

汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金 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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
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.....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
§ 5 托管人报告.....	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
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.....	22
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	22
6.1 资产负债表.....	22
6.2 利润表.....	23
6.3 净资产变动表.....	25
6.4 报表附注.....	26
§ 7 投资组合报告.....	52
7.1 期末基金资产组合情况.....	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76
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.....	77
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.....	77
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.....	77

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.....	77
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	77
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
7.12 投资组合报告附注.....	78
§ 8 基金份额持有人信息.....	79
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	79
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	79
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.....	79
§ 9 开放式基金份额变动.....	80
§ 10 重大事件揭示.....	80
10.1 基金份额持有人大会决议.....	80
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.....	80
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
10.4 基金投资策略的改变.....	80
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	81
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.....	81
10.8 其他重大事件.....	82
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
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.....	83
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§ 12 备查文件目录.....	83
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点.....	84
12.3 查阅方式.....	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富国证 2000 指数增强	
基金主代码	019318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 11 月 07 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	1,479,909,154.56	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富国证 2000 指数增强 A	汇添富国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019318	019319
报告期末下属分级基金的份 额总额（份）	1,077,822,392.48	402,086,762.08

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以国证 2000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.00%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；股票投资策略；存托凭证的投资策略；债券投资策略；可转债及可交换债投资策略；资产支持证券投资策略；股指期货投资策略；国债期货投资策略；股票期权投资策略；融资投资策略及参与转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率（税后）× 5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，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。

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	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	韩鑫普
	联系电话	021-28932888	0755-82943666

	电子邮箱	service@99fund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95565
传真		021-28932998	0755-82960794
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码		200010	518000
法定代表人		鲁伟铭	朱江涛

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	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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路 728 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)	
	汇添富国证 2000 指数增强 A	汇添富国证 2000 指数增强 C
本期已实现收益	369,377,319.97	182,699,939.80
本期利润	241,964,500.34	109,980,709.95
加权平均基金份额本期利润	0.2584	0.2517
本期加权平均净值利润率	13.09%	12.92%
本期基金份额净值增长率	18.85%	18.62%
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	1,162,151,265.41	424,720,267.71
期末可供分配基金份额利润	1.0782	1.0563
期末基金资产净值	2,239,973,657.89	826,807,029.79
期末基金份额净值	2.0782	2.0563
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	107.82%	105.63%

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

汇添富国证 2000 指数增强 A						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	① - ③	② - ④
过去三个 月	14.09%	1.59%	12.46%	1.55%	1.63%	0.04%
过去六个 月	18.85%	1.61%	13.22%	1.58%	5.63%	0.03%
过去一年	51.35%	1.35%	34.04%	1.35%	17.31%	0.00%
自基金合 同生效起 至今	107.82%	1.73%	44.20%	1.72%	63.62%	0.01%
汇添富国证 2000 指数增强 C						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	① - ③	② - ④
过去三个 月	13.97%	1.59%	12.46%	1.55%	1.51%	0.04%
过去六个 月	18.62%	1.62%	13.22%	1.58%	5.40%	0.04%
过去一年	50.74%	1.35%	34.04%	1.35%	16.70%	0.00%
自基金合 同生效起 至今	105.63%	1.73%	44.20%	1.72%	61.43%	0.01%

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

准收益率变动的比较

汇添富国证2000指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富国证2000指数增强C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 07 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		
吴振翔	本基金的基金经理,指数与量化投资	2023 年 11 月 07 日	—	20	国籍：中国。 学历：中国科学技术大学

	部副总监				管理学博士。 从业资格：证券投资基金从业资格。 从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 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。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

					2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至 2025
--	--	--	--	--	--

					年 10 月 30 日任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 23 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日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。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日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。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日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的基金经理。2020
--	--	--	--	--	--

					年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日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。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 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。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日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 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至 2025 年 11 月 10 日任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 22 日至 2025 年 3 月 21 日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。2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳丰
--	--	--	--	--	---

					回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 10 日至 2024 年 12 月 11 日任汇添富中证 A500 指数型证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 12 日至 2026 年 5 月 26 日任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 3 月 27 日至今任汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月 31 日至 2026 年 5 月 26 日任汇添富中证 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 3 月 31 日至今任汇添富中证港股通综合指数增强型证券投资基金的
--	--	--	--	--	--

					基金经理。 2026 年 5 月 26 日至今任汇添富 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。2026 年 5 月 26 日至今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。
王星星	本基金的基金经理	2023 年 11 月 07 日	—	11	国籍：中国。学历：中国人民大学金融工程硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2015 年 8 月至 2023 年 2 月任东方证券股份有限公司证券研究所研究员、高级研究员、高级分析师、业务总监（研究）。2023 年 2 月加入汇添富基金管理有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。2023 年 6 月 29 日至今任

					汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 3 月 27 日至今任汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月 30 日至今任汇添富沪深 300 指数量化增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月 10 日至今任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月 23 日至今任汇添富上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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、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 and 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

报告期内,科技股强势,成长风格相对占优,国证 2000 指数整体震荡上行,产品在报告期内运作平稳,跑赢基准指数。

本基金采用量化指数增强的方式运作,在控制组合相对基准跟踪误差的基础上,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。具体操作上,我们采用多因子模型和 AI 量化选股相结合的方式评价个股,在严控组合和基准之间风格和行业偏离的条件下,超配评价较高的个股、低配评价较低的个股以实现超额收益。报告期内个股偏离相对较低,组合持仓相对分散,以降低组合对个股的依赖,提升组合超额稳定性,同时对风险事件实时监控,及时剔除风险个股,降低组合尾部风险。投资管理过程中我们尽量避免对组合持仓的直接干预,将投资观点和思想转化为规则化的量化投资策略,审慎地调整量化策略去间接调整组合持仓,以保证投资管理的可复制性,同时避免情绪波动对组合投资的负面影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富国证 2000 指数增强 A 类份额净值增长率为 18.85%,同期业绩比较基准收益率为 13.22%。本报告期汇添富国证 2000 指数增强 C 类份额净值增长率为 18.62%,同期业绩比较基准收益率为 13.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面,上半年经济运行总体平稳,新旧动能转换持续推进,新经济领域保持较好活力,传统领域则面临一定调整压力。展望下半年,宏观政策预计延续积极取向,内需修复和产业升级仍是重要支撑,但外部环境存在不确定性,经济复苏节奏可能温和曲折。整体看,经济有望保持基本稳定,不同部门之间的结构性差异或逐步趋于收敛。

证券市场方面,上半年市场呈现明显的结构性特征,各板块表现差异较大。展望下半年,随着上市公司基本面逐步验证,市场关注点可能从估值预期转向业绩兑现,风格轮动或趋于均衡。在流动性合理充裕的环境下,整体机会与局部风险并存,指数层面可能维持震荡格局,但行业和个股之间的表现差异有望收窄。

行业走势方面,科技成长领域仍具备长期发展逻辑,但需精选有实质进展的方向;传统消费和制造板块在政策支持及自身修复作用下,也可能迎来边际改善。能源、资源等领域同样存在阶段性机会。总体看,行业配置应更注重均衡,既不过度集中于单一赛道,也不忽视低估值板块的修复潜力。

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:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金可进行基金收益分配,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资,基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查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。

§ 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：汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金

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	182,159,827.56	70,920,573.07
结算备付金		14,637,682.50	1,995,617.34
存出保证金		3,054,600.00	4,463,400.00
交易性金融资产	6.4.7.2	2,863,483,076.41	1,162,604,431.57
其中：股票投资		2,862,775,005.03	1,162,604,431.57
基金投资		-	-
债券投资		708,071.38	-
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		30,496,224.89	63,214,754.06
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		3,093,831,411.36	1,303,198,776.04
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		—	—
应付赎回款		24,110,836.15	17,648,236.68
应付管理人报酬		2,190,887.27	847,937.44
应付托管费		273,860.92	105,992.16
应付销售服务费		301,386.42	167,591.96
应付投资顾问费		—	—
应交税费		83,650.34	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.7	90,102.58	150,000.00
负债合计		27,050,723.68	18,919,758.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,479,909,154.56	736,969,066.53
未分配利润	6.4.7.9	1,586,871,533.12	547,309,951.27
净资产合计		3,066,780,687.68	1,284,279,017.80
负债和净资产总计		3,093,831,411.36	1,303,198,776.04

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,479,909,154.56 份。本基金下属汇添富国证 2000 指数增强 A 基金份额净值 2.0782 元，基金份额总额 1,077,822,392.48 份；本基金下属汇添富国证 2000 指数增强 C 基金份额净值 2.0563 元，基金份额总额 402,086,762.08 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金

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		365,641,205.79	67,443,819.98
1.利息收入		379,603.94	39,680.96
其中：存款利息收入	6.4.7.10	379,603.94	39,680.96
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）		564,359,939.37	48,870,644.55
其中：股票投资收益	6.4.7.11	543,015,629.51	45,859,562.05
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	69.31	-
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	5,757,833.93	195,779.47
股利收益	6.4.7.17	15,586,406.62	2,815,303.03
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	-200,132,049.48	18,344,054.33
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	1,033,711.96	189,440.14
减：二、营业总支出		13,695,995.50	1,640,554.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,594,373.22	1,196,804.94
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,324,296.64	149,600.57
3. 销售服务费		1,682,198.36	215,760.51
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		20,743.52	1,125.29
8. 其他费用	6.4.7.21	74,383.76	77,263.46
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		351,945,210.29	65,803,265.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号		351,945,210.29	65,803,265.21

