

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	22
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	22
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.....	23
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	24
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	25
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	25
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.....	25
§ 5 托管人报告.....	25
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	25
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.....	26
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.....	26
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	26
6.1 资产负债表.....	26
6.2 利润表.....	27
6.3 净资产变动表.....	28
6.4 报表附注.....	30
§ 7 投资组合报告.....	56
7.1 期末基金资产组合情况.....	56
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	57
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.....	58
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	80
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	82
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.....	82
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.....	82
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.....	82

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.....	83
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	83
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	83
7.12 投资组合报告附注.....	83
§ 8 基金份额持有人信息.....	84
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	84
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
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.....	85
§ 9 开放式基金份额变动.....	85
§ 10 重大事件揭示.....	85
10.1 基金份额持有人大会决议.....	85
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.....	85
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
10.4 基金投资策略的改变.....	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	86
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	86
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.....	86
10.8 其他重大事件.....	88
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
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.....	89
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
§ 12 备查文件目录.....	90
12.1 备查文件目录.....	90
12.2 存放地点.....	90
12.3 查阅方式.....	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 08 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	3,021,437,198.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 16 日

注：扩位证券简称：中证 800ETF 汇添富。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，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化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露	姓名	李鹏	潘琦

负责人	联系电话	021-28932888	0755-22168257
	电子邮箱	service@99fund.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95511-3
传真		021-28932998	0755-82080387
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		200010	518001
法定代表人		鲁伟铭	谢永林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 – 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	716,840,974.10
本期利润	581,510,571.96
加权平均基金份额本期利润	0.1471
本期加权平均净值利润率	11.23%
本期基金份额净值增长率	12.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	1,215,145,036.27
期末可供分配基金份额利润	0.4022
期末基金资产净值	4,236,582,234.27
期末基金份额净值	1.4022
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	56.91%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.56%	1.33%	13.71%	1.34%	0.85%	-0.01%
过去六个月	12.03%	1.23%	11.12%	1.24%	0.91%	-0.01%
过去一年	35.66%	1.09%	33.18%	1.10%	2.48%	-0.01%
过去三年	44.10%	1.17%	35.06%	1.18%	9.04%	-0.01%
过去五年	16.64%	1.14%	3.70%	1.14%	12.94%	0.00%
自基金合同生效起至今	56.91%	1.18%	42.26%	1.19%	14.65%	-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

添富中证800ETF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（2019年10月08日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

金销售等业务资格。

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穹	本基金的基金经理	2019 年 10 月 08 日	—	12	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7

					月 26 日至 2024 年 4 月 19 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 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 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至 2025 年 5 月 16 日任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任
--	--	--	--	--	---

					汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2024 年 9 月 29 日任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）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。2021 年 12 月 28 日至 2025 年 8 月 6 日任
--	--	--	--	--	--

					汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2023 年 11 月 28 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 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能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。2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 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。2022 年 7 月 29 日至 2024 年 2 月 7 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投
--	--	--	--	--	--

					资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生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。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至 2024 年 7 月 5 日任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

					2023 年 6 月 19 日至 2024 年 7 月 9 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。 2023 年 8 月 23 日至 2025 年 5 月 9 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。 2023 年 12 月 28 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2024 年 2 月 5 日至今任汇添富 MSCI 美国 50 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。 2024 年 3 月 1 日至今任汇添富恒生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。2024
--	--	--	--	--	--

					年4月1日至2025年5月9日任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年10月28日至今任汇添富中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年6月18日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年7月10日至今任汇添富国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年8月6
--	--	--	--	--	--

					日至今任汇添富国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 7 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业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 8 月 27 日至今任汇添富恒生港股通中国科技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 6 月 17 日至今任汇添富中证港股通信息技术综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
过蓓蓓	本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监	2019 年 10 月 08 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 2023 年 4 月 13 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。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 6 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。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 6 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。2015 年 8 月 3 日至
--	--	--	--	--	---

					今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。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 8 月 29 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。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 5 月 22 日任深证 300 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生物科技主题指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 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。

过蓓蓓 2026 年 07 月 08 日离任本基金基金经理。

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

2026 年上半年,资本市场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。A 股和港股市场从二季度开始均表现出较强结构化特征,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、通信设备等为主。

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。截至 3 月末,中东地区多方势力被卷入地缘冲突,局部冲突或有升级态势。霍尔木兹海峡承担全球约 20%的原油运输量,关闭霍尔木兹海峡,使得全球能源市场遭受剧烈冲击。布伦特原油在 3 月一度突破 110 美元/桶。全球各国陆续紧急释放战略石油储备。

3 月下旬开始,围绕霍尔木兹海峡的地缘冲突开始出现缓和迹象,4 月初双方达成临时停火,但局势在大方向缓和的背景下依然有多次拉扯。6 月中旬,以双方签署谅解备忘录为

标志，霍尔木兹海峡通行量逐步提升，显示出较为实质的改善效果，油价也已回落到接近 3 月初的水平。但当前距离冲突彻底解决依然存在一定的不确定性，美国与其盟友的利益不完全一致是其中的重要原因之一。

全球经济方面，二季度美联储依然维持基准利率不变。5 月新任联储主席就任，6 月议息会议对外发布的信息大幅缩减，且明确放弃前瞻指引，表明联储对市场引导的淡化，希望让市场根据经济数据自行定价。随后市场预期在原本 2026 年内加息不足一次的基础上跳升，达到年内一到两次加息的预期，对市场带来一定的冲击。

国内方面，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。

资本市场角度，不管是 A 股还是港股，都体现出极强的结构化特征。与 AI 产业相关的资产表现强势，而其他行业更多体现为震荡乃至下行。

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，也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。

港股方面，2026 年以来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到传统消费类业务拖累，业绩表现不及预期。尽管在 AI 相关的云业务方面依然有突出表现，但股价是公司整体价值的反映，很难剥离出其中的 AI 相关贡献。当前此类公司估值进一步进入性价比较高的区间。而与 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。港股整体受到全球流动性预期收缩的影响，同时资金面有 IPO 和解禁等压力存在，或难以出现 2025 年前三季度那样普遍的强势行情，需要寻找结构性机会。

中证 800 是 A 股市场代表性宽基指数，覆盖 A 股数千只个股中市值较大、流动性较好的前 800 只股票，风格均衡，是 A 股市场核心资产的代表。本基金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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 12.03%，同期业绩比较基准收益率为 11.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月开始，上半年强势的科技板块迎来较大幅度的调整。板块之间的结构分化差异过大，使得市场逐渐出现“再平衡”的冲动。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。科技板块本就容易出现估值迅速抬升而基本面难以迅速跟上的情况，在这个过程中，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：本基金的收益分配采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金

法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	67,168,044.20	33,680,378.74
结算备付金		67,721,181.42	82,235,415.27
存出保证金		17,833,070.75	19,572,011.50
交易性金融资产	6.4.7.2	4,108,844,243.81	5,211,178,134.40
其中：股票投资		4,108,443,233.29	5,211,018,131.95
基金投资		-	-
债券投资		401,010.52	160,002.45
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	-	-7,709.61
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		-	35,009,322.04
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,261,566,540.18	5,381,667,552.34
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		23,642,253.41	10,318,693.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		513,620.59	679,077.16
应付托管费		171,206.88	226,359.04
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		81,496.44	0.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	575,728.59	479,281.46
负债合计		24,984,305.91	11,703,411.61
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	3,021,437,198.00	4,290,437,198.00
未分配利润	6.4.7.9	1,215,145,036.27	1,079,526,942.73
净资产合计		4,236,582,234.27	5,369,964,140.73
负债和净资产总计		4,261,566,540.18	5,381,667,552.34

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4022 元，基金份额总额 3,021,437,198.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日 至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		586,845,691.51	90,201,451.33

1.利息收入		621,254.12	536,953.24
其中：存款利息收入	6.4.7.10	576,550.77	464,393.83
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		44,703.35	72,559.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		721,553,098.15	108,984,746.80
其中：股票投资收益	6.4.7.11	659,547,990.54	51,388,879.56
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	170,554.38	115,882.50
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	21,892,186.48	-1,045,124.50
股利收益	6.4.7.17	39,942,366.75	58,525,109.24
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	-135,330,402.14	-21,812,280.26
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	1,741.38	2,492,031.55
减：二、营业总支出		5,335,119.55	5,499,290.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,867,456.01	3,770,358.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,289,152.05	1,256,786.20
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		78,945.81	8,405.68
8. 其他费用	6.4.7.21	99,565.68	463,739.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		581,510,571.96	84,702,160.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		581,510,571.96	84,702,160.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		581,510,571.96	84,702,160.90

6.3 净资产变动表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期		
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,290,437,198.00	1,079,526,942.73	5,369,964,140.73
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	4,290,437,198.00	1,079,526,942.73	5,369,964,140.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,269,000,000.00	135,618,093.54	-1,133,381,906.46
（一）、综合收益总额	-	581,510,571.96	581,510,571.96
（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）	-1,269,000,000.00	-445,892,478.42	-1,714,892,478.42
其中：1.基金申购款	1,620,000,000.00	467,754,652.35	2,087,754,652.35
2.基金赎回款	-2,889,000,000.00	-913,647,130.77	-3,802,647,130.77
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	3,021,437,198.00	1,215,145,036.27	4,236,582,234.27
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	6,148,187,198.00	82,924,600.93	6,231,111,798.93
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	6,148,187,198.00	82,924,600.93	6,231,111,798.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,448,750,000.00	74,913,620.84	-1,373,836,379.16
（一）、综合收	-	84,702,160.90	84,702,160.90

益总额			
(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)	-1,448,750,000.00	-9,788,540.06	-1,458,538,540.06
其中：1.基金申购款	598,500,000.00	5,806,041.98	604,306,041.98
2.基金赎回款	-2,047,250,000.00	-15,594,582.04	-2,062,844,582.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	4,699,437,198.00	157,838,221.77	4,857,275,419.77

