

汇添富上证综合指数证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
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.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	21
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.....	22
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.....	22
§ 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.....	23
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.....	23
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	23
6.1 资产负债表.....	23
6.2 利润表.....	24
6.3 净资产变动表.....	25
6.4 报表附注.....	27
§ 7 投资组合报告.....	53
7.1 期末基金资产组合情况.....	53
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.....	71
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.....	72
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.....	72
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.....	72

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.....	72
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12 投资组合报告附注.....	72
§ 8 基金份额持有人信息.....	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
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.....	74
§ 9 开放式基金份额变动.....	74
§ 10 重大事件揭示.....	75
10.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
10.4 基金投资策略的改变.....	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	76
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.....	76
10.8 其他重大事件.....	79
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
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.....	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
§ 12 备查文件目录.....	80
12.1 备查文件目录.....	80
12.2 存放地点.....	80
12.3 查阅方式.....	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合指数证券投资基金		
基金简称	汇添富上证综合指数		
基金主代码	470007		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2009 年 07 月 01 日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额（份）	841,548,386.93		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y
下属分级基金的交易代码	470007	018536	025883
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	731,986,102.71	106,182,442.67	3,379,841.55

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 6%，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。本基金的投资策略主要包括：资产配置、抽样股票组合构建、股票组合调整、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	上证综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	(010) 66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	(010) 66105798
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		鲁伟铭	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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)		
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y
本期已实现收益	38,591,652.99	3,416,677.56	92,840.02
本期利润	45,418,799.29	5,990,517.62	53,826.69
加权平均基金份额本期利润	0.0602	0.0810	0.0296
本期加权平均净值利润率	4.75%	6.49%	2.34%
本期基金份额净值增	4.61%	4.49%	4.93%

长率			
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	200,553,284.89	27,483,970.06	938,681.94
期末可供分配基金份额利润	0.2740	0.2588	0.2777
期末基金资产净值	932,539,387.60	133,666,412.73	4,318,523.49
期末基金份额净值	1.274	1.259	1.278
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	87.84%	31.58%	5.10%

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

汇添富上证综合指数 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	5.73%	0.90%	4.96%	0.89%	0.77%	0.01%
过去六个月	4.61%	0.91%	3.04%	0.91%	1.57%	0.00%
过去一年	19.98%	0.77%	17.92%	0.79%	2.06%	-0.02%
过去三年	35.17%	0.93%	26.59%	0.95%	8.58%	-0.02%
过去五年	25.78%	0.92%	13.69%	0.94%	12.09%	-0.02%
过去七年	60.80%	0.96%	36.03%	0.97%	24.77%	-0.01%
过去十年	86.66%	0.95%	38.52%	0.97%	48.14%	-0.02%
自基金合同生效起	87.84%	1.21%	38.76%	1.20%	49.08%	0.01%

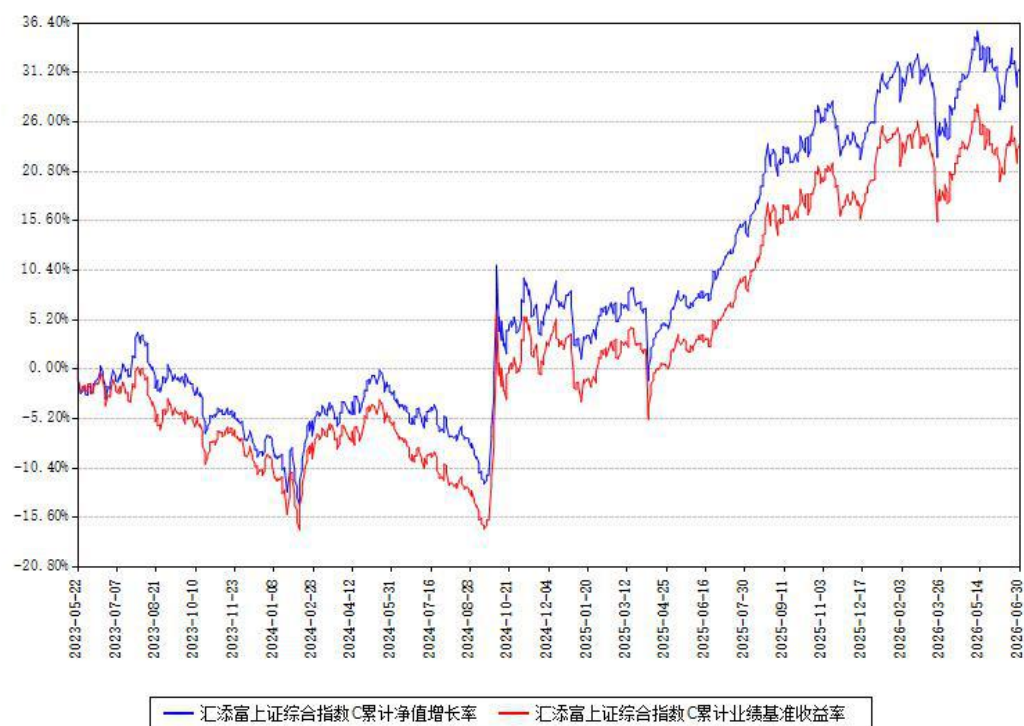
至今						
汇添富上证综合指数 C						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个 月	5.71%	0.90%	4.96%	0.89%	0.75%	0.01%
过去六个 月	4.49%	0.91%	3.04%	0.91%	1.45%	0.00%
过去一年	19.59%	0.77%	17.91%	0.79%	1.68%	－0.02%
过去三年	33.46%	0.92%	26.59%	0.95%	6.87%	－0.03%
自基金合 同生效起 至今	31.58%	0.92%	23.61%	0.94%	7.97%	－0.02%
汇添富上证综合指数 Y						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个 月	5.88%	0.89%	4.96%	0.89%	0.92%	0.00%
过去六个 月	4.93%	0.91%	3.04%	0.91%	1.89%	0.00%
自基金合 同生效起 至今	5.10%	0.83%	3.39%	0.84%	1.71%	－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

汇添富上证综合指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数Y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（2009 年 07 月 01 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。

本基金于 2023 年 05 月 19 日新增 C 类份额，于 2025 年 10 月 31 日新增 Y 类份额。

§ 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 部副总监	2010 年 02 月 06 日	—	20	国籍：中国。 学历：中国科 学技术大学 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。
--	--	--	--	--	---

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

二季度我国经济延续温和修复态势，结构上依然体现出“内需疲软、外需强劲，且生产强于消费”的特点，投资分项中的地产仍然是主要拖累项。政策端维持积极基调，财政发力前置，基建投资托底；货币政策保持宽松，两次降准落地，但信贷结构偏向企业端，居民加杠杆意愿不足。整体看，上半年 GDP 增速基本符合目标，但通缩压力未消，经济修复的均衡性有待提升。

上半年全球主线是“地缘冲击+政策分化”。2 月 28 日，美以突然对伊朗发动联合军事打击，伊朗最高领袖在首轮空袭中身亡，伊朗随后关闭霍尔木兹海峡并进行军事反击，全球约 20% 的原油运输受阻，布伦特原油在 3 月一度突破 110 美元/桶，各国紧急释放战略石油储备。3 月下旬起冲突出现缓和迹象，6 月中旬双方签署谅解备忘录，油价回落至接近 3 月初水平，但彻底解决仍存不确定性。美联储上半年维持利率不变，5 月新主席就任，6 月放弃前瞻指引，市场加息预期从不足一次跳升至一到两次，对全球流动性预期形成冲击。

上半年 A 股受地缘因素影响出现较大波动，二季度开始地缘冲突逐步缓解，市场对相关事件的敏感性也有所淡化。市场表现出极强的结构化特征，高度聚焦于人工智能产业相关的细分领域，以信息技术相关的芯片设计、半导体材料设备、通信设备为主。中证 800 指数上半年小幅上涨 11.1%，主要宽基指数的行业构成中，电子、计算机、通信等 AI 相关的信息技术类上市公司权重占比出现显著提升，一定程度上反映了资本市场对整体产业转型趋势的动态表征。

上半年港股同样体现出极强的结构化特征。科技类资产在港股的 IPO 加速，已有 AI 产业链核心的大模型公司在港股上市并陆续入通。头部互联网公司主要受传统消费类业务拖累，业绩表现不及预期，尽管 AI 相关的云业务依然突出，但股价是公司整体价值的反映，难以剥离其中 AI 贡献，当前此类公司估值进一步进入性价比较高的区间。与 AI 更为相关的资产则在 4 月以来表现强劲，与 A 股同类资产表现趋同。