填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		351,945,210.29	65,803,265.21

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金

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	736,969,066.53	547,309,951.27	1,284,279,017.80
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	736,969,066.53	547,309,951.27	1,284,279,017.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	742,940,088.03	1,039,561,581.85	1,782,501,669.88
（一）、综合收益总额	-	351,945,210.29	351,945,210.29
（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）	742,940,088.03	687,616,371.56	1,430,556,459.59
其中：1.基金申购款	3,633,283,940.75	3,485,562,246.46	7,118,846,187.21
2.基金赎回款	-2,890,343,852.72	-2,797,945,874.90	-5,688,289,727.62
（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	1,479,909,154.56	1,586,871,533.12	3,066,780,687.68
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	149,013,236.33	17,979,332.92	166,992,569.25

资产			
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	149,013,236.33	17,979,332.92	166,992,569.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	165,155,362.20	98,109,667.60	263,265,029.80
（一）、综合收益总额	-	65,803,265.21	65,803,265.21
（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）	165,155,362.20	32,306,402.39	197,461,764.59
其中：1.基金申购款	780,128,998.25	173,426,333.64	953,555,331.89
2.基金赎回款	-614,973,636.05	-141,119,931.25	-756,093,567.30
（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	314,168,598.53	116,089,000.52	430,257,599.05

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

汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金（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〕1873 号文《关于准予汇添富国证 2000 指数增强型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 7 日生效。首次设立基金募集规模为 321,298,040.86 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_B04 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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的公告》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	2,578,615.61
等于：本金	2,562,312.33
加：应计利息	16,303.28
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	179,581,211.95

等于：本金	179,574,158.99
加：应计利息	7,052.96
减：坏账准备	-
合计	182,159,827.56

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,058,841,432.78	-	2,862,775,005.03	-196,066,427.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	71.38	708,071.38	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	71.38	708,071.38	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,059,549,432.78	71.38	2,863,483,076.41	-196,066,427.75

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投	-	-	-	-

资)				
权益衍生工具	25,547,480.00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	25,547,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	25,547,480.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2609	IM2609	15	25,455,000.00	-92,480.00
合计				-92,480.00
减：可抵销期货暂收款				-92,480.00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 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	3,176.82
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	14,876.39
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	12,542.00
合计	90,102.58

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富国证 2000 指数增强 A		
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	446,832,136.23	446,832,136.23

本期申购	2,477,676,780.91	2,477,676,780.91
本期赎回（以“-”号填列）	-1,846,686,524.66	-1,846,686,524.66
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	1,077,822,392.48	1,077,822,392.48
汇添富国证 2000 指数增强 C		
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	290,136,930.30	290,136,930.30
本期申购	1,155,607,159.84	1,155,607,159.84
本期赎回（以“-”号填列）	-1,043,657,328.06	-1,043,657,328.06
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	402,086,762.08	402,086,762.08

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

汇添富国证 2000 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	306,590,983.76	27,894,413.30	334,485,397.06
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	306,590,983.76	27,894,413.30	334,485,397.06
本期利润	369,377,319.97	-127,412,819.63	241,964,500.34
本期基金份额交易产生的变动数	528,241,391.10	57,459,976.91	585,701,368.01
其中：基金申购款	2,228,082,866.53	174,913,563.63	2,402,996,430.16
基金赎回款	-1,699,841,475.43	-117,453,586.72	-1,817,295,062.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,204,209,694.83	-42,058,429.42	1,162,151,265.41
汇添富国证 2000 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	194,828,791.15	17,995,763.06	212,824,554.21
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	194,828,791.15	17,995,763.06	212,824,554.21
本期利润	182,699,939.80	-72,719,229.85	109,980,709.95
本期基金份额交易产	62,621,224.38	39,293,779.17	101,915,003.55

生的变动数			
其中：基金申购款	996,744,128.26	85,821,688.04	1,082,565,816.30
基金赎回款	-934,122,903.88	-46,527,908.87	-980,650,812.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	440,149,955.33	-15,429,687.62	424,720,267.71

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	225,104.13
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	83,495.71
结算备付金利息收入	46,690.64
其他	24,313.46
合计	379,603.94

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——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	16,409,130,532.74
减：卖出股票成本总额	15,849,582,118.18
减：交易费用	16,532,785.05
买卖股票差价收入	543,015,629.51

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	69.31
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	69.31

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。

6.4.7.14 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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	5,757,833.93
外汇远期投资收益	—
国债期货投资收益	—
外汇期货投资收益	—

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	15,586,406.62
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	15,586,406.62
----	---------------

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	-199,387,929.48
——股票投资	-199,387,929.48
——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	-744,120.00
——权证投资	-
——期货投资	-744,120.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	-200,132,049.48

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	1,033,711.96
替代损益	-
其他	-
合计	1,033,711.96

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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
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	—
合计	74,383.76

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,基金注册登记机构
招商证券股份有限公司（"招商证券"）	基金托管人,基金销售机构
东方证券股份有限公司（"东方证券"）	基金管理人的股东,基金销售机构

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
招商证券	20,847,104,052.60	61.03	1,810,690,032.29	90.94

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
招商证券	3,746,960.86	61.04	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
招商证券	324,666.60	90.94	-	-

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣

金支付研究服务之外的其他费用。

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 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	10,594,373.22	1,196,804.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,367,616.20	375,119.17
应支付基金管理人的净管理费	7,226,757.02	821,685.77

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 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。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	1,324,296.64	149,600.57

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核

对无误后，自动在次月初五个工作日内、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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富国证 2000 指 数增强 A	汇添富国证 2000 指 数增强 C	合计
东方证券股份有限公司	—	6,016.57	6,016.57
汇添富基金管理股份有限公司	—	218,714.27	218,714.27
招商证券股份有限公司	—	173,184.69	173,184.69
合计	—	397,915.53	397,915.53
获得销售服务费的各 关联方名称	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销售服务费		
	汇添富国证 2000 指 数增强 A	汇添富国证 2000 指 数增强 C	合计
东方证券股份有限公司	—	1,118.19	1,118.19
汇添富基金管理股份有限公司	—	38,749.97	38,749.97
招商证券股份有限公司	—	45,381.68	45,381.68
合计	—	85,249.84	85,249.84

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。
计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核
对无误后，自动在次月初五个工作日内、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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至

法定节假日、休息日结束之日起 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。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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
招商证券	112,429,805.68	19,426.23	23,071,625.01	6,226.22

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于基金托管人基金专

用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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
001220	世盟股份	2026 年 01 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	
00139	惠科	2026	6 个	新股	10.12	27.73	6,488	65,65	179,9	

9	股份	年 06 月 16 日	月	流通受限				8.56	12.24	
301513	尚水智能	2026 年 04 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 04 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 04 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	
301666	大普微	2026 年 04 月 08 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	
301680	固德电材	2026 年 02 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	
301683	慧谷新材	2026 年 03 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	
301696	三瑞智能	2026 年 03 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	
60111	振石	2026	6 个	新股	11.18	17.59	775	8,664.	13,63	

2	股份	年 01 月 21 日	月	流通受限				50	2.25	
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	72	2,411.28	2,442.96	
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	
603435	嘉德利	2026 年 05 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 03 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	
688785	恒运昌股份	2026 年 01 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	
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	834	5,345.94	20,124.42	
68881	泰金	2026	6 个	新股	26.28	172.0	234	6,149.	40,26	

3	新能	年 03 月 24 日	月	流通 受限		9		52	9.06	
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个 月	新股 流通 受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	
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
113703	翔 26 转债	2026 年 06 月 09 日	19 个 交易 日	新债 流通 受限	100.00	100.01	7,080	708,000.00	708,071.38	

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
300214	日科化学	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	10.25	2026 年 07 月 13 日	12.30	505,500	4,233,857.20	5,181,375.00	

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	182,159,827.56	-	-	-	-	-	182,159,827.56
结算备付金	14,637,682.50	-	-	-	-	-	14,637,682.50

存出保证金	-	-	-	-	-	3,054,600.00	3,054,600.00
交易性金融资产	-	-	708,071.38	-	-	2,862,775,005.03	2,863,483,076.41
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	-	-	-	-	-	30,496,224.89	30,496,224.89
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	196,797,510.06	-	708,071.38	-	-	2,896,325,829.92	3,093,831,411.36
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	24,110,836.15	24,110,836.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,190,887.27	2,190,887.27
应付托管费	-	-	-	-	-	273,860.92	273,860.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-	301,386.42	301,386.42
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	83,650.34	83,650.34
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得	-	-	-	-	-	-	-