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

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2019〕162 号文《关于准予中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2019 年 10 月 8 日生效。首次设立基金募集规模为 6,601,437,198.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2019）验字第 60466941_A04 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

2. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31

日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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	67,168,044.20
等于：本金	67,162,261.76
加：应计利息	5,782.44
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	67,168,044.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
----	-------------------------

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,502,877,313.84	-	4,108,443,233.29	605,565,919.45
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	401,000.00	10.52	401,010.52	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	401,000.00	10.52	401,010.52	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,503,278,313.84	10.52	4,108,844,243.81	605,565,919.45

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	121,138,560.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	121,138,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	121,138,560.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	73	130,351,720.00	9,213,160.00
合计				9,213,160.00
减：可抵销期货暂收款				9,213,160.00
净额				-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	476,549.64
其中：交易所市场	476,549.64
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	39,671.58
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	575,728.59

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,290,437,198.00	4,290,437,198.00
本期申购	1,620,000,000.00	1,620,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,889,000,000.00	-2,889,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,021,437,198.00	3,021,437,198.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	1,424,735,158.69	-345,208,215.96	1,079,526,942.73
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	1,424,735,158.69	-345,208,215.96	1,079,526,942.73
本期利润	716,840,974.10	-135,330,402.14	581,510,571.96
本期基金份额交易产生的变动数	-540,549,738.21	94,657,259.79	-445,892,478.42
其中：基金申购款	663,245,219.84	-195,490,567.49	467,754,652.35
基金赎回款	-1,203,794,958.05	290,147,827.28	-913,647,130.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,601,026,394.58	-385,881,358.31	1,215,145,036.27

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	197,917.21
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	375,523.18
其他	3,110.38
合计	576,550.77

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	463,046,676.53
股票投资收益——赎回差价收入	196,501,314.01
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	659,547,990.54

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	2,320,184,157.97
减：卖出股票成本总额	1,855,021,291.23
减：交易费用	2,116,190.21
买卖股票差价收入	463,046,676.53

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	3,802,647,130.77
减：现金支付赎回款总额	1,708,573,166.89
减：赎回股票成本总额	1,897,572,649.87
减：交易费用	—
赎回差价收入	196,501,314.01

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	16.72
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	170,537.66
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	170,554.38

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	330,560.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	160,000.00
减：应计利息总额	9.12
减：交易费用	13.22
买卖债券差价收入	170,537.66

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	21,892,186.48
外汇远期投资收益	-
国债期货投资收益	-
外汇期货投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	39,942,366.75
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	39,942,366.75

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	-139,123,782.14
——股票投资	-139,123,782.14
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	3,793,380.00
——权证投资	-
——期货投资	3,793,380.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	-135,330,402.14

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,741.38
其他	-
合计	1,741.38

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	-
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布 费	-
持有人大会-公证 费	-
持有人大会-律师 费	-
开户费	-
上市费	-

或有管理费	-
其他	386.73
合计	99,565.68

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人,基金销售机构
平安银行股份有限公司（"平安银行"）	基金托管人
东方证券股份有限公司（"东方证券"）	基金管理人的股东
汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

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	1,340,807,508.27	33.66	542,481,366.37	30.66

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

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	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
东方证券	80,000,000.00	100.00	217,000,000.00	81.27

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（%）
东方证券	235,864.83	33.66	196,682.33	41.27
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	95,445.48	30.67	74,902.21	57.08

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	3,867,456.01	3,770,358.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	252,109.90	374,694.50
应支付基金管理人的净管理费	3,615,346.11	3,395,664.23

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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、公休日等，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	1,289,152.05	1,256,786.20

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
东方证券股份有限公司	4,135,196.00	0.14	4,189,165.00	0.10
汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	17,262,800.00	0.57	36,482,800.00	0.85

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	67,168,044.20	197,917.21	75,385,247.34	114,779.03

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

于本报告期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 559,444.00 股，占本基金净值比例为 0.12%。持有基金托管人平安银行发行的股票 1,039,867.00 股，占本基金净值比例为 0.25%。（于上期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 889,344.00 股，占本基金净值比例为 0.18%。持有基金托管人平安银行发行的股票 1,647,167.00 股，占本基金净值比例为 0.41%。）

6.4.11 利润分配情况

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	

001312	福恩股份	2026年04月14日	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	
001365	天海电子	2026年05月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	
001393	维通利	2026年05月08日	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	
001399	惠科股份	2026年06月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	
301513	尚水智能	2026年04月10日	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	
301531	春光集团	2026年04月28日	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	
301599	理奇智能	2026年04月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	
301666	大普微	2026年04月08日	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	
301669	高特电子	2026年06月02日	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	
301680	固德电材	2026年02月27日	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	
301682	宏明电子	2026年03月18日	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	

301683	慧谷新材	2026年03月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	
301696	三瑞智能	2026年03月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	
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	
603407	长裕集团	2026年04月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	
603435	嘉德利	2026年05月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	
603459	红板科技	2026年03月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	
688781	视涯科技	2026年03月18日	9个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	
688797	臻宝科技	2026年06月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	
688811	有研金属复材	2026年04月01日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	
688813	泰金新能	2026年03月24日	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	
688820	盛合晶微	2026年04月13日	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026年06月26日	17个交易日	新债流通受限	100.00	100.00	1,970	197,000.00	197,002.59	
113704	春风转债	2026年06月11日	17个交易日	新债流通受限	100.00	100.00	1,530	153,000.00	153,007.04	
118071	华峰转债	2026年06月24日	17个交易日	新债流通受限	100.00	100.00	510	51,000.00	51,000.89	

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
400174	中天3	2023年08月30日	重大事项停牌	0.01		-	371,600	952,476.03	3,716.00	
688072	拓荆科技	2026年06月29日	重大事项停牌	832.00	2026年07月13日	890.99	22,022	14,457,518.75	18,322,304.00	

注：截止 2026 年 6 月 30 日，本基金合计持有中天 3（在深圳证券交易所退市时的股票简称为*ST 中天，证券代码为 000540）371,600 股。根据中天金融集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 6 月 29 日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市暨摘牌的公告》，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告〔2017〕13 号）的有关规定，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，决定

自 2023 年 6 月 16 日起，对旗下证券投资基金所持有的*ST 中天（000540.SZ）按每股 0.01 元人民币估值。

根据公司于 2023 年 8 月 28 日发布的《中天金融集团股份有限公司股票转让公告》，公司可在全国中小企业股份转让系统有限责任公司依托原证券公司代办股份转让系统设立并代为管理的两网公司及退市公司板块（以下简称“退市板块”）转让仅限于原在深圳证券交易所（以下简称“深交所”）挂牌交易的流通股份，确权代码（即挂牌退市板块后的股票代码）：400174，开始转让日为 2023 年 8 月 30 日。根据公司于同日发布的《中天金融集团股份有限公司关于公司股票挂牌当日即暂停转让的公告》，因公司正在进行重整事项，经向全国股转公司申请，公司股票自 2023 年 8 月 30 日起暂停转让。

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	67,168,04 4.20	-	-	-	-	-	67,168,04 4.20
结算备付 金	67,721,18 1.42	-	-	-	-	-	67,721,18 1.42
存出保证 金	2,190,864 .35	-	-	-	-	15,642,20 6.40	17,833,07 0.75
交易性金 融资产	-	-	401,010.5 2	-	-	4,108,443 ,233.29	4,108,844 ,243.81
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售 金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得	-	-	-	-	-	-	-

税资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	137,080,089.97	-	401,010.52	-	-	4,124,085,439.69	4,261,566,540.18
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	-	-	-	-	-	23,642,253.41	23,642,253.41
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	513,620.59	513,620.59
应付托管费	-	-	-	-	-	171,206.88	171,206.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	81,496.44	81,496.44
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	575,728.59	575,728.59
负债总计	-	-	-	-	-	24,984,305.91	24,984,305.91
利率敏感度缺口	137,080,089.97	-	401,010.52	-	-	4,099,101,133.78	4,236,582,234.27
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	33,680,378.74	-	-	-	-	-	33,680,378.74
结算备付	82,235,41	-	-	-	-	-	82,235,41

金	5.27						5.27
存出保证金	1,094,862.70	-	-	-	-	18,477,148.80	19,572,011.50
交易性金融资产	-	-	160,002.45	-	-	5,211,018,131.95	5,211,178,134.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-7,709.61	-	-	-	-	-	-7,709.61
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	35,009,322.04	35,009,322.04
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	117,002,947.10	-	160,002.45	-	-	5,264,504,602.79	5,381,667,552.34
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	-	-	-	-	-	10,318,693.38	10,318,693.38
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	679,077.16	679,077.16
应付托管费	-	-	-	-	-	226,359.04	226,359.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.57	0.57
应付利润	-	-	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	479,281.46	479,281.46
负债总计	-	-	-	-	-	11,703,411.61	11,703,411.61
利率敏感度缺口	117,002,947.10	-	160,002.45	-	-	5,252,801,191.18	5,369,964,140.73

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产 – 股票投资	4,108,443,233.29	96.98	5,211,018,131.95	97.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 – 债券投资	401,010.52	0.01	160,002.45	0.00
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	4,108,844,243.	96.98	5,211,178,134.	97.04

	81		40	
--	----	--	----	--

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
	中证 800 指数上涨 5%	210,685,076.34	267,290,315.92
	中证 800 指数下跌 5%	-210,685,076.34	-267,290,315.92

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	4,088,298,068.16
第二层次	18,723,314.52