上证综合指数是 A 股市场代表性宽基指数，本基金则是这一代表性指数的产品化形式，为投资者提供了整体配置国内权益资产的优质工具。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富上证综合指数 A 类份额净值增长率为 4.61%，同期业绩比较基准收益率为 3.04%。本报告期汇添富上证综合指数 C 类份额净值增长率为 4.49%，同期业绩比较基准收益率为 3.04%。本报告期汇添富上证综合指数 Y 类份额净值增长率为 4.93%，同期业绩比较基准收益率为 3.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，板块之间的结构分化差异过大，市场可能出现“再平衡”。但长期来看，国际竞争加剧、地缘冲突难以彻底解决，我国对科技领域的投入或将进一步加强，从而加快国产化进度、保障供应链安全。市场整体也容易因为科技板块行情上涨、IPO 增加而出现结构性变化，一定程度上也代表了市场逐渐在这个方向上形成了一定的共识。科技板块波动加大是难以避免的。市场参与者需要认清长期投资价值和短期波动之间的差异及其成因，从而争取获得长期投资收益。

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：收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转帐或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额；本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次至少将可供分配利润的 20% 进行收益分配；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按除权日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红，Y 类基金份额默认的收益分配方式是红利再投资；在符合上述基金收益分配的前提下，每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20% 进行收益分配，且在收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）之后的 15 个工作日之内完成；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。

本报告期内，本基金于 2026 年 01 月 15 日实施利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.600 元人民币；C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.600 元人民币；Y 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.600 元人民币。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	32,572,817.08	53,477,433.10
结算备付金		99,989.88	249,427.95
存出保证金		95,865.44	62,134.29
交易性金融资产	6.4.7.2	1,038,860,757.38	962,229,296.62
其中：股票投资		1,014,204,744.56	962,229,296.62
基金投资		—	—
债券投资		24,656,012.82	—
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		1,078,062.24	2,615,238.57

应收股利		-	-
应收申购款		2,438,236.20	947,253.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,075,145,728.22	1,019,580,783.92
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		3,680,002.82	4,199,078.29
应付管理人报酬		648,526.21	648,729.03
应付托管费		129,705.22	129,745.75
应付销售服务费		36,504.01	22,630.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		902.83	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	125,763.31	304,062.74
负债合计		4,621,404.40	5,304,246.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	841,548,386.93	795,503,108.25
未分配利润	6.4.7.9	228,975,936.89	218,773,429.50
净资产合计		1,070,524,323.82	1,014,276,537.75
负债和净资产总计		1,075,145,728.22	1,019,580,783.92

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 841,548,386.93 份。本基金下属汇添富上证综合指数 A 基金份额净值 1.274 元，基金份额总额 731,986,102.71 份；本基金下属汇添富上证综合指数 C 基金份额净值 1.259 元，基金份额总额 106,182,442.67 份；本基金下属汇添富上证综合指数 Y 基金份额净值 1.278 元，基金份额总额 3,379,841.55 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日 至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
-----	-----	---	--

一、营业总收入		56,411,124.38	37,328,124.17
1.利息收入		65,191.08	91,137.13
其中：存款利息收入	6.4.7.10	65,191.08	91,137.13
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）		46,695,495.85	46,859,225.52
其中：股票投资收益	6.4.7.11	36,762,551.73	32,196,724.00
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	146,552.62	48,589.81
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	9,786,391.50	14,613,911.71
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	9,361,973.03	-9,829,102.28
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	288,464.42	206,863.80
减：二、营业总支出		4,947,980.78	4,750,488.04
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,898,555.22	3,770,682.96
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	779,711.02	754,136.54
3. 销售服务费		182,595.24	139,157.22
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		527.61	-
8. 其他费用	6.4.7.21	86,591.69	86,511.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		51,463,143.60	32,577,636.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		51,463,143.60	32,577,636.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		51,463,143.60	32,577,636.13

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	795,503,108.25	218,773,429.50	1,014,276,537.75
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	795,503,108.25	218,773,429.50	1,014,276,537.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	46,045,278.68	10,202,507.39	56,247,786.07
（一）、综合收益总额	-	51,463,143.60	51,463,143.60
（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）	46,045,278.68	5,138,401.47	51,183,680.15
其中：1.基金申购款	431,065,284.25	106,992,263.84	538,057,548.09
2.基金赎回款	-385,020,005.57	-101,853,862.37	-486,873,867.94
（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）	-	-46,399,037.68	-46,399,037.68
四、本期期末净资产	841,548,386.93	228,975,936.89	1,070,524,323.82
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	962,457,344.94	125,444,944.90	1,087,902,289.84
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	962,457,344.94	125,444,944.90	1,087,902,289.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-69,887,266.00	-1,333,656.45	-71,220,922.45

（一）、综合收益总额	-	32,577,636.13	32,577,636.13
（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）	-69,887,266.00	-7,782,416.06	-77,669,682.06
其中：1.基金申购款	255,614,255.94	22,551,248.27	278,165,504.21
2.基金赎回款	-325,501,521.94	-30,333,664.33	-355,835,186.27
（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）	-	-26,128,876.52	-26,128,876.52
四、本期期末净资产	892,570,078.94	124,111,288.45	1,016,681,367.39

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：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富上证综合指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2009〕371 号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》准予注册，由汇添富基金管理有限公司（现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 2009 年 7 月 1 日生效。首次设立基金募集规模为 9,097,758,651.47 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（2009）验字第 60466941_B02 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自 2023 年 5 月 19 日起，本基金增设 C 类基金份额，原基金份额变更为 A 类基金份额。

自 2025 年 10 月 31 日起，本基金增设 Y 类基金份额。

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	32,572,817.08
等于：本金	32,569,471.66
加：应计利息	3,345.42
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	32,572,817.08

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		861,890,758.75	-	1,014,204,744.56	152,313,985.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	24,435,842.00	238,932.82	24,656,012.82	-18,762.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	24,435,842.00	238,932.82	24,656,012.82	-18,762.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		886,326,600.75	238,932.82	1,038,860,757.38	152,295,223.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,075.93
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	36,401.06
其中：交易所市场	36,401.06
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	26,778.95
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	125,763.31

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富上证综合指数 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	748,722,186.10	748,722,186.10
本期申购	186,980,240.40	186,980,240.40
本期赎回（以“-”号填列）	-203,716,323.79	-203,716,323.79
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	731,986,102.71	731,986,102.71
汇添富上证综合指数 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	46,751,625.08	46,751,625.08
本期申购	239,640,731.42	239,640,731.42
本期赎回（以“-”号填列）	-180,209,913.83	-180,209,913.83
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	106,182,442.67	106,182,442.67
汇添富上证综合指数 Y		
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	29,297.07	29,297.07
本期申购	4,444,312.43	4,444,312.43
本期赎回（以“-”号填列）	-1,093,767.95	-1,093,767.95
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	3,379,841.55	3,379,841.55

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

汇添富上证综合指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	393,346,975.13	-186,900,445.52	206,446,529.61
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	393,346,975.13	-186,900,445.52	206,446,529.61
本期利润	38,591,652.99	6,827,146.30	45,418,799.29
本期基金份额交易产生的变动数	-9,654,928.87	2,200,084.44	-7,454,844.43
其中：基金申购款	92,061,818.48	-43,966,612.48	48,095,206.00
基金赎回款	-101,716,747.35	46,166,696.92	-55,550,050.43
本期已分配利润	-43,857,199.58	-	-43,857,199.58
本期末	378,426,499.67	-177,873,214.78	200,553,284.89
汇添富上证综合指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,012,186.92	-11,693,386.10	12,318,800.82
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	24,012,186.92	-11,693,386.10	12,318,800.82

本期利润	3,416,677.56	2,573,840.06	5,990,517.62
本期基金份额交易产生的变动数	28,447,071.45	-16,740,177.31	11,706,894.14
其中：基金申购款	115,750,164.42	-58,036,917.62	57,713,246.80
基金赎回款	-87,303,092.97	41,296,740.31	-46,006,352.66
本期已分配利润	-2,532,242.52	-	-2,532,242.52
本期末	53,343,693.41	-25,859,723.35	27,483,970.06
汇添富上证综合指数 Y			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,411.66	-7,312.59	8,099.07
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	15,411.66	-7,312.59	8,099.07
本期利润	92,840.02	-39,013.33	53,826.69
本期基金份额交易产生的变动数	1,661,366.64	-775,014.88	886,351.76
其中：基金申购款	2,208,933.45	-1,025,122.41	1,183,811.04
基金赎回款	-547,566.81	250,107.53	-297,459.28
本期已分配利润	-9,595.58	-	-9,595.58
本期末	1,760,022.74	-821,340.80	938,681.94

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	62,547.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	967.71
其他	1,676.09
合计	65,191.08

