

# 中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 07 月 21 日



§ 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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

|               |                                                                                                                                                                                                    |
|---------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称          | 汇添富中证主要消费 ETF                                                                                                                                                                                      |
| 场内简称          | 消费 ETF 汇添富                                                                                                                                                                                         |
| 基金主代码         | 159928                                                                                                                                                                                             |
| 基金运作方式        | 交易型开放式                                                                                                                                                                                             |
| 基金合同生效日       | 2013 年 08 月 23 日                                                                                                                                                                                   |
| 报告期末基金份额总额(份) | 23,320,629,040.00                                                                                                                                                                                  |
| 投资目标          | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                                                                                                                                                                          |
| 投资策略          | 本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编 |

|        |                                                                                                                                 |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 业绩比较基准 | 中证主要消费指数                                                                                                                        |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。                           |
| 基金管理人  | 汇添富基金管理股份有限公司                                                                                                                   |
| 基金托管人  | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                                    |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期(2026 年 04 月 01 日 – 2026 年 06 月 30 日) |
|----------------|------------------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | -906,888,983.91                          |
| 2.本期利润         | -3,116,559,464.07                        |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1263                                  |
| 4.期末基金资产净值     | 14,344,331,791.76                        |
| 5.期末基金份额净值     | 0.6151                                   |

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①－③    | ②－④    |
|--------------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个<br>月          | -17.37%      | 1.06%               | -18.63%            | 1.07%                     | 1.26%  | -0.01% |
| 过去六个<br>月          | -22.36%      | 1.17%               | -23.54%            | 1.18%                     | 1.18%  | -0.01% |
| 过去一年               | -22.54%      | 1.01%               | -24.89%            | 1.02%                     | 2.35%  | -0.01% |
| 过去三年               | -33.42%      | 1.29%               | -38.31%            | 1.30%                     | 4.89%  | -0.01% |
| 过去五年               | -51.19%      | 1.38%               | -55.80%            | 1.39%                     | 4.61%  | -0.01% |
| 过去七年               | -14.37%      | 1.46%               | -24.05%            | 1.47%                     | 9.68%  | -0.01% |
| 过去十年               | 76.93%       | 1.47%               | 49.68%             | 1.48%                     | 27.25% | -0.01% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 146.04%      | 1.56%               | 115.60%            | 1.58%                     | 30.44% | -0.02% |

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

汇添富中证主要消费ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 08 月 23 日）起 3 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                   | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限（年） | 说明                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|----------------------|------------------|------|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                      | 任职日期             | 离任日期 |           |                                                                                                                                                                                                                      |
| 过蓓蓓 | 本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监 | 2015 年 08 月 03 日 | —    | 15        | 国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2015 年 8 月 3 日至今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。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 13 日任中证金融地产交易型开 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>放式指数证<br/>券投资基金<br/>的基金经理。<br/>2015 年 8 月 3<br/>日至 2023 年<br/>4 月 6 日任中<br/>证能源交易<br/>型开放式指<br/>数证券投资<br/>基金的基金<br/>经理。2015<br/>年 8 月 3 日至<br/>今任中证医<br/>药卫生交易<br/>型开放式指<br/>数证券投资<br/>基金的基金<br/>经理。2015<br/>年 8 月 3 日至<br/>今任中证主<br/>要消费交易<br/>型开放式指<br/>数证券投资<br/>基金的基金<br/>经理。2015<br/>年 8 月 18 日<br/>至 2023 年 8<br/>月 29 日任汇<br/>添富深证 300<br/>交易型开放<br/>式指数证券<br/>投资基金联<br/>接基金的基<br/>金经理。2015<br/>年 8 月 18 日<br/>至 2023 年 5<br/>月 22 日任深<br/>证 300 交易<br/>型开放式指<br/>数证券投资<br/>基金的基金<br/>经理。2016<br/>年 12 月 22 日<br/>至今任汇添<br/>富中证生物<br/>科技主题指</p> |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2022 年 12 月 1 日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 10 月 23 日至 2023 年 5 月 22 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生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 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经</p> |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|



|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2023 年 5 月 18 日任汇添富中证 800 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 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日任汇添富国证生物医药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 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型</p> |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 2 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 3 月 14 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 3 月 30 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基</p> |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 金经理。2023 年 8 月 2 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）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。

4.1.1 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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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:

一、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。

二、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。

三、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。

四、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% 的次数为 1。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年二季度，A 股总体呈现“震荡上行、结构极致分化、成交持续放量”的特征。4 月初市场仍延续 3 月地缘冲突扰动后的修复过程，上证指数逐步回升至 6 月 30 日的 4094.40 点，区间明显抬升；成长风格修复更为显著，创业板相关成长风格指数一路走高至历史新高，显示资金风险偏好在二季度中后段持续回暖。从季度运行节奏看，市场大致经历了 4 月外部扰动下的震荡整固、5 月科技主线带动的放量上行、6 月高位波动中继三个阶段。随着风险偏好修复、产业景气验证加强以及政策对硬科技支持预期升温，市场定价逻辑逐步由估值修复转向盈利驱动。流动性与交投活跃度是二季度 A 股最突出的特征之一。全 A 成交额从 2

万亿水平持续抬升至 3.76 万亿元，两融余额也反映杠杆资金持续回流、市场参与深度提升，市场活跃度处于历史高位。这意味着二季度并非单纯存量博弈下的脉冲式反弹，而是具备较强资金承接力和持续交易热度的结构性强势市场。

从结构表现看，二季度 A 股的超额收益几乎集中于科技硬件、高端制造与部分涨价链方向，市场呈现典型“K 型分化”，多数传统大消费、顺周期板块仍然偏弱。这一分化背后，本质上是盈利景气、产业资本开支与宏观动能切换共同作用的结果。5 月高技术制造业增加值同比增长 15.1%，TMT 制造业三个月滚动盈利增速达到 83.4%，显著领先可选消费、必需消费和传统中游设备板块。

2026 年二季度国内宏观环境总体呈现“增长韧性仍在、内需偏弱、外需与新动能支撑突出、政策保持偏宽松但更强调结构性发力”的特征。二季度实际 GDP 的预测显示经济动能较一季度边际放缓，但并未失速。这一放缓的核心原因是地产拖累延续、消费恢复偏慢、固定资产投资再度承压，同时外部地缘扰动与前期“抢出口”效应的透支也对季度节奏形成扰动。政策层面，二季度宏观政策基调延续“更加积极的财政政策+适度宽松的货币政策”组合，但实际操作上更强调精准、结构性和节奏管理。货币政策方面体现出总量流动性已较充裕，政策重心更多转向科技创新、设备更新、服务消费、民营企业等领域的结构性支持。

二季度海外变量仍是资本市场波动的重要外生来源，其中中东地缘冲突、全球货币政策再定价、关税扰动边际缓和以及国际指数再平衡构成了对 A 股与港股影响最直接的四条主线。油价上行显著强化了全球“类滞胀”交易，对权益风险偏好形成压制；至 6 月中旬美伊确认阶段性停火、霍尔木兹海峡重开预期升温后，前期地缘溢价快速出清。与此同时，全球流动性边际上呈现由宽松转向收敛的特征。

二季度，中证消费一路下探至 2019 年初点位附近，指数市盈率 19 倍指数冲高回落，股息率 4.2%。整体表现远弱于大盘。统计数据显示，必选消费累计同比保持正增长、韧性强；两年复合增速显示粮油食品、日用品优于多数可选品类。持仓与交易层面，主要消费行业配置占比处于历史低位，交易结构恶化已体现，具备估值与持仓修复的潜在空间。下半年大宗商品成本压力渐显，饮料与家电对成本更敏感，考验企业提价与结构升级能力；渠道与餐饮链条修复将继续影响 B 端动销节奏与盈利释放。未来若居民增收与服务消费扩容政策逐步落地，叠加“更大力度提振消费”的政策预期强化，有助于改善市场对消费资产的悲观预期与估值锚。二季度板块指数回落为下半年结构性配置提供更优性价比窗口。

作为被动投资的指数基金，本基金在投资运作上严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略

略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-17.37%，同期业绩比较基准收益率为-18.63%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）             | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 14,272,036,761.73 | 98.94        |
|    | 其中：股票             | 14,272,036,761.73 | 98.94        |
| 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      | 149,020,735.00    | 1.03         |
| 8  | 其他资产              | 3,697,800.15      | 0.03         |
| 9  | 合计                | 14,424,755,296.88 | 100.00       |

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

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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         | 2,705,562,748.06  | 18.86        |
| B  | 采矿业              | —                 | —            |
| C  | 制造业              | 11,564,669,561.63 | 80.62        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —                 | —            |
| E  | 建筑业              | —                 | —            |
| F  | 批发和零售业           | —                 | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —                 | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —                 | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —                 | —            |
| J  | 金融业              | —                 | —            |
| K  | 房地产业             | —                 | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —                 | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —                 | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —                 | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —                 | —            |
| P  | 教育               | —                 | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —                 | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —                 | —            |
| S  | 综合               | —                 | —            |
|    | 合计               | 14,270,232,309.69 | 99.48        |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —            | —            |
| B  | 采矿业              | —            | —            |
| C  | 制造业              | 1,811,751.86 | 0.01         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —            | —            |
| E  | 建筑业              | —            | —            |

|   |                 |              |      |
|---|-----------------|--------------|------|
| F | 批发和零售业          | -            | -    |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 1,583.46     | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业          | -            | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | -            | -    |
| J | 金融业             | -            | -    |
| K | 房地产业            | -            | -    |
| L | 租赁和商务服务业        | -            | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      | -            | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -            | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -            | -    |
| P | 教育              | -            | -    |
| Q | 卫生和社会工作         | -            | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -            | -    |
| S | 综合              | -            | -    |
|   | 合计              | 1,813,335.32 | 0.01 |