第三层次	1,822,861.13
合计	4,108,844,243.81

6.4.14.2 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	4,108,443,233.29	96.41
	其中：股票	4,108,443,233.29	96.41
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	401,010.52	0.01
	其中：债券	401,010.52	0.01
	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	134,889,225.62	3.17
8	其他各项资产	17,833,070.75	0.42
9	合计	4,261,566,540.18	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	20,729,307.22	0.49
B	采矿业	159,786,838.02	3.77
C	制造业	2,753,678,659.93	65.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,348,959.13	2.39
E	建筑业	40,833,991.99	0.96
F	批发和零售业	24,885,549.97	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	86,366,160.48	2.04
H	住宿和餐饮业	764,575.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,243,058.69	5.48
J	金融业	589,064,512.72	13.90
K	房地产业	14,167,317.42	0.33
L	租赁和商务服务业	24,866,832.42	0.59
M	科学研究和技术服务业	40,779,596.15	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	3,703,895.60	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	6,627,195.22	0.16
R	文化、体育和娱乐业	6,775,387.20	0.16
S	综合	—	—
	合计	4,106,621,837.16	96.93

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	1,819,145.13	0.04
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	3,716.00	0.00
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	1,822,861.13	0.04

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	300308	中际旭创	119,300	151,511,000.00	3.58
2	300750	宁德时代	282,940	111,198,249.40	2.62
3	300502	新易盛	149,240	90,588,680.00	2.14
4	600519	贵州茅台	66,915	79,327,063.35	1.87
5	603986	兆易创新	71,465	58,243,975.00	1.37
6	601318	中国平安	1,141,056	54,474,013.44	1.29

7	688256	寒武纪科技	33,614	53,632,817.7 0	1.27
8	600036	招商银行	1,324,300	47,012,650.0 0	1.11
9	601899	紫金矿业	1,763,200	44,326,848.0 0	1.05
10	002371	北方华创	46,326	40,978,126.5 6	0.97
11	000333	美的集团	520,361	39,302,866.3 3	0.93
12	002475	立讯精密	545,484	38,402,073.6 0	0.91
13	688008	澜起科技	122,707	38,026,899.3 0	0.90
14	688012	中微半导体 设备	80,188	37,568,078.0 0	0.89
15	688041	海光信息	99,438	36,821,891.4 0	0.87
16	002384	东山精密	137,200	35,994,420.0 0	0.85
17	600900	长江电力	1,308,440	34,634,406.8 0	0.82
18	688981	中芯国际	217,910	34,608,466.2 0	0.82
19	000725	京东方 A	3,892,100	33,783,428.0 0	0.80
20	603259	药明康德	264,781	32,967,882.3 1	0.78
21	601138	工业富联	424,800	30,649,320.0 0	0.72
22	600030	中信证券	1,045,050	30,024,286.5 0	0.71
23	601166	兴业银行	1,810,400	29,980,224.0 0	0.71
24	300059	东方财富	1,354,528	27,605,280.6 4	0.65
25	600183	生益科技	155,920	27,036,528.0 0	0.64
26	600276	恒瑞医药	478,042	24,877,305.6 8	0.59
27	300274	阳光电源	155,380	24,708,527.6 0	0.58
28	601398	工商银行	3,464,300	24,492,601.0 0	0.58

29	300408	三环集团	143,500	23,950,150.0 0	0.57
30	002594	比亚迪	290,520	23,154,444.0 0	0.55
31	300476	胜宏科技	65,400	22,656,522.0 0	0.53
32	002463	沪电股份	144,200	22,033,760.0 0	0.52
33	601211	国泰海通	1,209,224	22,007,876.8 0	0.52
34	300394	天孚通信	70,050	21,202,734.0 0	0.50
35	000988	华工科技	107,600	19,864,036.0 0	0.47
36	301308	江波龙	27,100	19,072,980.0 0	0.45
37	600176	中国巨石	257,123	18,739,124.2 4	0.44
38	601288	农业银行	3,070,800	18,639,756.0 0	0.44
39	601328	交通银行	2,853,700	18,349,291.0 0	0.43
40	688072	拓荆科技	22,022	18,322,304.0 0	0.43
41	688498	源杰科技	9,688	18,271,568.0 0	0.43
42	000651	格力电器	478,972	17,961,450.0 0	0.42
43	600522	中天科技	292,400	17,742,832.0 0	0.42
44	600919	江苏银行	1,571,950	16,945,621.0 0	0.40
45	603019	中科曙光	156,820	16,815,808.6 0	0.40
46	688521	芯原微电子	44,987	16,696,475.1 8	0.39
47	603993	洛阳钼业	934,900	16,407,495.0 0	0.39
48	600150	中国船舶	483,558	16,339,424.8 2	0.39
49	600887	伊利股份	676,100	16,199,356.0 0	0.38
50	600584	长电科技	153,300	15,874,215.0 0	0.37

51	000338	潍柴动力	575,600	15,685,100.0 0	0.37
52	000858	五 粮 液	207,629	15,364,546.0 0	0.36
53	300604	长川科技	42,400	14,476,208.0 0	0.34
54	001309	德明利	15,200	14,332,080.0 0	0.34
55	601816	京沪高铁	3,143,100	14,238,243.0 0	0.34
56	600309	万华化学	200,900	13,743,569.0 0	0.32
57	300124	汇川技术	202,950	13,461,673.5 0	0.32
58	002415	海康威视	392,400	13,420,080.0 0	0.32
59	002916	深南电路	29,140	13,343,206.0 0	0.31
60	688347	华虹宏力半 导体	38,879	13,075,007.7 0	0.31
61	600111	北方稀土	271,000	13,021,550.0 0	0.31
62	000100	TCL 科技	2,225,990	12,955,261.8 0	0.31
63	601688	华泰证券	626,600	12,920,492.0 0	0.30
64	000063	中兴通讯	345,250	12,494,597.5 0	0.29
65	600000	浦发银行	1,425,338	12,272,160.1 8	0.29
66	688120	华海清科	37,798	12,177,759.6 4	0.29
67	600089	特变电工	540,251	12,155,647.5 0	0.29
68	601857	中国石油	1,385,700	12,027,876.0 0	0.28
69	002281	光迅科技	46,300	11,896,322.0 0	0.28
70	002008	大族激光	78,600	11,798,646.0 0	0.28
71	002028	思源电气	66,800	11,556,400.0 0	0.27
72	601088	中国神华	293,440	11,455,897.6 0	0.27

73	300433	蓝思科技	212,700	11,413,482.0 0	0.27
74	300857	协创数据	32,700	11,114,730.0 0	0.26
75	300136	信维通信	92,200	10,994,850.0 0	0.26
76	600031	三一重工	634,700	10,967,616.0 0	0.26
77	300014	亿纬锂能	162,883	10,592,281.4 9	0.25
78	002050	三花智控	239,780	10,509,557.4 0	0.25
79	002142	宁波银行	353,170	10,485,617.3 0	0.25
80	000001	平安银行	1,039,867	10,450,663.3 5	0.25
81	601601	中国太保	365,600	10,426,912.0 0	0.25
82	000792	盐湖股份	339,600	10,252,524.0 0	0.24
83	002714	牧原股份	292,358	10,229,606.4 2	0.24
84	600549	厦门钨业	119,000	10,138,800.0 0	0.24
85	688361	中科飞测	23,364	10,046,520.0 0	0.24
86	002353	杰瑞股份	65,700	10,019,250.0 0	0.24
87	600406	国电南瑞	429,747	9,819,718.95	0.23
88	601668	中国建筑	2,211,200	9,596,608.00	0.23
89	300475	香农芯创	31,300	9,390,000.00	0.22
90	000657	中钨高新	97,400	9,323,128.00	0.22
91	601229	上海银行	1,066,210	9,254,702.80	0.22
92	300223	北京君正	36,900	9,184,410.00	0.22
93	601919	中远海控	672,560	8,918,145.60	0.21
94	002602	世纪华通	632,200	8,914,020.00	0.21
95	300760	迈瑞医疗	65,000	8,828,950.00	0.21
96	601988	中国银行	1,533,500	8,771,620.00	0.21
97	601939	建设银行	904,700	8,712,261.00	0.21
98	600660	福耀玻璃	171,310	8,640,876.40	0.20
99	603501	豪威集团	90,781	8,610,577.85	0.20
100	601728	中国电信	1,656,811	8,598,849.09	0.20
101	600016	民生银行	2,652,613	8,541,413.86	0.20

102	601012	隆基绿能	648,732	8,511,363.84	0.20
103	601225	陕西煤业	415,600	8,457,460.00	0.20
104	600999	招商证券	397,910	8,395,901.00	0.20
105	002230	科大讯飞	205,100	8,376,284.00	0.20
106	600941	中国移动	96,835	8,340,398.55	0.20
107	002436	兴森科技	161,800	8,243,710.00	0.19
108	600690	海尔智家	400,700	8,178,287.00	0.19
109	002352	顺丰控股	257,244	8,041,447.44	0.19
110	601985	中国核电	879,200	7,939,176.00	0.19
111	002460	赣锋锂业	120,580	7,885,932.00	0.19
112	300285	国瓷材料	76,200	7,862,316.00	0.19
113	002709	天赐材料	152,560	7,846,160.80	0.19
114	002938	鹏鼎控股	74,400	7,840,272.00	0.19
115	600926	杭州银行	542,274	7,835,859.30	0.18
116	603799	华友钴业	162,020	7,819,085.20	0.18
117	601169	北京银行	1,587,900	7,780,710.00	0.18
118	300033	同花顺	32,250	7,772,250.00	0.18
119	300054	鼎龙股份	72,700	7,704,019.00	0.18
120	000977	浪潮信息	109,800	7,686,000.00	0.18
121	600160	巨化股份	144,400	7,654,644.00	0.18
122	600105	永鼎股份	111,600	7,530,768.00	0.18
123	300666	江丰电子	20,300	7,482,580.00	0.18
124	000776	广发证券	315,700	7,387,380.00	0.17
125	300442	润泽科技	87,700	7,285,239.00	0.17
126	000425	徐工机械	878,600	7,107,874.00	0.17
127	688777	中控技术	60,375	7,094,062.50	0.17
128	002202	金风科技	296,000	7,074,400.00	0.17
129	000938	紫光股份	245,060	7,072,431.60	0.17
130	688126	上海硅产业集团	176,664	7,047,126.96	0.17
131	688200	华峰测控	13,393	7,032,664.30	0.17
132	300498	温氏股份	568,040	6,998,252.80	0.17
133	600938	中国海油	256,600	6,966,690.00	0.16
134	601600	中国铝业	845,700	6,951,654.00	0.16
135	600028	中国石化	1,557,200	6,945,112.00	0.16
136	300757	罗博特科	11,200	6,932,800.00	0.16
137	600460	士兰微	124,700	6,816,102.00	0.16
138	002466	天齐锂业	110,900	6,800,388.00	0.16
139	002600	领益智造	392,100	6,799,014.00	0.16
140	601766	中国中车	1,304,900	6,785,480.00	0.16
141	688037	芯源微电子	15,378	6,751,710.90	0.16
142	000021	深科技	105,036	6,750,663.72	0.16
143	600050	中国联通	1,672,400	6,689,600.00	0.16