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	217,510,770.01
减：卖出股票成本总额	180,533,951.43
减：交易费用	214,266.85
买卖股票差价收入	36,762,551.73

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	146,552.62
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	146,552.62

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

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,786,391.50
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	9,786,391.50

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	9,361,973.03
——股票投资	9,380,735.03
——债券投资	-18,762.00
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
——期货投资	—
3.其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	9,361,973.03

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	288,464.42
替代损益	—
其他	—
合计	288,464.42

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	26,778.95

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	—
银行费用	227.00
指数使用费	—
登记结算服务费	—
IOPV 计算与发布费	—
持有人大会—公证费	—
持有人大会—律师费	—
开户费	—
上市费	—
或有管理费	—
其他	78.37
合计	86,591.69

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

本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告和实施的利润分配的情况如下：

本基金向截止 2026 年 07 月 16 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，汇添富上证综合指数 A 份额每 10 份基金份额派发红利 0.5600 元；汇添富上证综合指数 C 份额每 10 份基金份额派发红利 0.5600 元；汇添富上证综合指数 Y 份额每 10 份基金份额派发红利 0.5600 元。

截至财务报表批准日，除上述事项外，本基金无其他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
中国工商银行股份有限公司 ("工商银行")	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 (%)
东方证券	-	-	47,194,544.13	6.84

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 (%)

	-	-	-	-
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（%）
东方证券	8,301.98	6.84	-	-

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	3,898,555.22	3,770,682.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,444,303.16	1,310,168.18
应支付基金管理人的净管理费	2,454,252.06	2,460,514.78

注：本基金各类基金份额的管理费按前一日该类基金份额的基金资产净值的年管理费率计提。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的年管理费率为 0.75%，Y 类基金份额的年管理费率为 0.375%。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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	779,711.02	754,136.54

注：本基金各类基金份额的托管费按前一日该类基金份额的基金资产净值的年托管费率计提。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的年托管费率为 0.15%，Y 类基金份额的年托管费率为 0.075%。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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			
	汇添富上证综合 指数 A	汇添富上证综合 指数 C	汇添富上证综合 指数 Y	合计
汇添富基金管理股份有限公司	—	9,426.92	—	9,426.92
东方证券股份有限公司	—	108.73	—	108.73
合计	—	9,535.65	—	9,535.65
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			
	汇添富上证综合 指数 A	汇添富上证综合 指数 C	汇添富上证综合 指数 Y	合计
汇添富基金管理股份有限公司	—	4,921.70	—	4,921.70
东方证券股份有限公司	—	17.25	—	17.25
合计	—	4,938.95	—	4,938.95

注：本基金 A 类基金份额、Y 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.4%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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
工商银行	32,572,817.08	62,547.28	79,788,710.40	90,085.46

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

单位：人民币元

汇添富上证综合指数 A								
序号	权益登 记日	除息日		每 10 份 基金份 额分红 数	现金形 式发放 总额	再投资 形式发 放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 01 月 15 日		2026 年 01 月 15 日	0.6000	25,991, 741.42	17,865, 458.16	43,857, 199.58	
合计	—	—		0.6000	25,991, 741.42	17,865, 458.16	43,857, 199.58	
汇添富上证综合指数 C								
序号	权益登 记日	除息日		每 10 份 基金份 额分红 数	现金形 式发放 总额	再投资 形式发 放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 01 月 15 日		2026 年 01 月 15 日	0.6000	2,190,9 56.31	341,286 .21	2,532,2 42.52	
合计	—	—		0.6000	2,190,9 56.31	341,286 .21	2,532,2 42.52	
汇添富上证综合指数 Y								
序号	权益登	除息日		每 10 份	现金形	再投资	本期利	备注

	记日	场内	场外	基金份 额分红 数	式发放 总额	形式发 放总额	润分配 合计	
1	2026 年 01 月 15 日		2026 年 01 月 15 日	0.6000	-	9,595.5 8	9,595.5 8	
合计	-	-		0.6000	-	9,595.5 8	9,595.5 8	

注：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
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	
603284	林平发展	2026 年 02 月 03 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	
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	
60343	嘉德	2026	6 个	新股	15.76	46.71	104	1,639.	4,857.	

5	利	年 05 月 15 日	月	流通 受限				04	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	27,82 5.60	
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	10,33 1.37	
688785	恒运昌股份	2026 年 01 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	92.18	463.1 5	116	10,69 2.88	53,72 5.40	
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	44.56	468.6 7	207	9,223. 92	97,01 4.69	
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	20,12 4.42	
688813	泰金新能	2026 年 03 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	26.28	172.0 9	234	6,149. 52	40,26 9.06	
688818	中电科蓝天科技	2026 年 02 月 03 日	6 个月	新股 流通 受限	9.47	70.14	1,717	16,25 9.99	120,4 30.38	
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个月	新股 流通 受限	19.68	141.4 9	1,622	31,92 0.96	229,4 96.78	
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

					-	-	-	-	-	
--	--	--	--	--	---	---	---	---	---	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 07 月 13 日	890.99	3,800	1,379,422.52	3,342,214.00	

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	32,572,817.08	-	-	-	-	-	32,572,817.08
结算备付金	99,989.88	-	-	-	-	-	99,989.88
存出保证金	95,865.44	-	-	-	-	-	95,865.44
交易性金融资产	-	-	24,656,012.82	-	-	1,014,204,744.56	1,038,860,757.38
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,078,062.24	1,078,062.24
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,438,236.20	2,438,236.20
递延所得	-	-	-	-	-	-	-

税资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	32,768,67 2.40	-	24,656,01 2.82	-	-	1,017,721 ,043.00	1,075,145 ,728.22
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	-	-	-	-	-	3,680,002 .82	3,680,002 .82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	648,526.2 1	648,526.2 1
应付托管费	-	-	-	-	-	129,705.2 2	129,705.2 2
应付销售服务费	-	-	-	-	-	36,504.01	36,504.01
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	902.83	902.83
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	125,763.3 1	125,763.3 1
负债总计	-	-	-	-	-	4,621,404 .40	4,621,404 .40
利率敏感度缺口	32,768,67 2.40	-	24,656,01 2.82	-	-	1,013,099 ,638.60	1,070,524 ,323.82
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	53,477,43 3.10	-	-	-	-	-	53,477,43 3.10
结算备付	249,427.9	-	-	-	-	-	249,427.9

金	5						5
存出保证金	62,134.29	-	-	-	-	-	62,134.29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	962,229,296.62	962,229,296.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,615,238.57	2,615,238.57
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	947,253.39	947,253.39
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	53,788,995.34	-	-	-	-	965,791,788.58	1,019,580,783.92
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	-	-	-	-	-	4,199,078.29	4,199,078.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	648,729.03	648,729.03
应付托管费	-	-	-	-	-	129,745.75	129,745.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	22,630.36	22,630.36
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	-	-	-	-	-	304,062.74	304,062.74
负债总计	-	-	-	-	-	5,304,246.17	5,304,246.17
利率敏感度缺口	53,788,995.34	-	-	-	-	960,487,542.41	1,014,276,537.75

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

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况; 2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点,且除利率之外的其他市场变量保持不变; 3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动; 4.银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息,假定利率变动仅影响该类资产的未来收益,而对其本身的公允价值无重大影响;定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定,不受利率变化影响; 5.该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
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
	基准利率减少 25 个基点	17,849.71	-
	基准利率增加 25 个基点	-17,823.64	-

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	1,014,204,744.56	94.74	962,229,296.62	94.87
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产－债券投资	24,656,012.82	2.30	—	—
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	1,038,860,757.38	97.04	962,229,296.62	94.87

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险,即从长期来看,本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关,且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变; 2.以下分析中,除市场基准发生变动,其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	上证综合指数上涨 5%	50,783,065.57	45,993,174.15
	上证综合指数下跌 5%	-50,783,065.57	-45,993,174.15

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	1,010,219,448.25
第二层次	27,998,226.82
第三层次	643,082.31
合计	1,038,860,757.38

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	1,014,204,744.56	94.33
	其中：股票	1,014,204,744.56	94.33
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	24,656,012.82	2.29
	其中：债券	24,656,012.82	2.29
	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	32,672,806.96	3.04
8	其他各项资产	3,612,163.88	0.34
9	合计	1,075,145,728.22	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	1,365,885.80	0.13
B	采矿业	77,160,579.88	7.21
C	制造业	501,956,038.41	46.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,668,293.38	3.71
E	建筑业	11,545,040.48	1.08
F	批发和零售业	11,858,152.60	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	30,998,232.30	2.90
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	78,153,509.12	7.30
J	金融业	213,106,556.68	19.91
K	房地产业	9,766,463.67	0.91
L	租赁和商务服务业	3,590,683.55	0.34
M	科学研究和技术服务业	14,970,592.71	1.40
N	水利、环境和公共设施管理业	7,860,650.52	0.73