税负债							
其他负债	-	-	-	-	-	90,102.58	90,102.58
负债总计	-	-	-	-	-	27,050,723.68	27,050,723.68
利率敏感度缺口	196,797,510.06	-	708,071.38	-	-	2,869,275,106.24	3,066,780,687.68
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	70,920,573.07	-	-	-	-	-	70,920,573.07
结算备付金	1,995,617.34	-	-	-	-	-	1,995,617.34
存出保证金	-	-	-	-	-	4,463,400.00	4,463,400.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,162,604,431.57	1,162,604,431.57
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	-	-	-	-	-	63,214,754.06	63,214,754.06
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	72,916,190.41	-	-	-	-	1,230,282,585.63	1,303,198,776.04
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,648,236.68	17,648,236.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	847,937.44	847,937.44
应付托管费	-	-	-	-	-	105,992.16	105,992.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	167,591.96	167,591.96
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	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	18,919,758.24	18,919,758.24
利率敏感度缺口	72,916,190.41	-	-	-	-	1,211,362,827.39	1,284,279,017.80

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	2,862,775,005.03	93.35	1,162,604,431.57	90.53
交易性金融资产－基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产－债券投资	708,071.38	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	2,863,483,076.41	93.37	1,162,604,431.57	90.53

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
	国证 2000 上涨 5%	145,199,496.31	58,113,160.02
	国证 2000 下跌 5%	-145,199,496.31	-58,113,160.02

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	2,855,958,377.29
第二层次	5,904,613.48
第三层次	1,620,085.64
合计	2,863,483,076.41

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	2,862,775,005.03	92.53
	其中：股票	2,862,775,005.03	92.53
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	708,071.38	0.02
	其中：债券	708,071.38	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	196,797,510.06	6.36
8	其他各项资产	33,550,824.89	1.08
9	合计	3,093,831,411.36	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	10,738,140.00	0.35
B	采矿业	99,751,181.20	3.25
C	制造业	1,835,201,009.80	59.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,057,551.00	0.43
E	建筑业	12,952,194.00	0.42
F	批发和零售业	53,741,379.40	1.75
G	交通运输、仓储和邮政业	25,240,696.84	0.82
H	住宿和餐饮业	3,367,000.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	186,559,740.64	6.08
J	金融业	15,974,694.00	0.52
K	房地产业	11,163,897.00	0.36
L	租赁和商务服务业	27,313,381.20	0.89
M	科学研究和技术服务业	41,631,800.59	1.36
N	水利、环境和公共设施管理业	25,786,995.70	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	123,660.00	0.00
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	8,291,560.00	0.27
S	综合	3,873,370.00	0.13
	合计	2,374,768,251.37	77.44

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	1,474,176.00	0.05
B	采矿业	13,201,173.00	0.43
C	制造业	365,999,577.80	11.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,691.40	0.00
E	建筑业	85.30	0.00
F	批发和零售业	10,080,000.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	12,716,930.46	0.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,842,746.00	0.52
J	金融业	28,374,391.00	0.93
K	房地产业	1,066,550.00	0.03
L	租赁和商务服务业	83.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	22,584,260.50	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	16,608,713.20	0.54
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	56,376.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	488,006,753.66	15.91

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	000811	冰轮环境	303,700	17,074,014.00	0.56
2	688388	嘉元科技	380,170	16,727,480.00	0.55

3	688141	杰华特微电子	101,800	15,626,300.0 0	0.51
4	603588	高能环境	777,700	14,931,840.0 0	0.49
5	688531	日联科技股份	81,791	14,545,711.4 4	0.47
6	688378	奥来德光电	227,582	14,110,084.0 0	0.46
7	001339	智微智能	137,740	14,088,047.2 0	0.46
8	300602	飞荣达	270,600	13,854,720.0 0	0.45
9	688515	裕太微电子	55,033	13,690,009.0 8	0.45
10	300843	胜蓝股份	87,400	13,656,250.0 0	0.45
11	000969	安泰科技	556,100	13,646,694.0 0	0.44
12	002643	万润股份	644,878	13,510,194.1 0	0.44
13	688559	海目星激光	158,533	13,304,089.3 6	0.43
14	002079	苏州固锝	881,500	13,248,945.0 0	0.43
15	688279	峰昭科技	58,800	13,197,072.0 0	0.43
16	688046	药康生物	545,121	13,191,928.2 0	0.43
17	300790	宇瞳光学	496,960	12,975,625.6 0	0.42
18	603738	泰晶科技	212,900	12,784,645.0 0	0.42
19	301086	鸿富瀚	60,840	12,732,595.2 0	0.42
20	688620	安凯微电子	781,064	12,653,236.8 0	0.41
21	300263	隆华科技	775,400	12,639,020.0 0	0.41
22	000810	创维数字	945,568	12,528,776.0 0	0.41
23	300331	苏大维格	175,900	12,508,249.0 0	0.41
24	002803	吉宏股份	483,700	12,498,808.0 0	0.41

25	600961	株冶集团	385,100	12,473,389.0 0	0.41
26	603125	江苏常青树 科技	380,751	12,465,787.7 4	0.41
27	688653	康希通信	712,000	12,374,560.0 0	0.40
28	300416	苏试试验	600,060	12,229,222.8 0	0.40
29	688262	苏州国芯科 技	273,200	11,810,436.0 0	0.39
30	002297	博云新材	406,900	11,796,031.0 0	0.38
31	002947	恒铭达	153,500	11,673,675.0 0	0.38
32	301603	乔锋智能	80,900	11,633,420.0 0	0.38
33	688059	株洲华锐精 密	58,200	11,623,122.0 0	0.38
34	002587	奥拓电子	1,484,100	11,590,821.0 0	0.38
35	688173	希荻微电子	603,800	11,556,732.0 0	0.38
36	000603	盛达资源	498,900	11,524,590.0 0	0.38
37	300903	科翔股份	113,700	11,518,947.0 0	0.38
38	000612	焦作万方	1,086,400	11,504,976.0 0	0.38
39	002645	华宏科技	418,140	11,503,031.4 0	0.38
40	301219	腾远钴业	209,866	11,500,656.8 0	0.38
41	002134	天津普林	377,406	11,480,690.5 2	0.37
42	000922	佳电股份	820,880	11,459,484.8 0	0.37
43	002077	大港股份	593,900	11,456,331.0 0	0.37
44	688758	赛分科技	518,864	11,420,196.6 4	0.37
45	300852	四会富仕	164,700	11,403,828.0 0	0.37
46	000680	山推股份	1,134,000	11,396,700.0 0	0.37

47	300049	福瑞医科	292,000	11,352,960.0 0	0.37
48	002955	鸿合科技	316,414	11,311,800.5 0	0.37
49	002842	翔鹭钨业	233,800	11,269,160.0 0	0.37
50	688275	万润新能源	88,154	11,244,042.7 0	0.37
51	301150	中一科技	177,669	11,212,690.5 9	0.37
52	301238	瑞泰新材	454,100	11,080,040.0 0	0.36
53	002948	青岛银行	2,175,200	11,050,016.0 0	0.36
54	688717	艾罗能源	133,707	11,040,186.9 9	0.36
55	300855	图南股份	350,000	10,941,000.0 0	0.36
56	000682	东方电子	865,700	10,933,791.0 0	0.36
57	301510	固高科技	340,100	10,859,393.0 0	0.35
58	003010	若羽臣	444,500	10,801,350.0 0	0.35
59	301571	国科天成	165,500	10,787,290.0 0	0.35
60	688386	泛亚微透	119,600	10,744,864.0 0	0.35
61	002458	益生股份	1,382,000	10,738,140.0 0	0.35
62	300139	晓程科技	293,400	10,723,770.0 0	0.35
63	001314	亿道信息	173,200	10,703,760.0 0	0.35
64	301196	唯科科技	85,240	10,690,800.8 0	0.35
65	300252	金信诺	618,500	10,669,125.0 0	0.35
66	605196	华通线缆	408,600	10,664,460.0 0	0.35
67	002768	国恩股份	204,848	10,664,386.8 8	0.35
68	688333	西安铂力特	103,942	10,643,660.8 0	0.35

69	002283	天润工业	1,101,000	10,624,650.0 0	0.35
70	603683	晶华新材	344,479	10,616,842.7 8	0.35
71	688155	先惠技术	129,988	10,514,729.3 2	0.34
72	300681	英搏尔	365,500	10,460,610.0 0	0.34
73	300905	宝丽迪	206,500	10,448,900.0 0	0.34
74	002928	华夏航空	1,493,800	10,441,662.0 0	0.34
75	301251	威尔高	194,680	10,372,550.4 0	0.34
76	002345	潮宏基	1,125,400	10,319,918.0 0	0.34
77	603032	德新科技	382,600	10,291,940.0 0	0.34
78	603223	恒通股份	785,420	10,249,731.0 0	0.33
79	002531	天顺风能	1,214,300	10,236,549.0 0	0.33
80	002708	光洋股份	776,000	10,235,440.0 0	0.33
81	300337	银邦股份	877,400	10,230,484.0 0	0.33
82	001337	四川黄金	277,700	10,180,482.0 0	0.33
83	300772	运达股份	827,600	10,179,480.0 0	0.33
84	688035	德邦科技股 份	110,800	10,171,440.0 0	0.33
85	603416	信捷电气	192,300	10,166,901.0 0	0.33
86	002886	沃特股份	360,600	10,129,254.0 0	0.33
87	601882	海天精工	499,700	10,108,931.0 0	0.33
88	300590	移为通信	703,900	10,100,965.0 0	0.33
89	603219	富佳股份	647,440	10,087,115.2 0	0.33
90	605100	华丰股份	249,220	10,073,472.4 0	0.33