144	688082	盛美上海半 导体	15,474	6,684,768.00	0.16
145	300661	圣邦股份	46,543	6,677,989.64	0.16
146	601009	南京银行	662,700	6,554,103.00	0.15
147	002837	英维克	81,676	6,498,142.56	0.15
148	002851	麦格米特	38,800	6,486,584.00	0.15
149	002049	紫光国微	72,680	6,450,350.00	0.15
150	601869	长飞光纤	11,700	6,387,030.00	0.15
151	601628	中国人寿	178,713	6,317,504.55	0.15
152	002179	中航光电	136,350	6,299,370.00	0.15
153	300548	长芯博创	22,500	6,255,000.00	0.15
154	601100	恒立液压	57,248	6,157,594.88	0.15
155	002409	雅克科技	27,300	6,128,850.00	0.14
156	000568	泸州老窖	78,902	6,116,483.04	0.14
157	300346	南大光电	65,900	6,105,635.00	0.14
158	601872	招商轮船	345,260	6,066,218.20	0.14
159	002241	歌尔股份	265,000	5,970,450.00	0.14
160	300567	精测电子	18,700	5,939,120.00	0.14
161	603288	海天味业	178,905	5,932,489.80	0.14
162	688019	安集科技	17,353	5,890,649.38	0.14
163	601006	大秦铁路	1,276,604	5,885,144.44	0.14
164	000408	藏格矿业	83,900	5,815,948.00	0.14
165	601658	邮储银行	1,176,678	5,801,022.54	0.14
166	605117	德业股份	54,491	5,785,854.38	0.14
167	600498	烽火通信	78,000	5,740,800.00	0.14
168	600809	山西汾酒	52,360	5,726,613.20	0.14
169	601818	光大银行	1,978,600	5,718,154.00	0.13
170	002407	多氟多	113,300	5,691,059.00	0.13
171	600905	三峡能源	1,533,671	5,689,919.41	0.13
172	002185	华天科技	253,200	5,648,892.00	0.13
173	600489	中金黄金	311,100	5,615,355.00	0.13
174	601888	中国中免	104,442	5,609,579.82	0.13
175	002138	顺络电子	76,700	5,606,770.00	0.13
176	002625	光启技术	184,400	5,591,008.00	0.13
177	688313	仕佳光子	30,172	5,571,259.80	0.13
178	688002	睿创微纳	35,959	5,562,497.71	0.13
179	688396	华润微电子	56,898	5,550,399.90	0.13
180	000630	铜陵有色	859,000	5,463,240.00	0.13
181	600893	航发动力	142,295	5,455,590.30	0.13
182	300620	光库科技	14,300	5,408,260.00	0.13
183	600010	宝钢股份	2,421,476	5,399,891.48	0.13
184	600879	航天电子	252,120	5,367,634.80	0.13
185	300395	菲利华	40,100	5,362,573.00	0.13

186	601127	赛力斯	87,300	5,347,125.00	0.13
187	688271	联影医疗	52,795	5,344,437.85	0.13
188	601336	新华保险	89,065	5,313,617.90	0.13
189	688111	金山办公	24,789	5,281,296.45	0.12
190	600958	东方证券	559,444	5,281,151.36	0.12
191	601689	拓普集团	93,343	5,266,412.06	0.12
192	002027	分众传媒	1,082,900	5,241,236.00	0.12
193	300390	天华新能	55,680	5,206,636.80	0.12
194	600118	中国卫星	63,400	5,201,970.00	0.12
195	688017	绿的谐波	12,257	5,121,710.02	0.12
196	688469	芯联集成	479,935	5,092,110.35	0.12
197	600019	宝钢股份	934,600	5,074,878.00	0.12
198	301526	国际复材	108,200	5,049,694.00	0.12
199	600760	中航沈飞	120,980	4,972,278.00	0.12
200	000807	云铝股份	221,800	4,910,652.00	0.12
201	300373	扬杰科技	31,000	4,874,130.00	0.12
202	601838	成都银行	273,284	4,837,126.80	0.11
203	600104	上汽集团	493,300	4,814,608.00	0.11
204	600362	江西铜业	110,800	4,797,640.00	0.11
205	300450	先导智能	117,700	4,792,744.00	0.11
206	600989	宝丰能源	234,800	4,773,484.00	0.11
207	300058	蓝色光标	343,760	4,730,137.60	0.11
208	688183	生益电子	35,632	4,717,676.80	0.11
209	002273	水晶光电	132,700	4,708,196.00	0.11
210	601727	上海电气	672,400	4,706,800.00	0.11
211	300037	新宙邦	50,500	4,688,925.00	0.11
212	600875	东方电气	162,700	4,680,879.00	0.11
213	002001	新 和 成	164,168	4,665,654.56	0.11
214	601825	沪农商行	617,900	4,628,071.00	0.11
215	002422	科伦药业	119,400	4,599,288.00	0.11
216	603256	宏和科技	17,300	4,590,209.00	0.11
217	601390	中国中铁	1,100,400	4,588,668.00	0.11
218	688702	盛科通信	11,703	4,564,052.97	0.11
219	688172	燕东微电子 股份	54,482	4,557,964.12	0.11
220	603296	华勤技术	61,060	4,534,926.20	0.11
221	000538	云南白药	95,460	4,521,940.20	0.11
222	300751	迈为股份	16,000	4,519,360.00	0.11
223	601995	中金公司	124,500	4,500,675.00	0.11
224	600547	山东黄金	193,300	4,463,297.00	0.11
225	600795	国电电力	953,200	4,451,444.00	0.11
226	601377	兴业证券	736,212	4,446,720.48	0.10
227	605358	立昂微	56,700	4,399,920.00	0.10

228	600585	海螺水泥	257,000	4,356,150.00	0.10
229	601669	中国电建	926,000	4,352,200.00	0.10
230	301377	鼎泰高科	7,900	4,352,110.00	0.10
231	600015	华夏银行	678,900	4,338,171.00	0.10
232	603893	瑞芯微	22,600	4,256,936.00	0.10
233	002648	卫星化学	180,940	4,250,280.60	0.10
234	601916	浙商银行	1,615,400	4,248,502.00	0.10
235	000166	申万宏源	964,000	4,241,600.00	0.10
236	300316	晶盛机电	69,800	4,215,920.00	0.10
237	600988	赤峰黄金	159,200	4,190,144.00	0.10
238	688099	晶晨半导体	40,515	4,168,993.50	0.10
239	300015	爱尔眼科	499,249	4,123,796.74	0.10
240	605589	圣泉集团	64,800	4,119,336.00	0.10
241	601698	中国卫通	136,081	4,116,450.25	0.10
242	600885	宏发股份	117,608	4,056,299.92	0.10
243	002738	中矿资源	68,740	4,054,972.60	0.10
244	601066	中信建投	139,006	4,040,904.42	0.10
245	002126	银轮股份	80,700	4,018,860.00	0.09
246	000960	锡业股份	93,900	4,008,591.00	0.09
247	600346	恒力石化	225,400	3,991,834.00	0.09
248	600392	盛和资源	133,900	3,986,203.00	0.09
249	601868	中国能建	1,489,565	3,977,138.55	0.09
250	600482	中国动力	121,000	3,968,800.00	0.09
251	601998	中信银行	568,100	3,936,933.00	0.09
252	600601	方正科技	284,200	3,933,328.00	0.09
253	002558	巨人网络	142,500	3,927,300.00	0.09
254	000831	中国稀土	70,600	3,917,594.00	0.09
255	002311	海大集团	87,700	3,912,297.00	0.09
256	300418	昆仑万维	96,600	3,898,776.00	0.09
257	001389	广合科技	16,200	3,843,450.00	0.09
258	600066	宇通客车	142,659	3,824,687.79	0.09
259	000625	长安汽车	531,366	3,809,894.22	0.09
260	600426	华鲁恒升	157,960	3,778,403.20	0.09
261	002812	恩捷股份	56,400	3,773,724.00	0.09
262	600141	兴发集团	80,100	3,762,297.00	0.09
263	300570	太辰光	15,200	3,749,992.00	0.09
264	002532	天山铝业	348,000	3,734,040.00	0.09
265	600378	昊华科技	49,500	3,731,310.00	0.09
266	600221	海航控股	2,753,500	3,717,225.00	0.09
267	000157	中联重科	532,800	3,713,616.00	0.09
268	601179	中国西电	245,800	3,667,336.00	0.09
269	301358	湖南裕能	48,200	3,656,934.00	0.09
270	688036	传音控股	61,537	3,627,606.15	0.09