O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,007,670.00	0.09
Q	卫生和社会工作	740,921.72	0.07
R	文化、体育和娱乐业	1,954,075.00	0.18
S	综合	484,946.00	0.05
	合计	1,006,188,291.82	93.99

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	7,086,035.62	0.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	930,417.12	0.09
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	8,016,452.74	0.75

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	601288	农业银行	6,337,373	38,467,854.11	3.59
2	601988	中国银行	5,402,872	30,904,427.84	2.89
3	601857	中国石油	2,735,657	23,745,502.76	2.22
4	600519	贵州茅台	19,829	23,507,081.21	2.20
5	601138	工业富联	311,300	22,460,295.00	2.10
6	688256	寒武纪科技	12,071	19,259,884.05	1.80
7	688041	海光信息	36,097	13,366,719.10	1.25
8	600036	招商银行	346,115	12,287,082.50	1.15
9	601628	中国人寿	344,871	12,191,189.85	1.14
10	601088	中国神华	283,115	11,052,809.60	1.03
11	603629	利通电子	61,700	11,032,577.00	1.03
12	600183	生益科技	62,253	10,794,670.20	1.01
13	600900	长江电力	406,511	10,760,346.17	1.01
14	605376	博迁新材	36,800	9,983,840.00	0.93
15	601318	中国平安	184,923	8,828,224.02	0.82
16	688172	燕东微电子股份	102,994	8,616,478.04	0.80
17	601899	紫金矿业	334,842	8,417,927.88	0.79
18	601658	邮储银行	1,561,668	7,699,023.24	0.72
19	603259	药明康德	60,620	7,547,796.20	0.71
20	601328	交通银行	1,158,517	7,449,264.31	0.70
21	688012	中微半导体设备	15,582	7,300,167.00	0.68
22	600028	中国石化	1,600,977	7,140,357.42	0.67
23	601728	中国电信	1,334,100	6,923,979.00	0.65
24	688549	中巨芯科技	182,015	6,699,972.15	0.63
25	688008	澜起科技	20,776	6,438,482.40	0.60

26	688200	华峰测控	12,207	6,409,895.70	0.60
27	601166	兴业银行	367,806	6,090,867.36	0.57
28	600030	中信证券	211,850	6,086,450.50	0.57
29	688521	芯原微电子	15,258	5,662,854.12	0.53
30	600276	恒瑞医药	102,992	5,359,703.68	0.50
31	600549	厦门钨业	62,300	5,307,960.00	0.50
32	603993	洛阳钼业	292,639	5,135,814.45	0.48
33	688001	苏州华兴源 创科技	58,009	4,971,371.30	0.46
34	600989	宝丰能源	242,700	4,934,091.00	0.46
35	688519	南亚新材料	12,902	4,903,276.08	0.46
36	600522	中天科技	78,873	4,786,013.64	0.45
37	603986	兆易创新	5,780	4,710,700.00	0.44
38	601998	中信银行	668,372	4,631,817.96	0.43
39	603989	艾华集团	86,700	4,551,750.00	0.43
40	600160	巨化股份	82,800	4,389,228.00	0.41
41	601066	中信建投	148,790	4,325,325.30	0.40
42	600406	国电南瑞	184,106	4,206,822.10	0.39
43	688515	裕太微电子	16,696	4,153,296.96	0.39
44	601211	国泰海通	223,539	4,068,409.80	0.38
45	600000	浦发银行	471,892	4,062,990.12	0.38
46	600584	长电科技	38,071	3,942,252.05	0.37
47	688419	耐科装备	49,291	3,876,737.15	0.36
48	688380	中微半导	57,561	3,793,845.51	0.35
49	601319	中国人保	561,100	3,793,036.00	0.35
50	601601	中国太保	131,278	3,744,048.56	0.35
51	605118	力鼎光电	100,900	3,520,401.00	0.33
52	688677	青岛海泰新 光	34,740	3,513,256.20	0.33
53	688002	睿创微纳	22,696	3,510,844.24	0.33
54	600309	万华化学	51,011	3,489,662.51	0.33
55	601225	陕西煤业	170,381	3,467,253.35	0.32
56	688295	中复神鹰碳 纤维	56,324	3,409,854.96	0.32
57	601816	京沪高铁	742,400	3,363,072.00	0.31
58	600919	江苏银行	310,540	3,347,621.20	0.31
59	688072	拓荆科技	3,800	3,342,214.00	0.31
60	601939	建设银行	344,011	3,312,825.93	0.31
61	603380	易德龙	71,700	3,232,953.00	0.30
62	688103	国力电子	42,409	3,155,653.69	0.29
63	603288	海天味业	93,660	3,105,765.60	0.29
64	688668	鼎通科技	8,245	3,077,858.50	0.29
65	688069	德林海环保	81,595	3,048,389.20	0.28

66	601919	中远海控	229,648	3,045,132.48	0.28
67	601668	中国建筑	690,385	2,996,270.90	0.28
68	601985	中国核电	331,400	2,992,542.00	0.28
69	600909	华安证券	265,050	2,944,705.50	0.28
70	603267	鸿远电子	37,700	2,920,996.00	0.27
71	601336	新华保险	47,355	2,825,199.30	0.26
72	600641	先导基电	70,720	2,818,899.20	0.26
73	688512	慧智微电子	172,806	2,759,711.82	0.26
74	600999	招商证券	130,786	2,759,584.60	0.26
75	600176	中国巨石	37,300	2,718,424.00	0.25
76	603678	火炬电子	32,700	2,714,100.00	0.25
77	688207	格灵深瞳	134,650	2,706,465.00	0.25
78	601818	光大银行	935,967	2,704,944.63	0.25
79	600025	华能水电	301,000	2,675,890.00	0.25
80	600887	伊利股份	111,361	2,668,209.56	0.25
81	601005	重庆钢铁	2,282,300	2,647,468.00	0.25
82	688052	纳芯微电子	9,000	2,594,790.00	0.24
83	600497	驰宏锌锗	211,485	2,561,083.35	0.24
84	601012	隆基绿能	191,159	2,508,006.08	0.23
85	688702	盛科通信	6,200	2,417,938.00	0.23
86	688981	中芯国际	15,212	2,415,969.84	0.23
87	688188	上海柏楚电 子科技	22,636	2,415,261.20	0.23
88	688261	东微半导体	22,981	2,411,396.33	0.23
89	601009	南京银行	242,376	2,397,098.64	0.22
90	601168	西部矿业	87,800	2,382,892.00	0.22
91	688020	方邦股份	9,341	2,331,513.60	0.22
92	600031	三一重工	132,994	2,298,136.32	0.21
93	600186	莲花控股	163,600	2,290,400.00	0.21
94	600690	海尔智家	111,700	2,279,797.00	0.21
95	600739	辽宁成大	222,200	2,246,442.00	0.21
96	600547	山东黄金	96,590	2,230,263.10	0.21
97	600936	北投科技	517,300	2,224,390.00	0.21
98	600150	中国船舶	65,476	2,212,434.04	0.21
99	603050	科林电气	112,200	2,194,632.00	0.21
100	601065	江西省盐业 集团	326,400	2,190,144.00	0.20
101	600875	东方电气	75,699	2,177,860.23	0.20
102	688027	科大国盾量 子	4,316	2,175,307.16	0.20
103	688158	优刻得科技	58,369	2,145,644.44	0.20
104	603501	豪威集团	22,620	2,145,507.00	0.20
105	688183	生益电子	16,090	2,130,316.00	0.20