91	688609	广东九联科技	908,506	10,002,651.06	0.33
92	301280	珠城科技	197,660	9,995,666.20	0.33
93	688182	灿勤科技	231,200	9,957,784.00	0.32
94	688648	中邮科技	272,400	9,956,220.00	0.32
95	300996	普联软件	914,120	9,954,766.80	0.32
96	688697	纽威数控装备	732,160	9,950,054.40	0.32
97	002491	通鼎互联	305,800	9,907,920.00	0.32
98	002662	峰璟股份	2,675,700	9,900,090.00	0.32
99	603538	美诺华	303,400	9,875,670.00	0.32
100	301286	侨源股份	169,600	9,835,104.00	0.32
101	002301	齐心集团	1,358,700	9,823,401.00	0.32
102	603162	海通发展	1,093,072	9,804,855.84	0.32
103	300490	华自科技	737,600	9,758,448.00	0.32
104	300497	富祥股份	440,300	9,757,048.00	0.32
105	300768	迪普科技	708,200	9,751,914.00	0.32
106	301487	盟固利	505,820	9,686,453.00	0.32
107	300206	理邦仪器	790,900	9,672,707.00	0.32
108	301371	敷尔佳	371,700	9,664,200.00	0.32
109	688660	电气风电	1,120,522	9,658,899.64	0.31
110	688230	芯导科技	122,400	9,646,344.00	0.31
111	002935	天奥电子	438,600	9,622,884.00	0.31
112	000552	甘肃能化	4,293,400	9,617,216.00	0.31
113	002154	报喜鸟	2,693,200	9,587,792.00	0.31
114	002534	西子洁能	515,800	9,568,090.00	0.31
115	603057	上海紫燕食品	429,000	9,566,700.00	0.31
116	603085	天成自控	878,100	9,544,947.00	0.31
117	000061	农产品	1,703,400	9,539,040.00	0.31
118	301500	飞南资源	365,700	9,526,485.00	0.31
119	300191	潜能恒信	344,500	9,525,425.00	0.31
120	600971	恒源煤电	1,376,900	9,500,610.00	0.31
121	002615	哈尔斯	1,375,900	9,493,710.00	0.31
122	603507	振江股份	288,300	9,482,187.00	0.31
123	300913	兆龙互连	197,572	9,465,674.52	0.31
124	002111	威海广泰	1,050,500	9,454,500.00	0.31
125	301548	崇德科技	106,400	9,445,128.00	0.31
126	301631	壹连科技	130,960	9,410,785.60	0.31
127	300127	银河磁体	336,600	9,407,970.00	0.31
128	002912	中新赛克	508,489	9,376,537.16	0.31
129	603132	金徽股份	601,800	9,376,044.00	0.31
130	605056	威亨国际	583,401	9,334,416.00	0.30

131	300322	硕贝德	369,946	9,322,639.20	0.30
132	002923	润都股份	983,042	9,299,577.32	0.30
133	002757	南兴股份	514,000	9,277,700.00	0.30
134	301093	华兰股份	68,400	9,277,092.00	0.30
135	603239	浙江仙通	621,000	9,197,010.00	0.30
136	688553	汇宇制药	862,711	9,170,617.93	0.30
137	301021	英诺激光	75,200	9,166,880.00	0.30
138	300848	美瑞新材	656,900	9,163,755.00	0.30
139	001311	多利科技	566,867	9,143,564.71	0.30
140	603889	新澳股份	1,788,230	9,137,855.30	0.30
141	601121	宝地矿业	1,616,000	9,114,240.00	0.30
142	002996	顺博合金	1,544,300	9,111,370.00	0.30
143	301172	君逸数码	350,700	9,100,665.00	0.30
144	600502	安徽建工	2,084,100	9,065,835.00	0.30
145	301439	泓淋电力	572,300	8,996,556.00	0.29
146	301202	朗威股份	269,400	8,979,102.00	0.29
147	001287	中电港	287,300	8,949,395.00	0.29
148	603271	永杰新材料	201,100	8,938,895.00	0.29
149	301456	盘古智能	394,600	8,910,068.00	0.29
150	301180	万祥科技	709,800	8,893,794.00	0.29
151	300134	大富科技	1,038,500	8,879,175.00	0.29
152	300596	利安隆	168,825	8,859,936.00	0.29
153	301026	浩通科技	437,500	8,846,250.00	0.29
154	300530	领湃科技	523,800	8,826,030.00	0.29
155	603711	香飘飘	767,300	8,524,703.00	0.28
156	603969	银龙股份	1,169,500	8,502,265.00	0.28
157	688351	微创电生理 股份	370,000	8,384,200.00	0.27
158	301110	青木科技	219,960	8,327,685.60	0.27
159	301025	读客文化	1,068,500	8,291,560.00	0.27
160	002838	道恩股份	268,200	8,212,284.00	0.27
161	301307	美利信	107,700	8,108,733.00	0.26
162	301381	赛维时代	438,000	8,076,720.00	0.26
163	300933	中辰股份	1,325,600	8,059,648.00	0.26
164	002454	松芝股份	1,683,631	8,047,756.18	0.26
165	603915	国茂股份	566,347	8,036,463.93	0.26
166	002404	嘉欣丝绸	1,399,900	8,007,428.00	0.26
167	300277	汽轮科技	529,000	7,956,160.00	0.26
168	300226	上海钢联	505,020	7,731,856.20	0.25
169	300697	电工合金	508,400	7,702,260.00	0.25
170	605319	无锡振华	332,600	7,546,694.00	0.25
171	603181	皇马科技	461,100	7,479,042.00	0.24
172	301326	捷邦科技	53,500	7,456,295.00	0.24

173	300580	贝斯特	369,200	7,424,612.00	0.24
174	000758	中色股份	1,128,300	7,412,931.00	0.24
175	000576	甘化科工	1,121,100	7,365,627.00	0.24
176	001221	悍高集团	178,617	7,183,975.74	0.23
177	002440	闰土股份	700,249	7,177,552.25	0.23
178	301559	中集环科	588,400	7,172,596.00	0.23
179	688480	赛恩斯环保	81,680	7,154,351.20	0.23
180	603286	日盈电子	155,650	7,102,309.50	0.23
181	002824	和胜股份	202,700	7,009,366.00	0.23
182	688166	博瑞生物医 药	197,200	6,903,972.00	0.23
183	300693	盛弘股份	141,100	6,878,625.00	0.22
184	301071	力量钻石	73,900	6,835,750.00	0.22
185	300171	东富龙	608,500	6,730,010.00	0.22
186	300861	美畅股份	264,200	6,655,198.00	0.22
187	301246	宏源药业	245,900	6,614,710.00	0.22
188	300740	水羊股份	356,546	6,564,011.86	0.21
189	601388	怡球资源	2,313,600	6,547,488.00	0.21
190	002986	宇新股份	546,400	6,463,912.00	0.21
191	688325	赛微微电子	48,200	6,285,762.00	0.20
192	300121	阳谷华泰	497,700	6,271,020.00	0.20
193	002452	长高电气	470,100	6,003,177.00	0.20
194	000506	招金黄金	501,835	5,881,506.20	0.19
195	603960	克来机电	330,600	5,755,746.00	0.19
196	603317	天味食品	440,768	5,734,391.68	0.19
197	300662	科锐国际	337,100	5,723,958.00	0.19
198	001379	腾达科技	363,680	5,709,776.00	0.19
199	603112	华翔股份	338,400	5,661,432.00	0.18
200	002364	中恒电气	105,100	5,654,380.00	0.18
201	600320	振华重工	1,368,100	5,650,253.00	0.18
202	301285	鸿日达	49,950	5,510,983.50	0.18
203	300840	酷特智能	265,900	5,485,517.00	0.18
204	002919	名臣健康	285,900	5,429,241.00	0.18
205	300887	谱尼测试	776,000	5,400,960.00	0.18
206	300213	佳讯飞鸿	886,900	5,374,614.00	0.18
207	600391	航发科技	159,600	5,338,620.00	0.17
208	300428	立中集团	292,908	5,325,067.44	0.17
209	002843	泰嘉股份	245,100	5,262,297.00	0.17
210	600389	江山股份	266,100	5,194,272.00	0.17
211	300990	同飞股份	48,800	5,127,416.00	0.17
212	688107	安路科技	112,400	5,125,440.00	0.17
213	603966	法兰泰克	620,540	5,057,401.00	0.16
214	688410	山外山血液	351,200	5,043,232.00	0.16