5.2.3 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。

5.3 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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）      | 公允价值<br>（元）      | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|------|------------|------------------|----------------------|
| 1  | 600887 | 伊利股份 | 59,466,674 | 1,424,821,509.04 | 9.93                 |



|    |        |       |            |                      |      |
|----|--------|-------|------------|----------------------|------|
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 1,194,517  | 1,416,087,95<br>8.33 | 9.87 |
| 3  | 000858 | 五 粮 液 | 18,861,678 | 1,395,764,17<br>2.00 | 9.73 |
| 4  | 002714 | 牧原股份  | 37,306,383 | 1,305,350,34<br>1.17 | 9.10 |
| 5  | 300498 | 温氏股份  | 72,702,851 | 895,699,124.<br>32   | 6.24 |
| 6  | 000568 | 泸州老窖  | 10,051,091 | 779,160,574.<br>32   | 5.43 |
| 7  | 603288 | 海天味业  | 22,786,749 | 755,608,596.<br>84   | 5.27 |
| 8  | 600809 | 山西汾酒  | 6,666,253  | 729,088,090.<br>61   | 5.08 |
| 9  | 002311 | 海大集团  | 11,239,056 | 501,374,288.<br>16   | 3.50 |
| 10 | 605499 | 东鹏饮料  | 3,697,651  | 456,401,062.<br>93   | 3.18 |

5.3.2报告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前五名股票  
投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值<br>（元） | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|------|-------|-------------|----------------------|
| 1  | 301666 | 大普微  | 1,220 | 565,262.60  | 0.00                 |
| 2  | 688820 | 盛合晶微 | 2,391 | 338,302.59  | 0.00                 |
| 3  | 001399 | 惠科股份 | 6,488 | 179,912.24  | 0.00                 |

|   |        |             |       |            |      |
|---|--------|-------------|-------|------------|------|
| 4 | 688818 | 中电科蓝天<br>科技 | 1,717 | 120,430.38 | 0.00 |
| 5 | 301682 | 宏明电子        | 714   | 114,282.84 | 0.00 |

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

注:本基金本报告期末未持有债券。

**5.5 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债券投资明细**

注:本基金本报告期末未持有债券。

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资  
投资明细**

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

**5.11 投资组合报告附注**

**5.11.1**

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。

**5.11.2**

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 3,697,800.15 |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | —            |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 3,697,800.15 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 301666 | 大普微  | 565,262.60     | 0.00         | 新股流通受限   |
| 2  | 688820 | 盛合晶微 | 338,302.59     | 0.00         | 新股流通受限   |
| 3  | 001399 | 惠科股份 | 179,912.24     | 0.00         | 新股流通受    |

|   |        |         |            |      |        |
|---|--------|---------|------------|------|--------|
|   |        |         |            |      | 限      |
| 4 | 688818 | 中电科蓝天科技 | 120,430.38 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 5 | 301682 | 宏明电子    | 114,282.84 | 0.00 | 新股流通受限 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

|               |                   |
|---------------|-------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 26,860,629,040.00 |
| 本报告期基金总申购份额   | 3,294,000,000.00  |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 6,834,000,000.00  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额  | 23,320,629,040.00 |

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                    |      |      |      | 报告期末持有基金情况 |         |
|-------|----------------|--------------------|------|------|------|------------|---------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比（%） |
|       |                |                    |      |      |      |            |         |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |   | 的时间区<br>间                                |                      |                    |                    |                      |       |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|------------------------------------------|----------------------|--------------------|--------------------|----------------------|-------|
| 中国工商<br>银行股份<br>有限公司<br>－汇添富<br>中证主要<br>消费交易<br>型开放式<br>指数证券<br>投资基金<br>联接基金                                                                                                                                                                                                                                          | 1 | 2026 年 4<br>月 1 日至<br>2026 年 6<br>月 30 日 | 6,467,370<br>,104.00 | 515,000,0<br>00.00 | 419,000,0<br>00.00 | 6,563,370<br>,104.00 | 28.14 |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |   |                                          |                      |                    |                    |                      |       |
| <p>1、持有人大会投票权集中的风险</p> <p>当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。</p> |   |                                          |                      |                    |                    |                      |       |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

## 9.2 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

## 9.3 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](http://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 07 月 21 日