106	601229	上海银行	244,506	2,122,312.08	0.20
107	600809	山西汾酒	19,367	2,118,168.79	0.20
108	601898	中煤能源	173,687	2,115,507.66	0.20
109	601366	利群股份	653,400	2,110,482.00	0.20
110	601766	中国中车	401,761	2,089,157.20	0.20
111	601633	长城汽车	136,325	2,057,144.25	0.19
112	600050	中国联通	512,242	2,048,968.00	0.19
113	603256	宏和科技	7,700	2,043,041.00	0.19
114	601958	金钼股份	72,000	2,023,920.00	0.19
115	600038	中直股份	79,800	2,018,142.00	0.19
116	600019	宝钢股份	370,443	2,011,505.49	0.19
117	688506	百利天恒药 业	6,800	1,999,404.00	0.19
118	603519	立霸股份	129,800	1,985,940.00	0.19
119	688182	灿勤科技	45,787	1,972,046.09	0.18
120	600089	特变电工	86,209	1,939,702.50	0.18
121	688213	思特威电子 科技	17,974	1,924,476.18	0.18
122	688681	科汇电力自 动化	137,035	1,915,749.30	0.18
123	603328	依顿电子	151,800	1,902,054.00	0.18
124	600104	上汽集团	193,600	1,889,536.00	0.18
125	600075	新疆天业	465,200	1,879,408.00	0.18
126	688629	四川华丰科 技	9,814	1,840,223.14	0.17
127	688259	创耀通信科 技	46,874	1,833,710.88	0.17
128	600029	南方航空	353,341	1,830,306.38	0.17
129	688508	芯朋微电子	19,653	1,826,942.88	0.17
130	600330	天通股份	58,800	1,813,392.00	0.17
131	600926	杭州银行	125,380	1,811,741.00	0.17
132	600699	均胜电子	83,600	1,806,596.00	0.17
133	603085	天成自控	165,600	1,800,072.00	0.17
134	600018	上港集团	380,790	1,797,328.80	0.17
135	603936	博敏电子	67,000	1,789,570.00	0.17
136	603893	瑞芯微	9,500	1,789,420.00	0.17
137	600760	中航沈飞	43,452	1,785,877.20	0.17
138	601600	中国铝业	216,965	1,783,452.30	0.17
139	603019	中科曙光	16,500	1,769,295.00	0.17
140	603661	恒林股份	43,880	1,755,200.00	0.16
141	600660	福耀玻璃	34,630	1,746,737.20	0.16
142	600115	中国东航	455,726	1,736,316.06	0.16
143	600116	三峡水利	307,900	1,724,240.00	0.16

144	600015	华夏银行	269,581	1,722,622.59	0.16
145	601169	北京银行	348,272	1,706,532.80	0.16
146	600886	国投电力	128,005	1,703,746.55	0.16
147	600905	三峡能源	458,300	1,700,293.00	0.16
148	601727	上海电气	242,100	1,694,700.00	0.16
149	600590	泰豪科技	167,200	1,688,720.00	0.16
150	601375	中原证券	420,100	1,676,199.00	0.16
151	600642	申能股份	190,680	1,664,636.40	0.16
152	601991	大唐发电	233,941	1,656,302.28	0.15
153	600166	福田汽车	566,500	1,648,515.00	0.15
154	600346	恒力石化	92,389	1,636,209.19	0.15
155	600489	中金黄金	90,243	1,628,886.15	0.15
156	601528	瑞丰银行	367,500	1,624,350.00	0.15
157	603005	晶方科技	30,100	1,621,487.00	0.15
158	601607	上海医药	104,995	1,616,923.00	0.15
159	688025	杰普特光电	3,400	1,598,000.00	0.15
160	600512	腾达建设	851,800	1,592,866.00	0.15
161	603323	苏农银行	410,919	1,590,256.53	0.15
162	605499	东鹏饮料	12,858	1,587,062.94	0.15
163	601688	华泰证券	75,960	1,566,295.20	0.15
164	688093	世华科技	42,437	1,565,925.30	0.15
165	600378	昊华科技	20,600	1,552,828.00	0.15
166	601877	正泰电器	61,562	1,543,359.34	0.14
167	688566	吉贝尔药业	60,095	1,537,831.05	0.14
168	688202	美迪西生物 医药	19,023	1,535,346.33	0.14
169	688063	派能科技	28,645	1,525,919.15	0.14
170	600893	航发动力	39,652	1,520,257.68	0.14
171	603916	苏博特	110,700	1,512,162.00	0.14
172	688111	金山办公	7,065	1,505,198.25	0.14
173	603167	渤海轮渡	175,300	1,502,321.00	0.14
174	600499	科达制造	108,800	1,501,440.00	0.14
175	600011	华能国际	196,196	1,489,127.64	0.14
176	688550	瑞联新材料	25,740	1,489,059.00	0.14
177	601995	中金公司	41,100	1,485,765.00	0.14
178	600210	紫江企业	238,900	1,481,180.00	0.14
179	600415	小商品城	145,400	1,477,264.00	0.14
180	600500	中化国际	188,600	1,476,738.00	0.14
181	688390	固德威电源	13,581	1,473,674.31	0.14
182	601669	中国电建	313,183	1,471,960.10	0.14
183	688114	华大智造	28,689	1,465,434.12	0.14
184	601881	中国银河	115,804	1,455,656.28	0.14
185	688123	聚辰半导体	6,800	1,445,680.00	0.14

186	600177	雅戈尔	191,591	1,442,680.23	0.13
187	600064	南京高科	202,200	1,441,686.00	0.13
188	688113	联测科技	40,769	1,430,991.90	0.13
189	600795	国电电力	305,728	1,427,749.76	0.13
190	600675	中华企业	691,300	1,424,078.00	0.13
191	600111	北方稀土	29,600	1,422,280.00	0.13
192	600716	凤凰股份	420,400	1,412,544.00	0.13
193	600098	广州发展	238,700	1,410,717.00	0.13
194	603317	天味食品	108,300	1,408,983.00	0.13
195	601127	赛力斯	23,000	1,408,750.00	0.13
196	600352	浙江龙盛	116,222	1,407,448.42	0.13
197	603160	汇顶科技	22,700	1,400,817.00	0.13
198	600332	白云山	69,177	1,386,307.08	0.13
199	601677	明泰铝业	83,500	1,386,100.00	0.13
200	601901	方正证券	191,800	1,380,960.00	0.13
201	603199	九华旅游	43,900	1,367,924.00	0.13
202	603797	联泰环保	363,700	1,363,875.00	0.13
203	603071	物产环能	123,100	1,361,486.00	0.13
204	601577	长沙银行	155,900	1,357,889.00	0.13
205	688077	大地熊新材料	51,131	1,354,460.19	0.13
206	601108	财通证券	156,350	1,352,427.50	0.13
207	688533	上声电子股份	64,354	1,342,424.44	0.13
208	688689	常州银河微电	20,719	1,340,933.68	0.13
209	600061	国投资本	203,313	1,331,700.15	0.12
210	688558	国盛智科股份	40,483	1,330,271.38	0.12
211	688023	安恒信息	36,177	1,328,419.44	0.12
212	601868	中国能建	496,874	1,326,653.58	0.12
213	603166	福达股份	99,100	1,324,967.00	0.12
214	688080	映翰通网络	30,481	1,318,303.25	0.12
215	601018	宁波港	418,374	1,317,878.10	0.12
216	603195	公牛集团	33,419	1,308,353.85	0.12
217	600563	法拉电子	6,800	1,297,440.00	0.12
218	603920	世运电路	27,000	1,297,080.00	0.12
219	603444	吉比特	3,600	1,290,312.00	0.12
220	603057	上海紫燕食品	57,800	1,288,940.00	0.12
221	600496	精工钢构	414,700	1,285,570.00	0.12
222	601880	辽港股份	923,500	1,274,430.00	0.12
223	688015	交控科技	82,455	1,268,157.90	0.12

224	688616	西力科技	125,327	1,265,802.70	0.12
225	600585	海螺水泥	74,581	1,264,147.95	0.12
226	601555	东吴证券	158,772	1,257,474.24	0.12
227	601226	华电科工	197,300	1,254,828.00	0.12
228	605020	永和股份	30,800	1,254,176.00	0.12
229	605168	三人行	24,600	1,245,744.00	0.12
230	688686	奥普特科技	7,396	1,245,412.44	0.12
231	688106	金宏气体	30,018	1,245,146.64	0.12
232	601963	重庆银行	123,000	1,239,840.00	0.12
233	600282	南钢股份	269,500	1,237,005.00	0.12
234	600741	华域汽车	79,250	1,229,960.00	0.11
235	600310	广西能源	289,100	1,220,002.00	0.11
236	605006	山东玻纤	57,600	1,214,784.00	0.11
237	600908	无锡银行	238,600	1,212,088.00	0.11
238	688799	华纳大药厂	26,902	1,207,092.74	0.11
239	603663	三祥新材	12,500	1,203,750.00	0.11
240	600188	兖矿能源	67,163	1,193,486.51	0.11
241	601390	中国中铁	285,428	1,190,234.76	0.11
242	603038	华立股份	75,600	1,179,360.00	0.11
243	600020	中原高速	319,300	1,178,217.00	0.11
244	688112	鼎阳科技	15,980	1,173,890.80	0.11
245	600016	民生银行	360,408	1,160,513.76	0.11
246	603118	共进股份	95,800	1,160,138.00	0.11
247	600037	歌华有线	184,400	1,156,188.00	0.11
248	600109	国金证券	131,470	1,154,306.60	0.11
249	600269	赣粤高速	289,100	1,150,618.00	0.11
250	601128	常熟银行	193,520	1,126,286.40	0.11
251	600004	白云机场	154,400	1,120,944.00	0.10
252	603187	海容冷链	97,320	1,118,206.80	0.10
253	601117	中国化学	151,827	1,115,928.45	0.10
254	688428	诺诚健华	38,044	1,083,112.68	0.10
255	600035	楚天高速	321,200	1,082,444.00	0.10
256	600048	保利发展	232,969	1,078,646.47	0.10
257	603799	华友钴业	22,000	1,061,720.00	0.10
258	603927	中科软	83,100	1,056,201.00	0.10
259	603379	三美股份	13,900	1,054,871.00	0.10
260	603197	保隆科技	37,600	1,050,544.00	0.10
261	601006	大秦铁路	227,344	1,048,055.84	0.10
262	600420	国药现代	131,400	1,044,630.00	0.10
263	600339	中油工程	338,600	1,039,502.00	0.10
264	688100	威胜信息	33,759	1,032,687.81	0.10
265	688416	恒烁股份	7,340	1,027,600.00	0.10
266	601101	昊华能源	96,300	1,016,928.00	0.09