		净化			
215	300184	力源信息	282,200	4,952,610.00	0.16
216	002860	星帅尔	331,800	4,840,962.00	0.16
217	002016	世荣兆业	1,175,200	4,700,800.00	0.15
218	300551	古鳌科技	466,200	4,587,408.00	0.15
219	300752	隆利科技	338,420	4,558,517.40	0.15
220	603270	金帝精密科技股份	135,800	4,550,658.00	0.15
221	002956	西麦食品	218,300	4,531,908.00	0.15
222	300055	万邦达	695,800	4,473,994.00	0.15
223	002961	瑞达期货	227,600	4,456,408.00	0.15
224	603701	德宏股份	199,000	4,374,020.00	0.14
225	600826	兰生股份	491,300	4,318,527.00	0.14
226	002166	莱茵生物	685,100	4,302,428.00	0.14
227	300981	中红医疗	439,600	4,206,972.00	0.14
228	600510	黑牡丹	554,200	4,134,332.00	0.13
229	688238	和元生物	756,137	4,098,262.54	0.13
230	688787	海天瑞声	30,200	4,060,390.00	0.13
231	002541	鸿路钢构	231,500	4,009,580.00	0.13
232	603897	长城科技	121,200	3,934,152.00	0.13
233	600251	冠农股份	449,000	3,879,360.00	0.13
234	600620	天宸股份	980,600	3,873,370.00	0.13
235	603931	格林达	64,700	3,843,180.00	0.13
236	688176	亚虹医药科技	384,205	3,811,313.60	0.12
237	300504	天邑股份	232,900	3,756,677.00	0.12
238	688668	鼎通科技	9,800	3,658,340.00	0.12
239	000655	金岭矿业	564,100	3,587,676.00	0.12
240	688167	西安炬光科技	10,000	3,542,100.00	0.12
241	301162	国能日新	80,800	3,535,000.00	0.12
242	002745	木林森	278,600	3,496,430.00	0.11
243	000852	石化机械	703,600	3,489,856.00	0.11
244	300691	联合光电	220,700	3,489,267.00	0.11
245	688117	圣诺生物	128,400	3,470,652.00	0.11
246	002810	山东赫达	140,200	3,462,940.00	0.11
247	301389	隆扬电子	39,400	3,419,526.00	0.11
248	301073	君亭酒店	185,000	3,367,000.00	0.11
249	001298	好上好	158,900	3,297,175.00	0.11
250	000592	平潭发展	490,800	3,283,452.00	0.11
251	601975	招商南油	874,700	3,262,631.00	0.11
252	300067	安诺其	591,700	3,207,014.00	0.10
253	300397	天和防务	207,300	3,138,522.00	0.10

254	300378	鼎捷数智	85,400	3,082,940.00	0.10
255	603619	中曼石油	163,700	3,062,827.00	0.10
256	301268	铭利达	212,700	2,973,546.00	0.10
257	601579	会稽山	193,500	2,842,515.00	0.09
258	600366	宁波韵升	187,600	2,753,968.00	0.09
259	002245	蔚蓝锂芯	146,416	2,739,443.36	0.09
260	002398	垒知集团	729,900	2,737,125.00	0.09
261	301177	迪阿股份	97,300	2,682,561.00	0.09
262	301316	慧博云通	67,400	2,654,212.00	0.09
263	300290	ST 荣科	384,100	2,554,265.00	0.08
264	601886	江河集团	306,100	2,457,983.00	0.08
265	603291	联合水务	301,500	2,424,060.00	0.08
266	605222	起帆电缆	103,800	2,420,616.00	0.08
267	300842	帝科股份	27,000	2,407,590.00	0.08
268	301516	中远通	169,300	2,395,595.00	0.08
269	300792	壹网壹创	89,200	2,313,848.00	0.08
270	300711	广哈通信	139,800	2,292,720.00	0.07
271	300249	依米康	147,500	2,271,500.00	0.07
272	002953	日丰股份	259,900	2,266,328.00	0.07
273	300201	海伦哲	107,200	2,258,704.00	0.07
274	688025	杰普特光电	4,701	2,209,470.00	0.07
275	002832	比音勒芬	106,500	2,198,160.00	0.07
276	300613	富瀚微	27,400	2,194,192.00	0.07
277	000550	江铃汽车	131,700	2,136,174.00	0.07
278	301507	民生健康	173,100	2,082,393.00	0.07
279	301558	三态股份	332,900	2,053,993.00	0.07
280	600094	大名城	580,200	2,007,492.00	0.07
281	300552	万集科技	86,400	1,974,240.00	0.06
282	688390	固德威电源	18,000	1,953,180.00	0.06
283	600966	博汇纸业	406,900	1,944,982.00	0.06
284	688611	杭州柯林股份	27,200	1,943,440.00	0.06
285	300421	力星股份	104,500	1,934,295.00	0.06
286	002845	同兴达	115,000	1,886,000.00	0.06
287	603686	福龙马	145,100	1,874,692.00	0.06
288	603127	昭衍新药	49,000	1,872,780.00	0.06
289	300756	金马游乐	56,200	1,857,410.00	0.06
290	300671	富满微	21,200	1,826,592.00	0.06
291	002206	海利得	343,700	1,776,929.00	0.06
292	601083	锦江航运	174,200	1,731,548.00	0.06
293	600388	龙净环保	117,300	1,706,715.00	0.06
294	600409	三友化工	279,300	1,706,523.00	0.06
295	603171	税友股份	42,700	1,701,595.00	0.06

296	002516	旷达科技	302,700	1,689,066.00	0.06
297	002969	嘉美包装	119,900	1,688,192.00	0.06
298	688151	华强科技	111,800	1,662,466.00	0.05
299	688372	伟测科技	8,800	1,636,800.00	0.05
300	300797	钢研纳克	122,500	1,624,350.00	0.05
301	300663	科蓝软件	241,300	1,607,058.00	0.05
302	002216	三全食品	139,300	1,606,129.00	0.05
303	603229	奥翔药业	201,500	1,559,610.00	0.05
304	603867	新化股份	45,300	1,517,097.00	0.05
305	300946	恒而达	37,700	1,485,003.00	0.05
306	301535	浙江华远	109,600	1,470,832.00	0.05
307	300984	金沃股份	27,300	1,466,829.00	0.05
308	002552	宝鼎科技	23,920	1,459,120.00	0.05
309	601068	中铝国际	329,300	1,422,576.00	0.05
310	688231	隆达超合金股份	36,200	1,329,626.00	0.04
311	300523	辰安科技	71,700	1,317,846.00	0.04
312	605389	长龄液压	13,720	1,317,120.00	0.04
313	603985	恒润股份	54,100	1,299,482.00	0.04
314	301363	美好医疗	69,500	1,273,935.00	0.04
315	603381	永臻股份	82,100	1,265,161.00	0.04
316	301149	隆华新材	108,100	1,143,698.00	0.04
317	301128	强瑞技术	7,100	1,106,890.00	0.04
318	301328	维峰电子	15,357	1,093,418.40	0.04
319	002666	德联集团	262,000	1,034,900.00	0.03
320	300227	光韵达	86,100	1,024,590.00	0.03
321	300388	节能国祯	163,500	1,008,795.00	0.03
322	002376	新北洋	175,400	1,008,550.00	0.03
323	300698	万马科技	35,200	957,440.00	0.03
324	688306	均普智能制造	94,600	955,460.00	0.03
325	300320	海达股份	100,000	954,000.00	0.03
326	688577	海德曼装备	20,800	953,264.00	0.03
327	002988	豪美新材	41,600	917,696.00	0.03
328	605016	百龙创园	35,000	904,750.00	0.03
329	688315	诺禾致源科技	71,955	900,157.05	0.03
330	688767	杭州博拓生物科技	27,000	877,770.00	0.03
331	688225	亚信安全	70,000	869,400.00	0.03
332	301658	首航新能	31,100	838,767.00	0.03
333	002627	三峡旅游	143,000	816,530.00	0.03
334	000905	厦门港务	105,000	814,800.00	0.03

335	300415	伊之密	35,900	714,769.00	0.02
336	601226	华电科工	106,500	677,340.00	0.02
337	002488	金固股份	68,100	606,771.00	0.02
338	300453	三鑫医疗	64,700	584,888.00	0.02
339	603610	麒盛科技	32,200	578,312.00	0.02
340	301085	亚康股份	9,400	569,734.00	0.02
341	301608	博实结	11,249	565,374.74	0.02
342	002448	中原内配	45,800	563,340.00	0.02
343	600710	苏美达	57,200	546,832.00	0.02
344	688586	江航飞机装 备	46,600	544,754.00	0.02
345	600230	沧州大化	40,300	524,706.00	0.02
346	300380	安硕信息	16,600	510,782.00	0.02
347	002544	普天科技	27,900	508,338.00	0.02
348	603058	永吉股份	56,100	488,631.00	0.02
349	603211	晋拓科技股 份	13,200	468,732.00	0.02
350	603093	南华期货	25,800	468,270.00	0.02
351	002870	香山股份	12,000	462,480.00	0.02
352	300822	贝仕达克	39,000	456,300.00	0.01
353	300539	横河精密	22,400	456,288.00	0.01
354	002606	大连电瓷	33,600	450,576.00	0.01
355	688779	五矿新能	55,000	446,050.00	0.01
356	002401	中远海科	36,400	422,604.00	0.01
357	002441	众业达	51,400	400,920.00	0.01
358	301117	佳缘科技	16,700	389,945.00	0.01
359	001376	百通能源	36,900	383,760.00	0.01
360	601003	柳钢股份	111,400	375,418.00	0.01
361	600686	金龙汽车	33,100	373,699.00	0.01
362	688339	亿华通科技	19,200	359,040.00	0.01
363	300286	安科瑞	14,300	345,345.00	0.01
364	603121	华培动力	28,200	331,350.00	0.01
365	000797	中国武夷	146,700	321,273.00	0.01
366	002328	新朋股份	42,500	311,950.00	0.01
367	300904	威力传动	7,600	308,484.00	0.01
368	300918	南山智尚	27,800	298,016.00	0.01
369	300695	兆丰股份	5,800	288,782.00	0.01
370	688152	麒麟信安	9,600	263,808.00	0.01
371	000837	秦川机床	23,600	262,196.00	0.01
372	600259	中稀有色	2,400	243,864.00	0.01
373	688680	海优新材	5,800	243,600.00	0.01
374	300389	艾比森	18,600	238,452.00	0.01
375	603615	茶花股份	14,500	234,175.00	0.01