271	605499	东鹏饮料	29,090	3,590,578.70	0.08
272	300803	指南针	39,025	3,577,421.75	0.08
273	688234	天岳先进	20,613	3,576,561.63	0.08
274	600011	华能国际	469,700	3,565,023.00	0.08
275	600048	保利发展	765,700	3,545,191.00	0.08
276	600436	片仔癀	32,434	3,544,387.52	0.08
277	002195	岩山科技	538,700	3,523,098.00	0.08
278	600438	通威股份	288,400	3,492,524.00	0.08
279	600497	驰宏锌锗	288,100	3,488,891.00	0.08
280	601077	渝农商行	570,300	3,484,533.00	0.08
281	002850	科达利	18,400	3,483,120.00	0.08
282	600115	中国东航	909,110	3,463,709.10	0.08
283	002493	荣盛石化	321,350	3,454,512.50	0.08
284	002236	大华股份	208,800	3,443,112.00	0.08
285	600570	恒生电子	161,210	3,416,039.90	0.08
286	600886	国投电力	256,500	3,414,015.00	0.08
287	600188	兖矿能源	190,446	3,384,225.42	0.08
288	002261	拓维信息	120,600	3,378,006.00	0.08
289	600157	永泰能源	2,084,699	3,356,365.39	0.08
290	688629	四川华丰科技	17,643	3,308,238.93	0.08
291	002736	国信证券	330,700	3,303,693.00	0.08
292	688047	龙芯中科	21,319	3,297,409.73	0.08
293	003816	中国广核	837,200	3,273,452.00	0.08
294	601360	三六零	375,100	3,259,619.00	0.08
295	000301	东方盛虹	284,500	3,257,525.00	0.08
296	600711	盛屯矿业	296,600	3,253,702.00	0.08
297	601058	赛轮轮胎	280,200	3,230,706.00	0.08
298	002340	格林美	486,800	3,217,748.00	0.08
299	600909	华安证券	288,770	3,208,234.70	0.08
300	600026	中远海能	178,600	3,204,084.00	0.08
301	002074	国轩高科	116,000	3,191,160.00	0.08
302	600143	金发科技	204,700	3,162,615.00	0.07
303	601901	方正证券	438,500	3,157,200.00	0.07
304	688052	纳芯微电子	10,828	3,121,820.68	0.07
305	003031	中瓷电子	17,300	3,119,190.00	0.07
306	002821	凯莱英	19,096	3,093,552.00	0.07
307	300017	网宿科技	237,700	3,092,477.00	0.07
308	688411	海博思创	10,602	3,087,302.40	0.07
309	002131	利欧股份	648,816	3,081,876.00	0.07
310	000783	长江证券	315,300	3,074,175.00	0.07
311	600009	上海机场	132,700	3,065,370.00	0.07
312	600196	复星医药	135,900	3,053,673.00	0.07

313	000768	中航西飞	149,100	3,053,568.00	0.07
314	688027	科大国盾量子	6,010	3,029,100.10	0.07
315	002203	海亮股份	132,000	3,016,200.00	0.07
316	601788	光大证券	209,000	3,015,870.00	0.07
317	000975	山金国际	177,100	3,010,700.00	0.07
318	601111	中国国航	496,100	3,001,405.00	0.07
319	600352	浙江龙盛	247,800	3,000,858.00	0.07
320	688220	翱捷科技	24,088	2,994,620.16	0.07
321	601555	东吴证券	377,802	2,992,191.84	0.07
322	301611	珂玛科技	16,600	2,989,162.00	0.07
323	002966	苏州银行	428,370	2,981,455.20	0.07
324	600029	南方航空	575,100	2,979,018.00	0.07
325	600415	小商品城	292,900	2,975,864.00	0.07
326	600674	川投能源	209,519	2,968,884.23	0.07
327	301200	大族数控	8,200	2,957,330.00	0.07
328	601233	桐昆股份	136,500	2,955,225.00	0.07
329	601456	国联民生	334,100	2,953,444.00	0.07
330	600219	南山铝业	739,600	2,951,004.00	0.07
331	603659	璞泰来	101,650	2,940,734.50	0.07
332	601186	中国铁建	492,200	2,928,590.00	0.07
333	601881	中国银河	232,300	2,920,011.00	0.07
334	300339	润和软件	75,800	2,919,058.00	0.07
335	601117	中国化学	394,000	2,895,900.00	0.07
336	688213	思特威电子科技	26,879	2,877,934.53	0.07
337	600233	圆通速递	182,100	2,868,075.00	0.07
338	601877	正泰电器	114,351	2,866,779.57	0.07
339	300759	康龙化成	98,300	2,843,819.00	0.07
340	301236	软通动力	66,700	2,831,415.00	0.07
341	688578	艾力斯医药科技	25,757	2,812,664.40	0.07
342	301269	华大九天	23,400	2,794,428.00	0.07
343	600372	中航机载	256,737	2,785,596.45	0.07
344	688235	百济神州	10,917	2,779,577.37	0.07
345	601878	浙商证券	291,900	2,773,050.00	0.07
346	603308	应流股份	45,600	2,754,240.00	0.07
347	688122	西部超导	43,455	2,729,408.55	0.06
348	002472	双环传动	65,000	2,698,150.00	0.06
349	601108	财通证券	311,880	2,697,762.00	0.06
350	300001	特锐德	70,900	2,682,147.00	0.06
351	300207	欣旺达	141,000	2,677,590.00	0.06
352	000963	华东医药	94,500	2,657,340.00	0.06

353	002517	恺英网络	163,500	2,656,875.00	0.06
354	603129	春风动力	10,300	2,634,740.00	0.06
355	600741	华域汽车	169,600	2,632,192.00	0.06
356	300458	全志科技	66,540	2,625,668.40	0.06
357	002797	第一创业	399,100	2,622,087.00	0.06
358	002601	龙佰集团	158,800	2,617,024.00	0.06
359	688506	百利天恒药 业	8,857	2,604,223.71	0.06
360	002920	德赛西威	31,900	2,599,850.00	0.06
361	601958	金钼股份	92,300	2,594,553.00	0.06
362	688385	复旦微电	36,130	2,575,707.70	0.06
363	688387	中信科移动	129,542	2,570,113.28	0.06
364	300115	长盈精密	90,400	2,525,776.00	0.06
365	601198	东兴证券	185,800	2,525,022.00	0.06
366	601991	大唐发电	355,300	2,515,524.00	0.06
367	000895	双汇发展	111,352	2,494,284.80	0.06
368	002155	湖南黄金	104,060	2,483,912.20	0.06
369	688322	奥比中光	19,018	2,482,799.90	0.06
370	600563	法拉电子	13,000	2,480,400.00	0.06
371	002304	洋河股份	64,900	2,475,935.00	0.06
372	001979	招商蛇口	384,500	2,472,335.00	0.06
373	688301	奕瑞科技股 份	19,621	2,433,004.00	0.06
374	300866	安克创新	23,000	2,403,500.00	0.06
375	002465	海格通信	188,100	2,402,037.00	0.06
376	601898	中煤能源	196,500	2,393,370.00	0.06
377	603156	养元饮品	48,432	2,376,558.24	0.06
378	300454	深信服	24,700	2,376,140.00	0.06
379	000703	恒逸石化	175,010	2,374,885.70	0.06
380	002056	横店东磁	77,800	2,371,344.00	0.06
381	601021	春秋航空	51,975	2,369,020.50	0.06
382	601665	齐鲁银行	409,400	2,362,238.00	0.06
383	603179	新泉股份	47,560	2,361,354.00	0.06
384	600884	杉杉股份	172,300	2,334,665.00	0.06
385	603650	彤程新材	23,700	2,322,126.00	0.05
386	300024	机器人	119,400	2,308,002.00	0.05
387	601319	中国人保	340,378	2,300,955.28	0.05
388	600707	彩虹股份	135,900	2,295,351.00	0.05
389	002130	沃尔核材	121,000	2,294,160.00	0.05
390	002402	和而泰	88,700	2,291,121.00	0.05
391	601162	天风证券	673,760	2,270,571.20	0.05
392	688676	海南金盘智 能科技	26,647	2,255,402.08	0.05

393	600023	浙能电力	427,100	2,246,546.00	0.05
394	300012	华测检测	161,700	2,241,162.00	0.05
395	000060	中金岭南	295,200	2,234,664.00	0.05
396	002429	兆驰股份	214,700	2,230,733.00	0.05
397	603379	三美股份	29,200	2,215,988.00	0.05
398	688331	荣昌生物	16,985	2,212,466.10	0.05
399	000878	云南铜业	139,300	2,212,084.00	0.05
400	601099	太平洋	656,035	2,210,837.95	0.05
401	002432	九安医疗	31,200	2,205,216.00	0.05
402	600039	四川路桥	279,140	2,182,874.80	0.05
403	300496	中科创达	35,100	2,168,829.00	0.05
404	601800	中国交建	379,600	2,167,516.00	0.05
405	600109	国金证券	246,700	2,166,026.00	0.05
406	000034	神州数码	77,760	2,157,840.00	0.05
407	002414	高德红外	162,611	2,156,221.86	0.05
408	002271	东方雨虹	181,500	2,154,405.00	0.05
409	000002	万 科 A	726,700	2,151,032.00	0.05
410	300623	捷捷微电	47,800	2,150,522.00	0.05
411	000893	亚钾国际	52,500	2,146,725.00	0.05
412	689009	九号公司	56,107	2,140,482.05	0.05
413	002335	科华数据	50,085	2,126,108.25	0.05
414	603688	石英股份	25,700	2,123,077.00	0.05
415	300474	景嘉微	35,100	2,122,848.00	0.05
416	002444	巨星科技	68,100	2,117,910.00	0.05
417	002487	大金重工	36,500	2,115,905.00	0.05
418	603979	金诚信	35,800	2,113,274.00	0.05
419	000733	振华科技	37,100	2,101,344.00	0.05
420	688728	格科微有限公司	99,864	2,101,138.56	0.05
421	600298	安琪酵母	58,000	2,099,600.00	0.05
422	600256	广汇能源	424,500	2,097,030.00	0.05
423	000661	长春高新	31,347	2,087,710.20	0.05
424	300763	锦浪科技	23,100	2,087,085.00	0.05
425	688223	晶科能源	438,875	2,084,656.25	0.05
426	600060	海信视像	74,400	2,073,528.00	0.05
427	301536	星辰科技	16,000	2,059,360.00	0.05
428	002756	永兴材料	36,210	2,050,934.40	0.05
429	688266	泽璟制药	17,580	2,050,882.80	0.05
430	300748	金力永磁	65,860	2,031,781.00	0.05
431	600021	上海电力	133,730	2,015,311.10	0.05
432	601128	常熟银行	346,085	2,014,214.70	0.05
433	001965	招商公路	219,800	2,013,368.00	0.05
434	601696	中银证券	158,800	2,008,820.00	0.05