267	688163	赛伦生物	20,690	1,009,878.90	0.09
268	600469	风神股份	185,500	1,009,120.00	0.09
269	688208	道通科技	40,024	1,008,204.56	0.09
270	688105	诺唯赞生物	58,035	1,006,907.25	0.09
271	600863	华能蒙电	213,800	1,004,860.00	0.09
272	600776	东方通信	76,300	1,002,582.00	0.09
273	688557	兰剑智能	32,042	994,263.26	0.09
274	600988	赤峰黄金	37,600	989,632.00	0.09
275	688653	康希通信	56,295	978,407.10	0.09
276	600392	盛和资源	32,600	970,502.00	0.09
277	603297	永新光学	6,600	969,870.00	0.09
278	688267	中触媒股份	49,130	967,861.00	0.09
279	601860	紫金银行	399,600	967,032.00	0.09
280	600961	株冶集团	29,800	965,222.00	0.09
281	603111	康尼机电	170,300	963,898.00	0.09
282	600803	新奥股份	61,000	963,800.00	0.09
283	600517	国网英大	205,400	961,272.00	0.09
284	600918	中泰证券	180,400	959,728.00	0.09
285	600032	浙江新能	135,500	955,275.00	0.09
286	601100	恒立液压	8,800	946,528.00	0.09
287	600997	开滦股份	197,000	935,750.00	0.09
288	688185	康希诺生物	18,244	930,261.56	0.09
289	688223	晶科能源	195,568	928,948.00	0.09
290	603885	吉祥航空	90,200	928,158.00	0.09
291	601997	贵阳银行	180,300	924,939.00	0.09
292	601825	沪农商行	123,400	924,266.00	0.09
293	688355	明志科技	47,960	923,230.00	0.09
294	603876	鼎胜新材	35,400	920,754.00	0.09
295	603558	健盛集团	82,900	919,361.00	0.09
296	603310	巍华新材	62,400	916,656.00	0.09
297	603311	金海高科	25,000	916,250.00	0.09
298	600995	南网储能	73,900	908,970.00	0.08
299	603105	芯能科技	132,900	905,049.00	0.08
300	603309	维力医疗	80,200	899,844.00	0.08
301	600623	华谊集团	111,200	897,384.00	0.08
302	603713	密尔克卫	12,500	889,625.00	0.08
303	600266	城建发展	226,800	886,788.00	0.08
304	688249	晶合集成	15,020	886,630.60	0.08
305	688006	浙江杭可科技	24,133	882,061.15	0.08
306	601827	三峰环境	119,900	871,673.00	0.08
307	600867	通化东宝	108,200	869,928.00	0.08
308	688526	武汉科前生	71,507	865,234.70	0.08

		物			
309	603368	柳药集团	58,100	852,327.00	0.08
310	600548	深高速	104,800	852,024.00	0.08
311	600985	淮北矿业	60,600	851,430.00	0.08
312	603383	顶点软件	32,000	849,920.00	0.08
313	603456	九洲药业	62,200	849,652.00	0.08
314	600261	阳光照明	275,100	847,308.00	0.08
314	688439	振华风光	18,340	847,308.00	0.08
316	603416	信捷电气	16,000	845,920.00	0.08
317	688126	上海硅产业集团	21,099	841,639.11	0.08
318	600114	东睦股份	22,200	838,272.00	0.08
319	600998	九州通	178,734	838,262.46	0.08
320	601368	绿城水务	204,000	834,360.00	0.08
321	600598	北大荒	76,895	833,541.80	0.08
322	600885	宏发股份	24,084	830,657.16	0.08
323	688459	哈铁科技	99,410	828,085.30	0.08
324	603788	宁波高发	59,700	823,860.00	0.08
325	600377	宁沪高速	70,710	818,114.70	0.08
326	603018	华设集团	158,460	814,484.40	0.08
327	600966	博汇纸业	170,100	813,078.00	0.08
328	603387	基蛋生物	107,000	808,920.00	0.08
329	601111	中国国航	133,381	806,955.05	0.08
330	603995	甬金股份	34,700	805,387.00	0.08
331	603578	三星新材	68,100	800,175.00	0.07
332	603390	通达电气	76,500	798,660.00	0.07
333	600009	上海机场	34,465	796,141.50	0.07
334	600655	豫园股份	191,341	786,411.51	0.07
335	603897	长城科技	24,100	782,286.00	0.07
336	603237	五芳斋实业	62,800	777,464.00	0.07
337	600583	海油工程	154,100	775,123.00	0.07
338	601882	海天精工	37,900	766,717.00	0.07
339	600845	宝信软件	46,040	765,645.20	0.07
340	603345	安井食品	9,500	761,805.00	0.07
341	603982	泉峰汽车	135,600	758,004.00	0.07
342	603025	大豪科技	55,400	755,656.00	0.07
343	603500	祥和实业	64,600	750,652.00	0.07
344	600131	国网信通	51,300	748,980.00	0.07
345	688552	航天南湖	26,545	746,710.85	0.07
346	600372	中航机载	68,809	746,577.65	0.07
347	600251	冠农股份	86,400	746,496.00	0.07
348	688819	天能电池集团股份	33,486	743,389.20	0.07

349	688180	君实生物	21,954	742,484.28	0.07
350	600763	通策医疗	21,869	740,921.72	0.07
351	688132	邦彦技术股份	56,197	738,990.55	0.07
352	688222	成都先导	22,983	737,984.13	0.07
353	688067	爱威科技	36,413	733,721.95	0.07
354	600600	青岛啤酒	13,851	723,437.73	0.07
355	600410	华胜天成	45,700	723,431.00	0.07
356	600449	宁夏建材	64,000	715,520.00	0.07
357	688619	罗普特科技	43,636	708,212.28	0.07
358	600132	重庆啤酒	17,100	706,230.00	0.07
359	688271	联影医疗	6,964	704,965.72	0.07
360	688187	时代电气	10,246	703,490.36	0.07
361	688060	江苏云涌电子科技	21,370	702,859.30	0.07
362	603170	宝立食品科技	62,100	701,730.00	0.07
363	688029	南微医学科技	9,771	701,557.80	0.07
364	688571	杭华油墨股份	79,833	698,538.75	0.07
365	601788	光大证券	48,338	697,517.34	0.07
366	688391	钜泉科技	19,433	697,061.71	0.07
367	688591	泰凌微	19,963	686,327.94	0.06
368	601158	重庆水务	177,764	686,169.04	0.06
369	600562	国睿科技	32,200	683,284.00	0.06
370	603330	天洋新材	88,200	682,668.00	0.06
371	600307	酒钢宏兴	489,100	679,849.00	0.06
372	600196	复星医药	30,191	678,391.77	0.06
373	601163	三角轮胎	53,300	676,377.00	0.06
374	601808	中海油服	62,200	672,382.00	0.06
375	600780	通宝能源	114,500	670,970.00	0.06
376	605123	派克新材	6,900	669,369.00	0.06
377	603899	晨光股份	32,400	668,412.00	0.06
378	603766	隆鑫通用	56,000	668,080.00	0.06
379	600323	瀚蓝环境	24,292	667,058.32	0.06
380	600987	航民股份	109,800	664,290.00	0.06
381	603700	宁水集团	56,700	658,287.00	0.06
382	603213	镇洋发展	47,300	654,159.00	0.06
383	600827	百联股份	88,200	653,562.00	0.06
384	600862	中航高科	35,697	643,616.91	0.06
385	603737	三棵树	26,695	643,349.50	0.06
386	603707	健友股份	90,900	642,663.00	0.06