376	002641	公元股份	52,900	204,194.00	0.01
377	603590	康辰药业	7,000	203,070.00	0.01
378	300503	昊志机电	1,900	175,370.00	0.01
379	000523	红棉股份	65,900	170,022.00	0.01
380	688708	佳驰科技	3,200	162,560.00	0.01
381	605077	华康股份	13,700	148,097.00	0.00
382	603016	新宏泰	4,200	141,792.00	0.00
383	601086	国芳集团	20,000	132,600.00	0.00
384	300492	华图山鼎	3,600	123,660.00	0.00
385	301491	汉桑科技	2,900	113,883.00	0.00
386	000156	华数传媒	17,000	107,270.00	0.00
387	002882	金龙羽	5,600	105,784.00	0.00
388	603055	台华新材	12,400	96,596.00	0.00
389	603187	海容冷链	5,700	65,493.00	0.00
390	603061	金海通股份	45	22,599.90	0.00
391	605289	罗曼股份	40	5,800.00	0.00
392	002636	金安国纪	37	4,438.89	0.00
393	002975	博杰股份	30	4,260.00	0.00
394	300488	恒锋工具	37	1,732.71	0.00
395	301259	艾布鲁	30	787.50	0.00
396	002338	奥普光电	11	629.20	0.00
397	002416	爱施德	40	358.40	0.00
398	301099	雅创电子	2	191.00	0.00
399	603327	福蓉科技	16	135.68	0.00

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	001389	广合科技	43,300	10,272,925.00	0.33
2	300475	香农芯创	33,600	10,080,000.00	0.33
3	000776	广发证券	428,100	10,017,540.00	0.33
4	002266	浙富控股	1,923,100	9,730,886.00	0.32
5	600601	方正科技	687,800	9,519,152.00	0.31
6	002849	威星智能	551,800	9,336,456.00	0.30

7	688002	睿创微纳	59,923	9,269,488.87	0.30
8	301295	美硕科技	218,500	9,216,330.00	0.30
9	002805	丰元股份	319,600	9,137,364.00	0.30
10	688236	春立正达医疗	627,553	9,074,416.38	0.30
11	300478	杭州高新	245,960	9,024,272.40	0.29
12	300033	同花顺	37,400	9,013,400.00	0.29
13	000060	中金岭南	1,166,600	8,831,162.00	0.29
14	301002	崧盛股份	228,700	8,827,820.00	0.29
15	300746	汉嘉数智	814,800	8,807,988.00	0.29
16	600549	厦门钨业	101,300	8,630,760.00	0.28
17	603259	药明康德	69,200	8,616,092.00	0.28
18	300857	协创数据	25,300	8,599,470.00	0.28
19	000783	长江证券	881,100	8,590,725.00	0.28
20	300750	宁德时代	21,700	8,528,317.00	0.28
21	601899	紫金矿业	339,000	8,522,460.00	0.28
22	601872	招商轮船	483,300	8,491,581.00	0.28
23	600841	动力新科	1,381,000	8,424,100.00	0.27
24	000807	云铝股份	375,700	8,317,998.00	0.27
25	301272	英华特	252,100	8,304,174.00	0.27
26	300014	亿纬锂能	126,700	8,239,301.00	0.27
27	605151	西上海	467,600	8,234,436.00	0.27
28	300106	西部牧业	742,200	7,303,248.00	0.24
29	301159	三维天地	225,300	6,556,230.00	0.21
30	002653	海思科	92,900	6,162,986.00	0.20
31	002578	闽发铝业	1,945,500	6,128,325.00	0.20
32	600189	泉阳泉	799,900	6,023,247.00	0.20
33	603116	红蜻蜓	1,051,800	5,974,224.00	0.19
34	300980	祥源新材	196,700	5,784,947.00	0.19
35	301536	星辰科技	44,701	5,753,465.71	0.19
36	002600	领益智造	324,900	5,633,766.00	0.18
37	603083	剑桥科技	21,800	5,556,166.00	0.18
38	600356	恒丰纸业	743,700	5,510,817.00	0.18
39	605299	舒华体育	405,700	5,416,095.00	0.18
40	001230	劲旅环境	344,620	5,293,363.20	0.17
41	300214	日科化学	505,500	5,181,375.00	0.17
42	301156	美农生物	471,210	5,122,052.70	0.17
43	301279	金道科技	229,700	4,991,381.00	0.16
44	301055	张小泉	115,300	4,896,791.00	0.16
45	301360	荣旗科技	70,290	4,814,162.10	0.16
46	603075	热威科技股份	215,300	4,814,108.00	0.16
47	301024	霍普股份	128,400	4,727,688.00	0.15

48	301121	紫建电子	146,900	4,703,738.00	0.15
49	600319	亚星化学	747,600	4,657,548.00	0.15
50	001266	宏英智能	94,600	4,644,860.00	0.15
51	300745	欣锐科技	107,800	4,551,316.00	0.15
52	002752	昇兴股份	786,000	4,338,720.00	0.14
53	603980	吉华集团	651,400	4,325,296.00	0.14
54	600115	中国东航	1,108,600	4,223,766.00	0.14
55	300575	中旗股份	831,600	4,091,472.00	0.13
56	002998	优彩资源	559,300	3,641,043.00	0.12
57	301176	逸豪新材	52,700	3,583,600.00	0.12
58	688718	唯赛勃科技	221,600	3,538,952.00	0.12
59	688038	武汉中科通达	210,400	3,538,928.00	0.12
60	603638	艾迪精密	149,600	3,508,120.00	0.11
61	300458	全志科技	85,400	3,369,884.00	0.11
62	300686	智动力	185,100	3,333,651.00	0.11
63	000975	山金国际	192,700	3,275,900.00	0.11
64	301469	恒达新材	114,900	3,168,942.00	0.10
65	688045	必易微电子	39,200	3,166,576.00	0.10
66	002545	东方铁塔	190,400	3,088,288.00	0.10
67	301057	汇隆新材	133,000	3,059,000.00	0.10
68	002379	宏桥控股	200,200	2,956,954.00	0.10
69	603617	君禾股份	362,600	2,581,712.00	0.08
70	002532	天山铝业	238,100	2,554,813.00	0.08
71	301290	东星医疗	91,500	2,493,375.00	0.08
72	301499	维科精密	85,000	2,480,300.00	0.08
73	603175	超颖电子	26,600	2,369,794.00	0.08
74	002415	海康威视	68,500	2,342,700.00	0.08
75	605138	盛泰集团	415,700	2,294,664.00	0.07
76	603516	淳中科技	17,000	2,288,370.00	0.07
77	603006	联明股份	154,300	2,198,775.00	0.07
78	688051	罗克佳华科技	89,800	2,063,604.00	0.07
79	300817	双飞集团	127,800	1,993,680.00	0.07
80	300837	浙矿股份	74,900	1,779,624.00	0.06
81	300141	和顺电气	168,800	1,585,032.00	0.05
82	600292	电投水电	131,600	1,584,464.00	0.05
83	301129	瑞纳智能	64,400	1,344,028.00	0.04
84	301198	喜悦智行	96,600	1,294,440.00	0.04
85	688683	莱尔科技	32,168	1,219,810.56	0.04
86	300995	奇德新材	45,200	1,211,812.00	0.04
87	301212	联盛化学	49,100	1,146,485.00	0.04
88	000517	荣安地产	642,500	1,066,550.00	0.03

