

弘毅远方国证民企领先 100 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:弘毅远方基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至6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	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55

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	55
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
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	56
10.8 其他重大事件	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	弘毅远方国证民企领先100ETF
场内简称	民企ETF弘毅远方
基金主代码	159973
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年07月16日
基金管理人	弘毅远方基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	199,976,423.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019年08月09日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（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，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，追求尽可能贴近标的指数的表现。 特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股股票长期停牌；（4）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

	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3%。当跟踪偏离度和年化跟踪误差超过上述目标范围时，基金管理人将通过归因分析模型找出跟踪误差的来源，并采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	国证民企领先100指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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		弘毅远方基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郁双爽	罗琦
	联系电话	021-53682888	020-66338888
	电子邮箱	service@honyfunds.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-920-8800	95575
传真		021-53682755	020-87553363-6847
注册地址		上海市黄浦区中山东二路600号外滩金融中心S1幢30层（实际楼层28层）06单元	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		上海市黄浦区中山东二路600号外滩金融中心S1幢30层04-07单元	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		200010	510627
法定代表人		黄薇薇	林传辉

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.honyfunds.com
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区南泉北路429号泰康保险大厦25楼

§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	27,436,975.68
本期利润	65,474,876.98
加权平均基金份额本期利润	0.3242
本期加权平均净值利润率	16.43%
本期基金份额净值增长率	17.51%
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	60,717,425.00
期末可供分配基金份额利润	0.3036
期末基金资产净值	438,767,944.02
期末基金份额净值	2.1941
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	119.41%

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

2、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认/申购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认/申购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

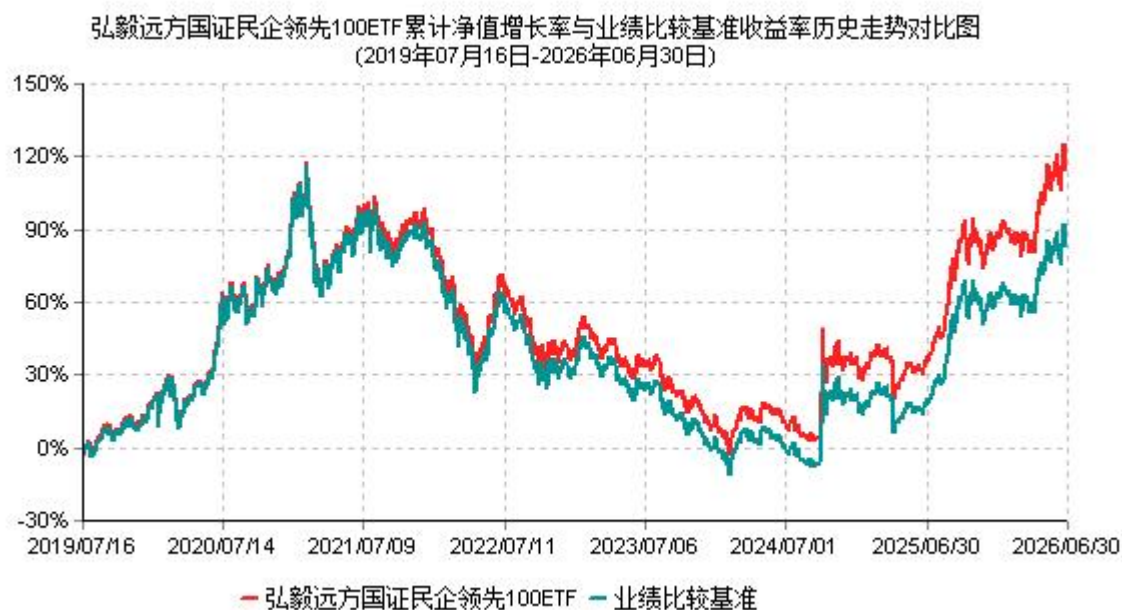
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 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	20.91%	1.72%	19.17%	1.72%	1.74%	0.00%
过去六个月	17.51%	1.49%	15.50%	1.50%	2.01%	-0.01%
过去一年	60.93%	1.50%	56.97%	1.51%	3.96%	-0.01%
过去三年	61.84%	1.54%	48.00%	1.55%	13.84%	-0.01%
过去五年	9.97%	1.50%	-5.13%	1.51%	15.10%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	119.41%	1.52%	86.71%	1.53%	32.70%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为国证民企领先100指数收益率。