387	688636	智明达电子	17,691	640,944.93	0.06
388	600597	光明乳业	105,588	640,919.16	0.06
389	688538	和辉光电	246,295	640,367.00	0.06
390	601198	东兴证券	46,998	638,702.82	0.06
391	603867	新化股份	19,000	636,310.00	0.06
392	688363	华熙生物	17,769	635,597.13	0.06
393	605258	协和电子	18,700	633,556.00	0.06
394	601866	中远海发	285,800	631,618.00	0.06
395	688798	艾为电子	8,600	630,552.00	0.06
396	600436	片仔癀	5,737	626,939.36	0.06
397	603569	长久物流	117,800	624,340.00	0.06
398	601003	柳钢股份	185,200	624,124.00	0.06
399	600643	爱建集团	167,100	619,941.00	0.06
400	601096	宏盛华源铁 塔集团	142,400	618,016.00	0.06
401	689009	九号公司	15,992	610,094.80	0.06
402	603639	海利尔	60,000	595,200.00	0.06
403	603006	联明股份	41,600	592,800.00	0.06
404	600732	爱旭股份	42,700	591,395.00	0.06
405	600935	华塑股份	250,000	587,500.00	0.05
406	688429	时创能源	57,559	586,526.21	0.05
407	600582	天地科技	131,800	586,510.00	0.05
408	688582	芯动联科	9,000	585,000.00	0.05
409	688522	纳睿雷达科 技	29,073	582,041.46	0.05
410	603728	鸣志电器	9,500	578,740.00	0.05
411	688018	乐鑫科技	4,484	573,593.28	0.05
412	600854	春兰股份	140,000	569,800.00	0.05
413	601083	锦江航运	57,200	568,568.00	0.05
414	600873	梅花生物	77,200	567,420.00	0.05
415	603638	艾迪精密	24,020	563,269.00	0.05
416	601518	吉林高速	200,300	560,840.00	0.05
417	603043	广州酒家	45,200	560,480.00	0.05
418	600395	盘江股份	121,400	553,584.00	0.05
419	603596	伯特利	22,218	551,895.12	0.05
420	603325	博隆技术	10,900	551,758.00	0.05
421	600906	财达证券	73,700	549,802.00	0.05
422	600821	金开新能	87,900	549,375.00	0.05
423	688443	智翔金泰	23,421	544,538.25	0.05
424	600054	黄山旅游	50,300	541,731.00	0.05
425	601990	南京证券	82,416	541,473.12	0.05
426	601966	玲珑轮胎	52,964	539,703.16	0.05
427	600100	同方股份	78,422	537,190.70	0.05

428	688321	微芯生物	20,292	534,288.36	0.05
429	600380	健康元	56,700	534,114.00	0.05
430	603305	旭升集团	44,000	533,280.00	0.05
431	601118	海南橡胶	108,200	532,344.00	0.05
432	603035	常熟汽饰	49,700	527,814.00	0.05
433	688584	上海合晶硅材料	14,621	525,624.95	0.05
434	605098	行动教育	9,700	525,352.00	0.05
435	688238	和元生物	96,676	523,983.92	0.05
436	601717	中创智领	37,300	518,843.00	0.05
437	603699	纽威股份	10,300	518,090.00	0.05
438	601702	华峰铝业	36,300	511,830.00	0.05
439	600820	隧道股份	98,100	511,101.00	0.05
440	600523	贵航股份	48,300	509,565.00	0.05
441	600125	铁龙物流	99,400	503,958.00	0.05
442	601900	南方传媒	45,900	498,474.00	0.05
443	600391	航发科技	14,900	498,405.00	0.05
444	688133	泰坦股份	23,496	496,470.48	0.05
445	600023	浙能电力	94,379	496,433.54	0.05
446	600770	综艺股份	70,500	493,500.00	0.05
447	688389	深圳普门科技	49,979	489,294.41	0.05
448	603861	白云电器	37,900	489,289.00	0.05
449	688379	华光新材	5,803	487,626.09	0.05
450	688092	爱科科技股份	22,926	486,948.24	0.05
451	600834	申通地铁	73,700	484,946.00	0.05
452	600848	上海临港	64,700	484,603.00	0.05
453	600661	昂立教育	69,800	482,318.00	0.05
454	688050	爱博诺德医疗	13,165	479,864.25	0.04
455	688131	皓元医药	5,000	473,000.00	0.04
456	603070	万控智造	37,500	471,750.00	0.04
457	600535	天士力	35,300	467,019.00	0.04
458	601689	拓普集团	8,195	462,361.90	0.04
459	600861	北京人力	37,200	453,840.00	0.04
460	603786	科博达	11,000	450,010.00	0.04
461	688565	力源科技	47,187	445,917.15	0.04
462	603233	大参林	29,421	442,197.63	0.04
463	603659	璞泰来	15,200	439,736.00	0.04
464	601236	红塔证券	63,600	433,752.00	0.04
465	600717	天津港	110,951	431,599.39	0.04
466	600363	联创光电	11,900	425,782.00	0.04

467	601928	凤凰传媒	47,900	421,041.00	0.04
468	601016	节能风电	108,200	419,816.00	0.04
469	600039	四川路桥	53,200	416,024.00	0.04
470	603270	金帝精密科技股份	12,400	415,524.00	0.04
471	601888	中国中免	7,705	413,835.55	0.04
472	601858	中国科传	23,900	413,709.00	0.04
473	600633	浙数文化	40,000	407,200.00	0.04
474	601800	中国交建	70,439	402,206.69	0.04
475	600382	广东明珠	58,600	394,378.00	0.04
476	688678	福立旺精密	16,234	392,375.78	0.04
477	600612	老凤祥	12,104	389,143.60	0.04
478	600928	西安银行	116,600	381,282.00	0.04
479	600010	包钢股份	162,500	362,375.00	0.03
480	688343	云天励飞股份	4,400	359,304.00	0.03
481	688728	格科微有限公司	17,016	358,016.64	0.03
482	688613	奥精医疗	25,297	356,940.67	0.03
483	603689	皖天然气	51,100	354,123.00	0.03
484	603466	风语筑	35,700	349,503.00	0.03
485	600787	中储股份	83,400	348,612.00	0.03
486	600486	扬农化工	6,760	342,732.00	0.03
487	688303	大全能源	19,578	341,244.54	0.03
488	603887	城地香江	36,400	339,976.00	0.03
489	603201	常润股份	24,300	339,228.00	0.03
490	603408	建霖家居	34,900	336,785.00	0.03
491	601061	中信金属	31,200	336,024.00	0.03
492	601865	福莱特	31,800	334,218.00	0.03
493	600968	海油发展	100,000	333,000.00	0.03
494	600983	惠而浦	47,400	328,482.00	0.03
495	688305	科德数控	5,003	326,545.81	0.03
496	600356	恒丰纸业	43,400	321,594.00	0.03
497	603855	华荣股份	18,500	320,605.00	0.03
498	603172	浙江万丰股份	19,500	320,385.00	0.03
499	600570	恒生电子	14,540	308,102.60	0.03
500	605056	咸亨国际	19,200	307,200.00	0.03
501	600628	新世界	54,500	306,835.00	0.03
502	603602	纵横通信	27,200	299,744.00	0.03
503	688599	天合光能	21,121	298,228.52	0.03
504	600718	东软集团	40,500	293,220.00	0.03
505	688609	广东九联科	26,540	292,205.40	0.03

		技			
506	688137	近岸蛋白	8,100	291,600.00	0.03
507	688088	虹软科技	8,115	288,488.25	0.03
508	603816	顾家家居	12,900	288,444.00	0.03
509	603357	设计总院	47,400	288,192.00	0.03
510	600398	海澜之家	53,900	281,897.00	0.03
511	603151	邦基科技股份	25,600	281,344.00	0.03
512	600853	龙建股份	91,600	278,464.00	0.03
513	600750	华润江中	12,600	278,082.00	0.03
514	600609	金杯汽车	88,200	275,184.00	0.03
515	603282	亚光科技股份	19,100	272,557.00	0.03
516	605001	威奥股份	49,800	271,410.00	0.03
517	605577	龙版传媒	30,800	271,348.00	0.03
518	600221	海航控股	200,900	271,215.00	0.03
519	603611	诺力股份	16,700	270,373.00	0.03
520	600588	用友网络	29,321	269,166.78	0.03
521	603236	移远通信	5,240	268,130.80	0.03
522	601156	东航物流	16,600	267,592.00	0.02
523	688327	云从科技	21,336	265,846.56	0.02
524	600429	三元股份	65,800	265,832.00	0.02
525	688128	中国电器研究院	10,925	259,359.50	0.02
526	688326	经纬恒润	3,600	255,168.00	0.02
527	603066	音飞储存	25,800	251,808.00	0.02
528	688311	盟升电子	9,610	251,685.90	0.02
529	603787	新日股份	27,500	249,975.00	0.02
530	600369	西南证券	62,100	249,642.00	0.02
531	600195	中牧股份	42,200	248,980.00	0.02
532	600529	山东药玻	13,425	247,691.25	0.02
533	600572	康恩贝	62,900	246,568.00	0.02
534	600480	凌云股份	29,500	245,145.00	0.02
535	600300	维维股份	86,700	244,494.00	0.02
536	600606	绿地控股	201,100	243,331.00	0.02
537	688318	财富趋势	3,392	241,883.52	0.02
538	603583	捷昌驱动	10,000	228,000.00	0.02
539	688590	新致软件	18,186	226,051.98	0.02
540	600325	华发股份	94,900	219,219.00	0.02
541	603511	爱慕股份	18,600	213,900.00	0.02
542	688382	益方生物科技	11,709	210,762.00	0.02
543	688435	英方软件	6,400	204,800.00	0.02