89	301016	雷尔伟	73,400	1,025,398.00	0.03
90	002155	湖南黄金	42,500	1,014,475.00	0.03
91	001218	丽臣实业	45,100	994,906.00	0.03
92	002772	众兴菌业	86,000	976,960.00	0.03
93	688175	珠海高凌信息	37,698	948,104.70	0.03
94	301189	奥尼电子	14,400	848,592.00	0.03
95	600030	中信证券	26,200	752,726.00	0.02
96	300427	红相股份	104,800	703,208.00	0.02
97	300568	星源材质	34,900	653,328.00	0.02
98	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.02
99	301502	华阳智能	7,700	535,304.00	0.02
100	301072	中捷精工	12,900	529,029.00	0.02
101	688130	晶华微电子	18,400	517,408.00	0.02
102	300970	华绿生物	27,200	497,216.00	0.02
103	605066	天正电气	72,500	492,275.00	0.02
104	603519	立霸股份	29,300	448,290.00	0.01
105	688203	海正生物材料	44,600	445,108.00	0.01
106	300649	杭州园林	15,400	431,046.00	0.01
107	001360	南矿集团	24,000	424,560.00	0.01
108	600711	盛屯矿业	35,400	388,338.00	0.01
109	603933	睿能科技	17,200	387,860.00	0.01
110	605208	永茂泰	23,700	378,015.00	0.01
111	002702	海欣食品	77,500	344,875.00	0.01
112	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
113	301210	金杨精密	10,700	321,000.00	0.01
114	688021	奥福科技	15,600	302,016.00	0.01
115	301192	泰祥股份	15,900	300,510.00	0.01
116	301190	善水科技	18,700	299,761.00	0.01
117	301329	信音电子	11,900	289,051.00	0.01
118	301356	天振股份	9,600	252,192.00	0.01
119	002205	国统股份	20,900	210,881.00	0.01
120	300658	延江股份	17,600	201,168.00	0.01
121	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
122	605068	明新旭腾	9,400	157,732.00	0.01
123	300521	爱司凯	4,700	129,720.00	0.00
124	301252	同星科技	3,000	121,590.00	0.00
125	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
126	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
127	300654	世纪天鸿	5,800	56,376.00	0.00
128	688785	恒运昌股份	116	53,725.40	0.00
129	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00

130	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
131	603019	中科曙光	200	21,446.00	0.00
132	688811	有研金属复材	834	20,124.42	0.00
133	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
134	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
135	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
136	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
137	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
138	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
139	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
140	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
141	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
142	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
143	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
144	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
145	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
146	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
147	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
148	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
149	603293	埃泰克汽车电子	72	2,442.96	0.00
150	002080	中材科技	25	2,250.00	0.00
151	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
152	001331	胜通能源	30	1,691.40	0.00
153	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
154	300759	康龙化成	50	1,446.50	0.00
155	301580	爱迪特	20	1,286.60	0.00
156	301059	金三江	50	554.50	0.00
157	603909	建发合诚	10	85.30	0.00
158	002712	思美传媒	20	83.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	301511	德福科技	102,851,139.64	8.01
2	603929	亚翔集成	82,163,814.64	6.40
3	300903	科翔股份	76,412,288.06	5.95

4	002636	金安国纪	74,774,905.46	5.82
5	601208	东材科技	70,543,398.33	5.49
6	688498	源杰科技	69,764,068.61	5.43
7	603083	剑桥科技	67,228,198.96	5.23
8	002245	蔚蓝锂芯	66,564,558.28	5.18
9	300806	斯迪克	62,192,405.51	4.84
10	300738	奥飞数据	60,901,960.72	4.74
11	002552	宝鼎科技	56,407,312.20	4.39
12	002957	科瑞技术	56,359,417.00	4.39
13	300302	同有科技	56,332,034.12	4.39
14	301500	飞南资源	55,154,553.92	4.29
15	603256	宏和科技	55,084,755.00	4.29
16	002440	闰土股份	54,966,937.73	4.28
17	301217	铜冠铜箔	54,494,489.35	4.24
18	300975	商络电子	54,107,504.00	4.21
19	000811	冰轮环境	53,160,327.12	4.14
20	603061	金海通股份	51,411,877.15	4.00
21	603629	利通电子	50,650,348.00	3.94
22	688167	西安炬光科技	50,105,038.80	3.90
23	688766	普冉半导体	49,670,174.70	3.87
24	301550	斯菱智驱	49,522,097.15	3.86
25	688548	广钢气体股份	49,277,978.56	3.84
26	605376	博迁新材	48,857,006.00	3.80
27	688549	中巨芯科技	44,724,331.48	3.48
28	002297	博云新材	44,204,836.00	3.44
29	301150	中一科技	44,059,248.29	3.43
30	002491	通鼎互联	43,724,249.00	3.40
31	300913	兆龙互连	43,045,440.41	3.35
32	002645	华宏科技	41,581,390.00	3.24
33	000603	盛达资源	41,487,275.00	3.23
34	301071	力量钻石	40,924,164.40	3.19
35	002283	天润工业	40,632,572.00	3.16
36	301389	隆扬电子	40,441,624.68	3.15
37	300323	华灿光电	40,425,988.97	3.15
38	603588	高能环境	39,554,934.16	3.08
39	300620	光库科技	39,290,173.99	3.06
40	002824	和胜股份	39,249,727.00	3.06
41	688416	恒烁股份	38,382,695.15	2.99
42	300857	协创数据	37,300,492.46	2.90
43	002132	恒星科技	36,663,769.00	2.85
44	688388	嘉元科技	36,563,630.35	2.85
45	688003	天准科技	36,325,195.88	2.83
46	300905	宝丽迪	36,145,277.00	2.81

47	301095	广立微	36,030,001.00	2.81
48	301526	国际复材	35,399,391.60	2.76
49	688141	杰华特微电子	35,123,172.37	2.73
50	300790	宇瞳光学	34,947,511.20	2.72
51	301366	一博科技	34,822,350.44	2.71
52	301171	易点天下	34,371,075.39	2.68
53	688717	艾罗能源	34,147,296.58	2.66
54	300263	隆华科技	33,472,078.60	2.61
55	600206	有研新材	33,124,199.00	2.58
56	688107	安路科技	32,843,368.69	2.56
57	000758	中色股份	32,641,640.44	2.54
58	300331	苏大维格	32,559,682.78	2.54
59	688409	富创精密	32,521,474.18	2.53
60	002975	博杰股份	32,507,317.90	2.53
61	688031	星环科技	32,486,612.16	2.53
62	000506	招金黄金	32,345,251.95	2.52
63	300602	飞荣达	32,233,741.00	2.51
64	300145	南方泵业	32,169,450.00	2.50
65	688146	中船派瑞特气	31,802,019.97	2.48
66	301172	君逸数码	31,782,634.30	2.47
67	688627	精智达技术	31,781,811.46	2.47
68	688258	江苏卓易信息科技	31,722,358.12	2.47
69	002815	崇达技术	31,641,488.00	2.46
70	300351	永贵电器	31,582,095.00	2.46
71	688270	ST 臻镭科技	31,274,341.09	2.44
72	300671	富满微	31,238,706.00	2.43
73	300953	震裕科技	31,154,511.60	2.43
74	301099	雅创电子	30,966,315.69	2.41
75	688337	普源精电	30,908,172.54	2.41
76	301382	蜂助手	30,427,956.80	2.37
77	603986	兆易创新	30,304,374.12	2.36
78	603093	南华期货	30,232,781.00	2.35
79	688155	先惠技术	30,195,272.17	2.35
80	688400	凌云光技术	29,985,401.00	2.33
81	002364	中恒电气	29,977,691.00	2.33
82	301566	达利凯普	29,621,232.20	2.31
83	300166	东方国信	29,599,831.00	2.30
84	300337	银邦股份	29,578,914.50	2.30
85	301316	慧博云通	29,388,660.26	2.29
86	600105	永鼎股份	29,285,077.21	2.28
87	688182	灿勤科技	29,046,533.99	2.26
88	603618	杭电股份	28,936,027.15	2.25

89	688390	固德威电源	28,870,216.08	2.25
90	301123	奕东电子	28,485,491.00	2.22
91	300634	彩讯股份	28,376,855.06	2.21
92	688275	万润新能源	28,376,446.05	2.21
93	002851	麦格米特	28,207,271.00	2.20
94	688531	日联科技股份	28,088,781.87	2.19
95	688176	亚虹医药科技	28,022,267.69	2.18
96	688515	裕太微电子	27,961,674.59	2.18
97	300825	阿尔特	27,805,900.50	2.17
98	300757	罗博特科	27,681,185.00	2.16
99	301285	鸿日达	27,658,435.00	2.15
100	300067	安诺其	27,588,750.00	2.15
101	001389	广合科技	27,528,049.00	2.14
102	601069	西部黄金	27,401,014.73	2.13
103	600961	株冶集团	27,368,348.00	2.13
104	688002	睿创微纳	27,359,088.52	2.13
105	688108	赛诺医疗科学	27,211,242.40	2.12
106	301246	宏源药业	27,109,803.44	2.11
107	002222	福晶科技	26,880,445.31	2.09
108	300322	硕贝德	26,860,129.56	2.09
109	002008	大族激光	26,852,903.00	2.09
110	301018	申菱环境	26,841,762.52	2.09
111	301603	乔锋智能	26,572,800.79	2.07
112	688256	寒武纪科技	26,510,776.33	2.06
113	688668	鼎通科技	26,308,216.33	2.05
114	002947	恒铭达	26,230,491.80	2.04
115	603057	上海紫燕食品	26,210,498.00	2.04
116	300369	绿盟科技	26,108,164.00	2.03
117	688697	纽威数控装备	26,096,717.61	2.03
118	300049	福瑞医科	26,091,068.00	2.03
119	600391	航发科技	26,031,038.90	2.03
120	300170	汉得信息	25,946,677.00	2.02