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



注：本基金基金合同生效日为2019年7月16日。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

弘毅远方基金管理有限公司是经中国证监会证监许可【2017】2439号批准，由弘毅投资（北京）有限公司发起设立。注册资本4.09亿元人民币（截至2026年6月30日）。目前股权结构为：弘毅投资（北京）有限公司持股100%。截至2026年6月30日，本基金管理人共管理10只开放式基金，即弘毅远方国企转型升级混合型发起式证券投资基金、弘毅远方消费升级混合型发起式证券投资基金、弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金、弘毅远方久盈混合型证券投资基金、弘毅远方汽车产业升级混合型证券投资基金、弘毅远方中短债债券型证券投资基金、弘毅远方甄选混合型发起式证券投资基金、弘毅远方北证50成份指数型发起式证券投资基金、弘毅远方医疗创新混合型发起式证券投资基金、弘毅远方睿选混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马佳	本基金基金经理;弘毅远方久盈混合型证券投资基金基金经理;弘毅远方北证50成份指数型发起式证券投资基金;金融工程部总经理	2022-09-06	-	16年	华东理工大学数学与应用数学学士。曾任上海海烟物流发展有限公司财务部财务分析员、德勤华永会计师事务所企业风险管理服务部经理、太平洋资产管理有限责任公司合规与风险管理部董事。2018年7月加入弘毅远方基金管理有限公司，曾任弘毅远方甄选混合型发起式证券投资基金基金经理、风控合规部负责人。

注：1、基金经理的任职日期及离任日期即本基金管理人对外披露的任免日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金的基金管理人严格遵守《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，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。基金投资管理符合有关法律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

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下管理的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不存在超过该证券当日总成交量5%的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

本基金跟踪国证民企领先100指数，该指数从实际控制人为非国有独资、非国有控股及非外资控股的上市公司中选取100只各行业龙头企业、流动性好且研发投入高的证券作为指数样本，为投资者提供优质民营企业的投资标的。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2026年上半年权益市场整体是一个震荡行情，3月中东冲突导致市场大幅下行后，4月开始以科技为主线放量上升，但除科技以外其余板块处于震荡状态。上半年来看，以科创50、创业板指为代表的成长板块表现优于以中证红利、上证50为代表的价值板块，半导体材料设备、光模块、存储等方向表现比较亮眼。

基金运作层面，报告期内，本基金严格遵守基金合同，认真对待投资者申购、赎回等事项，保障基金的正常运作，运作过程中未发生风险事件。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末弘毅远方国证民企领先100ETF基金份额净值为2.1941元，本报告期内，基金份额净值增长率为17.51%，同期业绩比较基准收益率为15.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本报告期内利好民营经济的政策持续出台。2026年5月17日，市场监管总局印发《市场监管部门促进民营经济发展壮大2026年工作要点》，提出34项重点工作任务，坚持监管规范与促进发展并重，持续营造公平竞争环境、创新监管治理方式、提升发展服务能力，以更优环境、更实举措、更强支撑，推动民营经济高质量发展。2026年5月27日，最高人民法院审判委员会在国新办新闻发布会上表示，人民法院将坚持“两个毫不动摇”，贯彻落实民营经济促进法，依法平等保护各类经营主体合法权益。着力解决利用刑事、行政手段干预经济纠纷，特别是解决趋利性和违规异地执法司法等问题，健全常态化防范纠正冤错案件机制。2026年6月16日，国家发展改革委主任郑栅洁主持召开座谈会，围绕当前经济形势和系统推进“六张网”建设、扩大国内有效需求，听取意见建议。下一步，国家发展改革委将纵深推进全国统一大市场建设，规范地方招商引资行为，推进基础设施竞争性领域向经营主体公平开放，完善民营企业参与重大项目建设长效机制，积极吸引社会资本参与“六张网”建设，有效激发民间投资活力，以务实举措促进民营经济发展壮大。

本报告期内民营经济表现依然亮眼，特别在出海贸易、工业企业表现显著。

海关总署发布的数据显示，2026年上半年，我国货物贸易进出口总值25.47万亿元人民币，同比增长16.9%。其中，出口14.73万亿元，增长13.4%；进口10.74万亿元，增长22.1%。民营企业进出口14.53万亿元，同比增长17%，占外贸总值的近六成。

国家统计局发布的数据显示，2026年上半年，全国规模以上工业企业实现利润总额39,479.9亿元，同比增长18.7%。分经济类型看，国有控股企业增加值增长17.9%，股份制企业增长24.7%，外商及港澳台投资企业增长2.6%，民营企业增长13.0%。

2026年上半年，全国规模以上工业企业投资收益同比增长6.80%。规模以上工业企业中，国有控股企业增长9.50%，股份制企业下降3.00%，外商及港澳台投资企业增长9.70%；民营企业增长32.00%。

国证民企领先100指数纳入了全市场各个行业的龙头民营企业，主要覆盖制造、科技、消费三大类行业的优质公司。根据Wind分析师一致预期的预测，2026-2027年民企指数盈利CAGR将保持20%以上的高增长，有望为股东带来持续的高回报，而7月市场调整之后，估值回落到历史较低位置，26年PEG仅约0.6。展望未来，龙头民营企业将在政策助力下获得更好的发展，而本基金作为全市场历史长、规模大的民企主题ETF，兼备中短期投资机会和长期投资价值，为投资者投资民营企业提供了多样化的投资工具。