544	600866	星湖科技	46,400	203,696.00	0.02
545	688579	地纬智能	26,124	198,281.16	0.02
546	600764	中国海防	10,500	183,015.00	0.02
547	600438	通威股份	14,185	171,780.35	0.02
548	603185	弘元绿能	10,000	166,900.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明
细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	688809	强一股份	2,584	1,609,832.00	0.15
2	688729	屹唐半导体 股份	34,234	1,472,062.00	0.14
3	688818	中电科蓝天 科技	17,168	1,266,122.03	0.12
4	600930	华电新能源 集团	195,056	930,417.12	0.09
5	688785	恒运昌股份	1,155	556,632.57	0.05
6	688813	泰金新能	2,337	481,899.06	0.05
7	603459	红板科技	3,300	361,089.30	0.03
8	688811	有研金属复 材	8,337	252,717.42	0.02
9	688820	盛合晶微	1,622	229,496.78	0.02
10	603175	超颖电子	1,683	149,938.47	0.01
11	601112	振石股份	7,741	140,622.43	0.01
12	603407	长裕集团	1,363	140,044.54	0.01
13	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
14	688712	北芯生命	2,332	86,618.72	0.01
15	603418	友升股份	1,383	61,087.11	0.01
16	688781	视涯科技	1,082	54,472.32	0.01
17	603370	华新精科	811	29,179.78	0.00
18	603352	至信股份	1,115	28,966.33	0.00
19	603293	埃泰克汽车 电子	716	28,924.24	0.00
20	603284	林平发展	456	16,191.82	0.00
21	603435	嘉德利	131	6,700.86	0.00
22	601026	道生天合材 料科技	451	6,575.58	0.00

23	603406	天富龙	153	3,970.35	0.00
24	603334	丰倍生物	88	3,126.64	0.00
25	603376	大明电子	111	2,750.58	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	601288	农业银行	9,339,268.00	0.92
2	601857	中国石油	7,193,487.00	0.71
3	601988	中国银行	6,796,413.00	0.67
4	600519	贵州茅台	6,670,061.00	0.66
5	601138	工业富联	4,259,759.00	0.42
6	600036	招商银行	3,326,051.83	0.33
7	601628	中国人寿	3,145,368.00	0.31
8	601088	中国神华	2,858,543.00	0.28
9	601318	中国平安	2,734,803.00	0.27
10	601899	紫金矿业	2,609,490.00	0.26
11	600900	长江电力	2,500,279.00	0.25
12	600028	中国石化	2,181,782.00	0.22
13	688256	寒武纪科技	2,138,978.69	0.21
14	601658	邮储银行	1,913,596.00	0.19
15	601166	兴业银行	1,862,638.00	0.18
16	601728	中国电信	1,856,467.00	0.18
17	601328	交通银行	1,759,455.00	0.17
18	688041	海光信息	1,744,255.92	0.17
19	600989	宝丰能源	1,468,115.00	0.14
20	603259	药明康德	1,370,958.00	0.14

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	601288	农业银行	8,782,716.00	0.87
2	601988	中国银行	6,756,174.00	0.67
3	601857	中国石油	6,399,397.00	0.63

4	600519	贵州茅台	6,095,366.00	0.60
5	601138	工业富联	4,379,799.32	0.43
6	601628	中国人寿	3,164,705.00	0.31
7	600036	招商银行	2,986,274.00	0.29
8	601088	中国神华	2,747,941.00	0.27
9	601899	紫金矿业	2,554,912.00	0.25
10	601318	中国平安	2,457,665.00	0.24
11	600900	长江电力	2,393,285.00	0.24
12	688256	寒武纪科技	2,323,090.00	0.23
13	600028	中国石化	1,960,409.00	0.19
14	688041	海光信息	1,873,295.30	0.18
15	601728	中国电信	1,767,445.00	0.17
16	601328	交通银行	1,757,898.00	0.17
17	601658	邮储银行	1,735,965.00	0.17
18	601166	兴业银行	1,487,064.00	0.15
19	603259	药明康德	1,352,313.00	0.13
20	603993	洛阳钼业	1,337,472.00	0.13

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	223,128,664.34
卖出股票收入（成交）总额	217,510,770.01

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	24,656,012.82	2.30
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—

11	合计	24,656,012.82	2.30
----	----	---------------	------

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	019792	25 国债 19	244,000	24,656,012.82	2.30

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	95,865.44
2	应收清算款	1,078,062.24
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,438,236.20
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,612,163.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688818	中电科蓝天科技	120,430.38	0.01	新股流通受限
2	688785	恒运昌股份	53,725.40	0.01	新股流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	持有份额	占总份额

				比例（%）		比例（%）
汇添富上证综合指数 A	40,706	17,982.27	3,036,028.17	0.41	728,950,074.54	99.59
汇添富上证综合指数 C	8,093	13,120.28	0.00	0.00	106,182,442.67	100.00
汇添富上证综合指数 Y	543	6,224.39	0.00	0.00	3,379,841.55	100.00
合计	49,342	17,055.42	3,036,028.17	0.36	838,512,358.76	99.64

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	汇添富上证综合指数 A	68,418.33	0.01
	汇添富上证综合指数 C	823.76	0.00
	汇添富上证综合指数 Y	10,963.56	0.32
	合计	80,205.65	0.01

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	汇添富上证综合指数 A	0
	汇添富上证综合指数 C	0
	汇添富上证综合指数 Y	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富上证综合指数 A	0
	汇添富上证综合指数 C	0
	汇添富上证综合指数 Y	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y
基金合同生效日 (2009 年 07 月 01 日) 基金份额总额	9,097,758,651.47	—	—
本报告期期初基金份 额总额	748,722,186.10	46,751,625.08	29,297.07
本报告期基金总申购 份额	186,980,240.40	239,640,731.42	4,444,312.43
减: 本报告期基金总 赎回份额	203,716,323.79	180,209,913.83	1,093,767.95
本报告期基金拆分变 动份额	—	—	—
本报告期期末基金份 额总额	731,986,102.71	106,182,442.67	3,379,841.55

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊

普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
申万宏源 证券	3	227,267,064.97	51.71	39,971.76	51.70	
兴业证券	3	111,434,830.66	25.35	19,601.80	25.35	
国信证券	2	96,998,451.58	22.07	17,065.61	22.07	
中信建投 证券	1	3,832,613.79	0.87	674.13	0.87	
财通证券	2	—	—	—	—	
长城证券	2	—	—	—	—	
长江证券	1	—	—	—	—	
东北证券	2	—	—	—	—	
东方证券	6	—	—	—	—	
东吴证券	1	—	—	—	—	
东兴证券	1	—	—	—	—	

广发证券	1	-	-	-	-	
国海证券	2	-	-	-	-	
国联民生	2	-	-	-	-	
国泰海通	6	-	-	-	-	
恒泰证券	2	-	-	-	-	
华安证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	
平安证券	3	-	-	-	-	
瑞银证券	2	-	-	-	-	
信达证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
中金财富	2	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信证券	4	-	-	-	-	

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 (%)
申万宏源证券	500,470.00	2.05	-	-	-	-	-	-
兴业证券	23,935,372.00	97.95	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民 生	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 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	关于汇添富上证综合指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 01 月 07 日
2	汇添富上证综合指数证券投资基金收益分配公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 01 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 22 日
4	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
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,	2026 年 03 月 31 日

	易及佣金支付情况（2025 年度）	深交所,上交所,上证报	
6	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
7	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
8	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
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,上证报	2026 年 06 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日