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	301511	德福科技	114,626,333.93	8.93
2	601208	东材科技	86,040,324.81	6.70
3	603929	亚翔集成	86,014,356.94	6.70

4	002636	金安国纪	80,810,261.81	6.29
5	603083	剑桥科技	76,842,843.94	5.98
6	002552	宝鼎科技	76,754,054.92	5.98
7	688498	源杰科技	75,015,670.01	5.84
8	002245	蔚蓝锂芯	74,767,727.39	5.82
9	300302	同有科技	70,633,061.34	5.50
10	300903	科翔股份	68,133,088.69	5.31
11	300806	斯迪克	67,373,883.43	5.25
12	603256	宏和科技	65,924,868.00	5.13
13	300975	商络电子	62,202,185.75	4.84
14	301217	铜冠铜箔	62,119,530.22	4.84
15	300738	奥飞数据	61,692,530.43	4.80
16	603629	利通电子	61,302,668.00	4.77
17	605376	博迁新材	58,959,768.01	4.59
18	002957	科瑞技术	58,382,512.21	4.55
19	002440	闰土股份	56,157,433.35	4.37
20	603061	金海通股份	54,303,637.85	4.23
21	688766	普冉半导体	53,413,944.33	4.16
22	688548	广钢气体股份	51,712,470.52	4.03
23	300323	华灿光电	51,538,805.58	4.01
24	688549	中巨芯科技	51,310,808.99	4.00
25	301550	斯菱智驱	50,806,091.84	3.96
26	301500	飞南资源	50,490,181.14	3.93
27	688167	西安炬光科技	49,754,577.24	3.87
28	002975	博杰股份	46,931,221.50	3.65
29	300620	光库科技	44,040,366.14	3.43
30	002824	和胜股份	43,957,729.00	3.42
31	000811	冰轮环境	43,336,313.40	3.37
32	301095	广立微	42,920,377.20	3.34
33	688031	星环科技	40,487,337.41	3.15
34	688416	恒烁股份	40,433,460.88	3.15
35	301366	一博科技	39,807,782.00	3.10
36	301526	国际复材	39,697,263.34	3.09
37	301389	隆扬电子	39,028,768.58	3.04
38	002815	崇达技术	37,194,649.06	2.90
39	688003	天准科技	36,995,019.27	2.88
40	002132	恒星科技	36,992,447.00	2.88
41	301071	力量钻石	35,766,234.68	2.78
42	301150	中一科技	35,755,172.50	2.78
43	300953	震裕科技	35,753,153.40	2.78
44	002491	通鼎互联	35,582,535.00	2.77
45	603588	高能环境	34,781,962.40	2.71
46	600888	新疆众和	34,659,952.00	2.70

47	300145	南方泵业	34,378,691.00	2.68
48	002222	福晶科技	33,857,486.50	2.64
49	002297	博云新材	33,851,108.00	2.64
50	688409	富创精密	33,816,234.29	2.63
51	301171	易点天下	33,669,453.43	2.62
52	300913	兆龙互连	33,551,776.72	2.61
53	600206	有研新材	33,439,613.00	2.60
54	688258	江苏卓易信息科技	33,249,328.64	2.59
55	688270	ST 臻镭科技	33,075,967.14	2.58
56	301099	雅创电子	33,014,636.48	2.57
57	688337	普源精电	32,721,529.05	2.55
58	301382	蜂助手	32,618,451.40	2.54
59	300757	罗博特科	32,282,611.00	2.51
60	301566	达利凯普	32,272,322.32	2.51
61	300671	富满微	32,137,327.00	2.50
62	603986	兆易创新	32,056,209.64	2.50
63	300825	阿尔特	31,682,600.50	2.47
64	300857	协创数据	31,602,669.00	2.46
65	688107	安路科技	31,508,924.46	2.45
66	300166	东方国信	31,465,583.00	2.45
67	688146	中船派瑞特气	31,277,929.03	2.44
68	600105	永鼎股份	31,188,859.55	2.43
69	688400	凌云光技术	31,141,224.34	2.42
70	300308	中际旭创	31,023,400.00	2.42
71	688627	精智达技术	30,985,745.93	2.41
72	002283	天润工业	30,866,888.00	2.40
73	002645	华宏科技	30,738,424.80	2.39
74	300351	永贵电器	30,734,181.00	2.39
75	603890	春秋电子	30,372,231.76	2.36
76	300905	宝丽迪	30,168,414.18	2.35
77	300260	新莱应材	30,138,949.44	2.35
78	002008	大族激光	30,129,695.00	2.35
79	301123	奕东电子	29,852,143.95	2.32
80	000506	招金黄金	29,811,970.38	2.32
81	603093	南华期货	29,693,878.19	2.31
82	002851	麦格米特	29,130,182.78	2.27
83	300170	汉得信息	29,041,662.16	2.26
84	301018	申菱环境	28,925,714.80	2.25
85	603618	杭电股份	28,916,301.56	2.25
86	000603	盛达资源	28,850,761.98	2.25
87	688256	寒武纪科技	28,834,289.09	2.25
88	688141	杰华特微电子	28,427,813.90	2.21

89	601069	西部黄金	27,884,139.00	2.17
90	002428	云南锗业	27,537,216.80	2.14
91	300634	彩讯股份	27,484,254.00	2.14
92	301285	鸿日达	27,459,536.49	2.14
93	300257	开山股份	27,418,662.82	2.13
94	301316	慧博云通	27,203,624.00	2.12
95	300408	三环集团	27,134,612.25	2.11
96	688668	鼎通科技	27,042,685.80	2.11
97	600255	鑫科材料	27,040,880.82	2.11
98	002364	中恒电气	26,963,889.88	2.10
99	603220	中贝通信	26,863,188.76	2.09
100	688678	福立旺精密	26,786,041.71	2.09
101	300263	隆华科技	26,656,170.08	2.08
102	000758	中色股份	26,576,094.64	2.07
103	301369	联动科技	26,549,203.75	2.07
104	603002	宏昌电子	26,492,066.00	2.06
105	300613	富瀚微	26,462,492.00	2.06
106	300369	绿盟科技	26,359,251.00	2.05
107	688390	固德威电源	26,303,520.80	2.05
108	300821	东岳硅材	26,256,942.00	2.04
109	300488	恒锋工具	26,247,816.82	2.04
110	600596	新安股份	26,144,641.79	2.04
111	300409	道氏技术	26,125,747.11	2.03
112	300499	高澜股份	26,088,286.00	2.03
113	300310	宜通世纪	26,071,090.00	2.03
114	300438	鹏辉能源	25,941,800.85	2.02
115	300592	华凯易佰	25,900,226.00	2.02
116	600602	云赛智联	25,825,622.00	2.01
117	688535	华海诚科新材料	25,822,089.33	2.01
118	300602	飞荣达	25,731,472.31	2.00
119	688108	赛诺医疗科学	25,711,767.28	2.00

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	17,749,140,621.12
卖出股票收入（成交）总额	16,409,130,532.74

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）	708,071.38	0.02
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	708,071.38	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	113703	翔 26 转债	7,080	708,071.38	0.02

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

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，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人股指期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	3,054,600.00
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	30,496,224.89
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	33,550,824.89

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

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	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（%）
汇添富国证 2000 指数增强 A	31,395	34,331.02	369,383,10 1.26	34.27	708,439,29 1.22	65.73
汇添富国证 2000 指数增强 C	13,631	29,497.97	214,034,37 2.42	53.23	188,052,38 9.66	46.77
合计	45,026	32,867.88	583,417,47 3.68	39.42	896,491,68 0.88	60.58

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富国证 2000 指数增强 A	1,104,957.99	0.10
	汇添富国证 2000 指数增强 C	424,412.39	0.11
	合计	1,529,370.38	0.10

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富国证 2000 指数增强 A	0
	汇添富国证 2000 指数增强 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富国证 2000 指数增强 A	10~50
	汇添富国证 2000 指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富国证 2000 指数增强 A	汇添富国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 11 月 07 日）基金份额总额	163,516,463.32	157,781,577.54
本报告期期初基金份额总额	446,832,136.23	290,136,930.30
本报告期基金总申购份额	2,477,676,780.91	1,155,607,159.84
减：本报告期基金总赎回份额	1,846,686,524.66	1,043,657,328.06
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,077,822,392.48	402,086,762.08

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。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部总经理职务，另有任用。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强担任托管部副总经理（主持工作）；2026 年 6 月 10 日，任托管部总经理。

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。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

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，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
招商证券	3	20,847,104,052.60	61.03	3,746,960.86	61.04	
平安证券	3	7,307,055,336.98	21.39	1,312,842.76	21.39	
方正证券	3	6,002,064,100.88	17.57	1,078,480.10	17.57	

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 (%)
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

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,	2026 年 01 月 22 日

		深交所,上交所,上证报	
2	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
3	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
4	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
5	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
6	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国证 2000 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富国证 2000 指数增强型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、报告期内汇添富国证 2000 指数增强型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