435	601577	长沙银行	230,200	2,005,042.00	0.05
436	600588	用友网络	218,007	2,001,304.26	0.05
437	300073	当升科技	41,600	1,998,464.00	0.05
438	601633	长城汽车	132,408	1,998,036.72	0.05
439	600699	均胜电子	92,400	1,996,764.00	0.05
440	300142	沃森生物	153,700	1,996,563.00	0.05
441	002078	太阳纸业	158,500	1,979,665.00	0.05
442	601615	明阳智能	171,100	1,979,627.00	0.05
443	002025	航天电器	25,939	1,977,070.58	0.05
444	600600	青岛啤酒	37,825	1,975,599.75	0.05
445	300919	中伟新材	45,100	1,973,125.00	0.05
446	300432	富临精工	98,100	1,970,829.00	0.05
447	002157	正邦科技	700,800	1,969,248.00	0.05
448	603920	世运电路	40,900	1,964,836.00	0.05
449	688343	云天励飞股份	24,046	1,963,596.36	0.05
450	603606	东方电缆	47,220	1,960,102.20	0.05
451	000423	东阿阿胶	43,100	1,955,016.00	0.05
452	603087	甘李药业	34,300	1,946,868.00	0.05
453	688599	天合光能	135,444	1,912,469.28	0.05
454	002252	上海莱士	437,400	1,898,316.00	0.04
455	688169	石头科技	19,908	1,890,662.76	0.04
456	000728	国元证券	252,230	1,889,202.70	0.04
457	600027	华电国际	424,000	1,886,800.00	0.04
458	688608	恒玄科技	11,266	1,883,562.54	0.04
459	603369	今世缘	79,357	1,881,554.47	0.04
460	300724	捷佳伟创	26,400	1,863,840.00	0.04
461	300628	亿联网络	54,800	1,853,336.00	0.04
462	601618	中国中冶	758,100	1,849,764.00	0.04
463	300953	震裕科技	13,800	1,845,060.00	0.04
464	601607	上海医药	118,600	1,826,440.00	0.04
465	302132	中航成飞	31,275	1,823,958.00	0.04
466	603260	合盛硅业	37,700	1,819,402.00	0.04
467	600918	中泰证券	341,500	1,816,780.00	0.04
468	002064	华峰化学	188,800	1,791,712.00	0.04
469	603119	浙江荣泰股份	27,000	1,791,180.00	0.04
470	600061	国投资本	273,296	1,790,088.80	0.04
471	600025	华能水电	200,400	1,781,556.00	0.04
472	000786	北新建材	98,000	1,772,820.00	0.04
473	000617	中油资本	269,000	1,772,710.00	0.04
474	688375	国博电子	16,960	1,768,928.00	0.04
475	603290	斯达半导	11,500	1,758,810.00	0.04

476	300832	新产业	41,800	1,755,600.00	0.04
477	002831	裕同科技	49,228	1,750,547.68	0.04
478	001203	大中矿业	58,300	1,746,085.00	0.04
479	688180	君实生物	51,549	1,743,387.18	0.04
480	300251	光线传媒	156,400	1,734,476.00	0.04
481	600171	上海贝岭	54,300	1,734,342.00	0.04
482	688018	乐鑫科技	13,499	1,726,792.08	0.04
483	688187	时代电气	25,127	1,725,219.82	0.04
484	300679	电连技术	28,600	1,715,714.00	0.04
485	300383	光环新网	137,700	1,712,988.00	0.04
486	300677	英科医疗	43,540	1,705,461.80	0.04
487	600930	华电新能源集团	357,340	1,704,511.80	0.04
488	688472	阿特斯阳光电力	155,723	1,684,922.86	0.04
489	600085	同仁堂	72,700	1,680,097.00	0.04
490	000519	中兵红箭	79,700	1,679,279.00	0.04
491	603806	福斯特	99,916	1,677,589.64	0.04
492	688188	上海柏楚电子科技	15,714	1,676,683.80	0.04
493	600515	海南机场	610,533	1,672,860.42	0.04
494	002673	西部证券	257,504	1,671,200.96	0.04
495	601059	信达证券	102,700	1,662,713.00	0.04
496	600177	雅戈尔	220,600	1,661,118.00	0.04
497	603160	汇顶科技	26,900	1,659,999.00	0.04
498	600516	方大炭素	268,720	1,658,002.40	0.04
499	000559	万向钱潮	128,000	1,655,040.00	0.04
500	688065	凯赛生物	34,431	1,647,523.35	0.04
501	300972	万辰集团	9,500	1,647,395.00	0.04
502	601699	潞安环能	113,600	1,622,208.00	0.04
503	600642	申能股份	185,800	1,622,034.00	0.04
504	000999	华润三九	71,843	1,615,749.07	0.04
505	000623	吉林敖东	90,500	1,604,565.00	0.04
506	688568	中科星图公司	38,632	1,602,069.04	0.04
507	002624	完美世界	128,650	1,597,833.00	0.04
508	300699	光威复材	55,580	1,592,367.00	0.04
509	002085	万丰奥威	143,300	1,589,197.00	0.04
510	001696	宗申动力	76,300	1,587,803.00	0.04
511	603345	安井食品	19,800	1,587,762.00	0.04
512	000983	山西焦煤	272,700	1,581,660.00	0.04
513	600637	东方明珠	190,330	1,581,642.30	0.04
514	300558	贝达药业	24,300	1,581,201.00	0.04

515	603225	新凤鸣	79,700	1,566,105.00	0.04
516	600803	新奥股份	99,000	1,564,200.00	0.04
517	002318	久立特材	65,200	1,558,280.00	0.04
518	000750	国海证券	422,790	1,555,867.20	0.04
519	002739	儒意电影	161,900	1,554,240.00	0.04
520	002065	东华软件	214,700	1,532,958.00	0.04
521	600845	宝信软件	91,973	1,529,510.99	0.04
522	600100	同方股份	222,200	1,522,070.00	0.04
523	600499	科达制造	110,100	1,519,380.00	0.04
524	600536	中国软件	53,925	1,516,371.00	0.04
525	600369	西南证券	377,059	1,515,777.18	0.04
526	600018	上港集团	319,900	1,509,928.00	0.04
527	603596	伯特利	60,612	1,505,602.08	0.04
528	603444	吉比特	4,200	1,505,364.00	0.04
529	300122	智飞生物	128,500	1,502,165.00	0.04
530	300627	华测导航	52,840	1,500,656.00	0.04
531	600595	中孚实业	266,500	1,497,730.00	0.04
532	002266	浙富控股	295,900	1,497,254.00	0.04
533	688772	珠海冠宇电 池	76,209	1,495,982.67	0.04
534	000629	钒钛股份	447,400	1,494,316.00	0.04
535	002044	美年健康	297,000	1,493,910.00	0.04
536	688617	惠泰医疗	8,186	1,486,250.16	0.04
537	300002	神州泰岳	189,600	1,480,776.00	0.03
538	603699	纽威股份	29,300	1,473,790.00	0.03
539	300999	金龙鱼	63,300	1,472,358.00	0.03
540	601016	节能风电	379,270	1,471,567.60	0.03
541	002223	鱼跃医疗	57,200	1,467,752.00	0.03
542	000155	川能动力	122,200	1,463,956.00	0.03
543	000400	许继电气	67,300	1,460,410.00	0.03
544	002430	杭氧股份	46,878	1,451,342.88	0.03
545	601997	贵阳银行	282,738	1,450,445.94	0.03
546	300003	乐普医疗	122,388	1,450,297.80	0.03
547	601212	白银有色	285,400	1,449,832.00	0.03
548	600985	淮北矿业	103,000	1,447,150.00	0.03
549	601717	中创智领	103,800	1,443,858.00	0.03
550	000683	博源化工	250,400	1,442,304.00	0.03
551	000039	中集集团	177,400	1,438,714.00	0.03
552	000415	渤海租赁	352,500	1,434,675.00	0.03
553	601216	君正集团	320,000	1,427,200.00	0.03
554	000032	深桑达 A	57,200	1,427,140.00	0.03
555	300487	蓝晓科技	24,250	1,427,112.50	0.03
556	600521	华海药业	99,000	1,425,600.00	0.03

