<br>份额 | 赎回<br>份额 | 持有份额       | 份额<br>占比<br>(%) |
| 机构        | -              | -                                   | -        | -        | -        | -          | -               |
| 个人        | -              | -                                   | -        | -        | -        | -          | -               |
| -         | -              | -                                   | -        | -        | -        | -          | -               |
| 产品特有风险    |                |                                     |          |          |          |            |                 |
| 无         |                |                                     |          |          |          |            |                 |

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 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、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 4、报告期内华富中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 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, 相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日