557	600862	中航高科	78,800	1,420,764.00	0.03
558	603766	隆鑫通用	118,600	1,414,898.00	0.03
559	600863	华能蒙电	300,800	1,413,760.00	0.03
560	300896	爱美客	16,100	1,403,920.00	0.03
561	600704	物产中大	297,400	1,403,728.00	0.03
562	000050	深天马 A	141,400	1,401,274.00	0.03
563	000596	古井贡酒	17,500	1,396,500.00	0.03
564	002841	视源股份	40,300	1,391,559.00	0.03
565	600312	平高电气	78,500	1,386,310.00	0.03
566	603077	和邦生物	596,600	1,384,112.00	0.03
567	688538	和辉光电	532,103	1,383,467.80	0.03
568	000708	中信特钢	109,500	1,381,890.00	0.03
569	601990	南京证券	209,000	1,373,130.00	0.03
570	601001	晋控煤业	78,900	1,372,071.00	0.03
571	600873	梅花生物	186,200	1,368,570.00	0.03
572	600765	中航重机	104,960	1,356,083.20	0.03
573	000729	燕京啤酒	133,700	1,354,381.00	0.03
574	603605	珀莱雅	22,600	1,354,192.00	0.03
575	000967	盈峰环境	128,400	1,352,052.00	0.03
576	600332	白云山	67,300	1,348,692.00	0.03
577	000887	中鼎股份	75,000	1,341,750.00	0.03
578	688692	达梦数据	5,472	1,336,754.88	0.03
579	688297	中航无人机	32,004	1,329,766.20	0.03
580	600166	福田汽车	456,100	1,327,251.00	0.03
581	601018	宁波港	417,600	1,315,440.00	0.03
582	600348	华阳股份	171,800	1,314,270.00	0.03
583	688009	中国通号	274,880	1,308,428.80	0.03
584	600153	建发股份	164,800	1,306,864.00	0.03
585	688615	合合信息	11,461	1,296,239.10	0.03
586	002939	长城证券	155,400	1,296,036.00	0.03
587	000830	鲁西化工	107,700	1,292,400.00	0.03
588	002007	华兰生物	105,720	1,288,726.80	0.03
589	002683	广东宏大	43,700	1,279,973.00	0.03
590	000062	深圳华强	40,100	1,275,982.00	0.03
591	601611	中国核建	114,300	1,274,445.00	0.03
592	002410	广联达	155,930	1,272,388.80	0.03
593	600737	中粮糖业	103,000	1,269,990.00	0.03
594	600901	江苏金租	219,480	1,262,010.00	0.03
595	688582	芯动联科	19,177	1,246,505.00	0.03
596	600578	京能电力	192,200	1,239,690.00	0.03
597	603728	鸣志电器	20,300	1,236,676.00	0.03
598	688114	华大智造	24,114	1,231,743.12	0.03
599	600363	联创光电	34,300	1,227,254.00	0.03

600	601799	星宇股份	13,500	1,223,370.00	0.03
601	002926	华西证券	149,400	1,220,598.00	0.03
602	000737	北方铜业	92,100	1,217,562.00	0.03
603	603568	伟明环保	78,570	1,208,406.60	0.03
604	000921	海信家电	44,100	1,204,812.00	0.03
605	600398	海澜之家	230,200	1,203,946.00	0.03
606	603298	杭叉集团	50,300	1,200,158.00	0.03
607	601238	广汽集团	235,900	1,198,372.00	0.03
608	000591	太阳能	259,600	1,194,160.00	0.03
609	001280	中国铀业	17,848	1,190,461.60	0.03
610	002603	以岭药业	79,100	1,186,500.00	0.03
611	601000	唐山港	284,500	1,180,675.00	0.03
612	688303	大全能源	67,230	1,171,818.90	0.03
613	000528	柳工	155,000	1,170,250.00	0.03
614	000738	航发控制	63,500	1,161,415.00	0.03
615	600486	扬农化工	22,867	1,159,356.90	0.03
616	300413	芒果超媒	78,900	1,154,307.00	0.03
617	301165	锐捷网络	14,300	1,150,435.00	0.03
618	603341	龙旗科技	27,052	1,149,439.48	0.03
619	600208	衢州发展	405,200	1,146,716.00	0.03
620	600170	上海建工	515,509	1,144,429.98	0.03
621	600435	北方导航	102,100	1,143,520.00	0.03
622	600008	首创环保	418,390	1,138,020.80	0.03
623	603486	科沃斯	22,400	1,136,800.00	0.03
624	600998	九州通	242,079	1,135,350.51	0.03
625	000932	华菱钢铁	326,500	1,132,955.00	0.03
626	600316	洪都航空	40,500	1,131,570.00	0.03
627	000987	越秀资本	143,005	1,118,299.10	0.03
628	000997	新大陆	68,600	1,118,180.00	0.03
629	600995	南网储能	90,800	1,116,840.00	0.03
630	603392	万泰生物	41,378	1,115,964.66	0.03
631	688248	南方电网电力科技	16,038	1,109,508.84	0.03
632	600282	南钢股份	239,300	1,098,387.00	0.03
633	600820	隧道股份	210,800	1,098,268.00	0.03
634	600161	天坛生物	94,546	1,094,842.68	0.03
635	002152	广电运通	116,500	1,092,770.00	0.03
636	603885	吉祥航空	105,700	1,087,653.00	0.03
637	601106	中国一重	329,294	1,086,670.20	0.03
638	000951	中国重汽	55,600	1,084,756.00	0.03
639	600483	福能股份	106,300	1,083,197.00	0.03
640	002262	恩华药业	57,700	1,081,875.00	0.03
641	600583	海油工程	212,000	1,066,360.00	0.03

642	000009	中国宝安	170,300	1,060,969.00	0.03
643	688778	厦钨新能源	19,407	1,055,740.80	0.02
644	603816	顾家家居	47,200	1,055,392.00	0.02
645	002500	山西证券	202,880	1,046,860.80	0.02
646	603338	浙江鼎力	24,240	1,030,200.00	0.02
647	688295	中复神鹰碳 纤维	16,982	1,028,090.28	0.02
648	000582	北部湾港	95,500	1,024,715.00	0.02
649	603939	益丰药房	56,957	1,024,086.86	0.02
650	600329	达仁堂	27,500	1,023,550.00	0.02
651	600562	国睿科技	48,100	1,020,682.00	0.02
652	601567	三星电气	68,000	1,015,920.00	0.02
653	688166	博瑞生物医 药	29,002	1,015,360.02	0.02
654	600763	通策医疗	29,796	1,009,488.48	0.02
655	600546	山煤国际	92,300	1,008,839.00	0.02
656	600602	云赛智联	62,300	1,001,784.00	0.02
657	601666	平煤股份	139,900	1,000,285.00	0.02
658	600685	中船防务	39,200	997,248.00	0.02
659	603565	中谷物流	101,600	996,696.00	0.02
660	688318	财富趋势	13,966	995,915.46	0.02
661	003022	联泓新科	38,400	994,560.00	0.02
662	601156	东航物流	61,400	989,768.00	0.02
663	002312	川发龙蟒	107,200	983,024.00	0.02
664	000723	美锦能源	293,200	982,220.00	0.02
665	300676	华大基因	28,000	981,680.00	0.02
666	600038	中直股份	38,700	978,723.00	0.02
667	601399	国机重装	278,330	974,155.00	0.02
668	000513	丽珠集团	33,700	973,593.00	0.02
669	600380	健康元	103,100	971,202.00	0.02
670	600390	五矿资本	212,200	967,632.00	0.02
671	601880	辽港股份	696,700	961,446.00	0.02
672	601865	福莱特	90,506	951,218.06	0.02
673	600132	重庆啤酒	22,900	945,770.00	0.02
674	600511	国药股份	36,300	945,252.00	0.02
675	600535	天士力	70,600	934,038.00	0.02
676	600906	财达证券	124,700	930,262.00	0.02
677	601236	红塔证券	136,260	929,293.20	0.02
678	300100	双林股份	33,380	927,296.40	0.02
679	688281	华秦科技实 业	18,432	925,839.36	0.02
680	000598	兴蓉环境	144,100	925,122.00	0.02
681	600816	建元信托	378,500	923,540.00	0.02

682	600977	中国电影	71,100	918,612.00	0.02
683	688336	三生国健	17,299	918,576.90	0.02
684	000739	普洛药业	54,900	914,634.00	0.02
685	002244	滨江集团	119,200	905,920.00	0.02
686	300735	光弘科技	38,900	884,586.00	0.02
687	002299	圣农发展	58,300	883,828.00	0.02
688	000883	湖北能源	203,600	879,552.00	0.02
689	600967	内蒙一机	80,800	876,680.00	0.02
690	600970	中材国际	122,600	874,138.00	0.02
691	601155	新城控股	85,000	872,100.00	0.02
692	300718	长盛轴承	14,300	871,871.00	0.02
693	002120	韵达股份	136,370	867,313.20	0.02
694	300146	汤臣倍健	95,700	865,128.00	0.02
695	300144	宋城演艺	147,220	855,348.20	0.02
696	000800	一汽解放	143,700	855,015.00	0.02
697	600131	国网信通	57,800	843,880.00	0.02
698	688278	特宝生物	15,464	841,241.60	0.02
699	000027	深圳能源	135,600	840,720.00	0.02
700	002568	百润股份	49,500	837,540.00	0.02
701	601608	中信重工	175,500	837,135.00	0.02
702	601136	首创证券	59,600	831,420.00	0.02
703	000088	盐田港	200,800	821,272.00	0.02
704	603737	三棵树	33,718	812,603.80	0.02
705	600095	湘财股份	107,700	810,981.00	0.02
706	688363	华熙生物	22,543	806,363.11	0.02
707	601866	中远海发	364,200	804,882.00	0.02
708	003021	兆威机电	9,100	794,885.00	0.02
709	600801	华新建材	50,800	792,480.00	0.02
710	603000	人民网	53,500	791,265.00	0.02
711	601118	海南橡胶	160,500	789,660.00	0.02
712	600126	杭钢股份	128,600	788,318.00	0.02
713	002583	海能达	101,800	782,842.00	0.02
714	600871	石化油服	382,300	776,069.00	0.02
715	600517	国网英大	165,400	774,072.00	0.02
716	600655	豫园股份	187,600	771,036.00	0.02
717	600566	济川药业	34,707	770,148.33	0.02
718	002984	森麒麟	58,800	768,516.00	0.02
719	600754	锦江酒店	42,500	764,575.00	0.02
720	000709	河钢股份	391,600	759,704.00	0.02
721	603858	步长制药	51,400	750,440.00	0.02
722	600598	北大荒	68,500	742,540.00	0.02
723	000825	太钢不锈	216,400	737,924.00	0.02
724	603589	口子窖	39,300	734,124.00	0.02

725	002423	中粮资本	89,000	732,470.00	0.02
726	601598	中国外运	146,800	728,128.00	0.02
727	002773	康弘药业	35,600	728,020.00	0.02
728	600004	白云机场	100,100	726,726.00	0.02
729	603899	晨光股份	35,200	726,176.00	0.02
730	001286	陕西能源	71,200	721,968.00	0.02
731	301606	绿联科技	11,800	720,036.00	0.02
732	600582	天地科技	160,200	712,890.00	0.02
733	600350	山东高速	63,800	710,094.00	0.02
734	688709	成都华微	18,577	707,597.93	0.02
735	601966	玲珑轮胎	69,100	704,129.00	0.02
736	600663	陆家嘴	111,600	700,848.00	0.02
737	600848	上海临港	93,500	700,315.00	0.02
738	000429	粤高速 A	51,200	698,880.00	0.02
739	688192	迪哲医药	17,388	694,302.84	0.02
740	688349	三一重能	45,539	691,282.02	0.02
741	688563	航空材料股份	13,219	677,209.37	0.02
742	601098	中南传媒	67,700	666,168.00	0.02
743	002508	老板电器	45,000	657,900.00	0.02
744	603233	大参林	43,320	651,099.60	0.02
745	600968	海油发展	195,500	651,015.00	0.02
746	601928	凤凰传媒	73,700	647,823.00	0.02
747	600062	华润双鹤	40,183	644,535.32	0.02
748	003035	南网能源	109,200	635,544.00	0.02
749	300957	贝泰妮	20,000	630,200.00	0.01
750	688425	铁建重工	156,733	630,066.66	0.01
751	300888	稳健医疗	22,480	629,215.20	0.01
752	601808	中海油服	58,000	626,980.00	0.01
753	688561	奇安信集团	26,037	624,367.26	0.01
754	002032	苏 泊 尔	15,700	621,720.00	0.01
755	002670	国盛证券	56,500	621,500.00	0.01
756	001391	国货航	152,000	618,640.00	0.01
757	600688	上海石化	206,300	604,459.00	0.01
758	000539	粤电力 A	88,200	600,642.00	0.01
759	688708	佳驰科技	11,778	598,322.40	0.01
760	600295	鄂尔多斯	55,500	594,960.00	0.01
761	600098	广州发展	100,600	594,546.00	0.01
762	000537	绿发电力	80,300	586,993.00	0.01
763	600808	马钢股份	225,200	563,000.00	0.01
764	002153	石基信息	77,457	560,014.11	0.01
765	600292	电投水电	45,800	551,432.00	0.01
766	600377	宁沪高速	47,500	549,575.00	0.01

767	601298	青岛港	67,400	542,570.00	0.01
768	002265	建设工业	30,500	530,700.00	0.01
769	000959	首钢股份	149,800	525,798.00	0.01
770	603833	欧派家居	17,200	517,892.00	0.01
771	301301	川宁生物	63,700	505,778.00	0.01
772	603786	科博达	12,000	490,920.00	0.01
773	600764	中国海防	28,100	489,783.00	0.01
774	000785	居然智家	243,300	486,600.00	0.01
775	603529	爱玛科技	24,900	485,799.00	0.01
776	601139	深圳燃气	85,600	484,496.00	0.01
777	600032	浙江新能	68,600	483,630.00	0.01
778	301498	乖宝宠物	11,900	483,021.00	0.01
779	002608	江苏国信	69,700	480,930.00	0.01
780	600606	绿地控股	393,646	476,311.66	0.01
781	600339	中油工程	154,700	474,929.00	0.01
782	603658	安图生物	16,200	470,124.00	0.01
783	688520	神州细胞集团 公司	13,717	469,258.57	0.01
784	300140	节能环保	89,900	446,803.00	0.01
785	000898	鞍钢股份	237,700	444,499.00	0.01
786	000937	冀中能源	110,940	441,541.20	0.01
787	688475	萤石网络	15,337	419,466.95	0.01
788	603049	中策橡胶	9,000	403,290.00	0.01
789	601228	广州港	142,300	401,286.00	0.01
790	601019	山东出版	62,300	398,720.00	0.01
791	603175	超颖电子	4,400	391,996.00	0.01
792	002945	华林证券	25,100	337,093.00	0.01
793	600927	永安期货	26,900	334,905.00	0.01
794	002461	珠江啤酒	43,100	326,267.00	0.01
795	601112	振石股份	17,400	317,202.00	0.01
796	688819	天能电池集团 股份	13,619	302,341.80	0.01
797	600299	安迪苏	37,400	293,590.00	0.01
798	603092	德力佳传动	3,500	188,895.00	0.00
799	001221	悍高集团	3,700	148,814.00	0.00
800	001386	马可波罗	10,300	145,848.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
2	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
3	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.01
4	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
5	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
6	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
7	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
8	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
9	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
10	688811	有研金属复材	834	20,124.42	0.00
11	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
12	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
13	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
14	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
15	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
16	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
17	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
18	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
19	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
20	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
21	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
22	400174	中天 3	371,600	3,716.00	0.00
23	603293	埃泰克汽车电子	72	2,442.96	0.00
24	001312	福恩股份	134	2,248.52	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	300308	中际旭创	72,164,083.75	1.34
2	300750	宁德时代	62,367,474.60	1.16
3	300502	新易盛	45,957,327.20	0.86
4	688012	中微半导体设备	29,032,582.61	0.54
5	002371	北方华创	27,177,293.61	0.51

6	000333	美的集团	25,022,988.60	0.47
7	000988	华工科技	18,505,960.17	0.34
8	002475	立讯精密	18,423,135.00	0.34
9	002916	深南电路	17,741,629.00	0.33
10	300059	东方财富	16,774,744.58	0.31
11	002594	比亚迪	15,458,637.00	0.29
12	300394	天孚通信	15,182,062.96	0.28
13	688072	拓荆科技	14,457,518.75	0.27
14	688498	源杰科技	14,207,930.81	0.26
15	688256	寒武纪科技	12,879,134.96	0.24
16	300274	阳光电源	12,557,664.60	0.23
17	300857	协创数据	12,473,350.20	0.23
18	300476	胜宏科技	12,118,452.00	0.23
19	002384	东山精密	12,109,020.98	0.23
20	000725	京东方 A	11,533,643.00	0.21

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	300308	中际旭创	119,954,799.89	2.23
2	300750	宁德时代	112,774,251.01	2.10
3	300502	新易盛	72,204,164.00	1.34
4	000333	美的集团	43,330,898.32	0.81
5	002371	北方华创	39,181,947.10	0.73
6	002475	立讯精密	34,162,443.78	0.64
7	300059	东方财富	28,510,540.17	0.53
8	002594	比亚迪	27,480,518.64	0.51
9	002384	东山精密	23,915,707.00	0.45
10	300274	阳光电源	23,174,138.00	0.43
11	300394	天孚通信	22,994,634.37	0.43
12	002916	深南电路	21,750,700.00	0.41
13	300476	胜宏科技	21,687,413.75	0.40
14	600487	亨通光电	21,523,594.02	0.40
15	688256	寒武纪科技	20,124,914.07	0.37
16	000725	京东方 A	19,677,317.00	0.37
17	000858	五粮液	18,986,504.67	0.35
18	000651	格力电器	18,636,700.21	0.35
19	300857	协创数据	17,589,445.46	0.33
20	000338	潍柴动力	17,558,477.00	0.33

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	1,665,002,093.46
卖出股票收入（成交）总额	2,320,184,157.97

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	401,010.52	0.01
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	401,010.52	0.01

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	111025	圣泉转债	1,970	197,002.59	0.00
2	113704	春风转债	1,530	153,007.04	0.00
3	118071	华峰转债	510	51,000.89	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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,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	17,833,070.75
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	17,833,070.75

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	301666	大普微	565,262.60	0.01	新股流通受限
2	688820	盛合晶微	338,302.59	0.01	新股流通受限
3	688781	视涯科技	267,083.60	0.01	新股流通受限
4	001399	惠科股份	179,912.24	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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		平安银行股份有限公司-汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
4,532	666,689.58	2,903,637,665.00	96.10	117,799,533.00	3.90	17,262,800.00	0.57

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 10 月 08 日）基金份额总额	6,601,437,198.00
本报告期期初基金份额总额	4,290,437,198.00
本报告期基金总申购份额	1,620,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,889,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	3,021,437,198.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

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

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
银河证券	2	1,465,966,951.56	36.80	257,874.01	36.80	
东方证券	2	1,340,807,508.27	33.66	235,864.83	33.66	
华泰证券	2	1,176,376,760.94	29.53	206,930.15	29.53	
广发证券	3	—	—	—	—	
国泰海通	2	—	—	—	—	
平安证券	2	—	—	—	—	
申万宏源	2	—	—	—	—	

证券						
兴业证券	1	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投 证券	1	-	-	-	-	
中信证券	3	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	80,000,000.00	100.00	-	-	-	-
华泰证券	330,560.00	100.00	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加世纪证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 12 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所基金变更扩位证券简称的公告	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 03 月 27 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,	2026 年 03 月 30 日

	要	深交所,上交所	
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 04 月 22 日
8	2025 年度汇添富基金管理股份有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026 年 04 月 30 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加金融街证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 05 月 18 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 06 月 06 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2026 年 5 月 7 日至 2026 年 6 月 30 日	703,134,200.00	407,736,000.00	323,272,100.00	787,598,100.00	26.07
产品特有风险							

1、持有人大会投票权集中的风险

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。

2、基金规模较小导致的风险

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。

3、提前终止基金合同的风险

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。

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、中国证监会批准中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 800 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 800 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日