本基金将继续紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

根据中国证监会的相关规定，本公司针对停牌股票、债券不活跃市场报价等投资品种启用特殊估值流程，由估值委员会确定相应证券的估值方法。估值委员会成员包括公司高级管理人员、投资研究部、基金运营部、风控合规部、信息技术部等相关人员。

基金管理人估值委员会成员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。

基金经理参与公司启用特殊估值的流程，发表相关意见和建议，参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，本基金托管人在对弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金的管理人--弘毅远方基金管理有限公司在弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对弘毅远方基金管理有限公司编制和披露的弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金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：弘毅远方国证民企领先100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	2,344,433.40	2,136,581.55
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	436,685,177.63	379,071,785.36
其中：股票投资		436,605,173.95	379,071,785.36
基金投资		-	-
债券投资		80,003.68	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	59,845.76	-
资产总计		439,089,456.79	381,208,366.91
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		-	-
应付管理人报酬		106,225.85	96,485.82
应付托管费		70,817.24	64,323.87
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.23	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	144,469.45	190,000.00
负债合计		321,512.77	350,809.69
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	199,976,423.00	203,976,423.00
未分配利润	6.4.7.8	238,791,521.02	176,881,134.22
净资产合计		438,767,944.02	380,857,557.22
负债和净资产总计		439,089,456.79	381,208,366.91

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额净值2.1941元，基金份额总额199,976,423.00份，基金资产净值438,767,944.02元。

6.2 利润表

会计主体：弘毅远方国证民企领先100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20 25年06月30日
一、营业总收入		66,614,813.08	4,308,426.12
1.利息收入		2,387.07	5,241.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,387.07	5,241.76
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）		28,578,945.05	-1,579,515.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	25,137,843.25	-4,713,782.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3.47	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	3,441,098.33	3,134,267.16
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	38,037,901.30	5,871,221.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.17	-4,420.34	11,477.63
减：二、营业总支出		1,139,936.10	882,659.37
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	591,252.44	403,991.65

2.托管费	6.4.10.2.2	394,168.26	269,327.81
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.02	-
8.其他费用	6.4.7.18	154,515.38	209,339.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		65,474,876.98	3,425,766.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		65,474,876.98	3,425,766.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		65,474,876.98	3,425,766.75

6.3 净资产变动表

会计主体：弘毅远方国证民企领先100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	203,976,423.00	176,881,134.22	380,857,557.22
二、本期期初净资产	203,976,423.00	176,881,134.22	380,857,557.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	61,910,386.80	57,910,386.80

（一）、综合收益总额	-	65,474,876.98	65,474,876.98
（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）	-4,000,000.00	-3,564,490.18	-7,564,490.18
其中：1.基金申购款	4,000,000.00	3,740,215.03	7,740,215.03
2.基金赎回款	-8,000,000.00	-7,304,705.21	-15,304,705.21
（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	199,976,423.00	238,791,521.02	438,767,944.02
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	200,976,423.00	69,565,363.75	270,541,786.75
二、本期期初净资产	200,976,423.00	69,565,363.75	270,541,786.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,000,000.00	5,288,465.50	10,288,465.50
（一）、综合收益总额	-	3,425,766.75	3,425,766.75
（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）	5,000,000.00	1,862,698.75	6,862,698.75

列)			
其中：1.基金申购款	19,000,000.00	7,196,734.95	26,196,734.95
2.基金赎回款	-14,000,000.00	-5,334,036.20	-19,334,036.20
(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	205,976,423.00	74,853,829.25	280,830,252.25

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：

黄薇薇

丁旺

黄怿俊

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

弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]997号《关于准予弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由弘毅远方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币384,975,999.00元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0384号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年7月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为384,976,423.00份基金份额，其中认购资金利息折合424.00份基金份额。本基金的基金管理人为弘毅远方基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行

上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、衍生工具(权证、股指期货等)、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为：国证民企领先100指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	106,424.25
等于：本金	106,357.63
加：应计利息	66.62
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	2,238,009.15
等于：本金	2,237,960.92
加：应计利息	48.23
减：坏账准备	-
合计	2,344,433.40

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	269,288,010.1	-	436,605,173.9	167,317,163.8

		3		5	2
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	80,000.00	3.68	80,003.68	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	80,000.00	3.68	80,003.68	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		269,368,010.13	3.68	436,685,177.63	167,317,163.82

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	59,845.76
合计	59,845.76

6.4.7.6 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-IOPV计算费	9,916.99
预提费用-审计费	74,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付-股利到账	249.90
合计	144,469.45

6.4.7.7 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	203,976,423.00	203,976,423.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-8,000,000.00	-8,000,000.00
本期末	199,976,423.00	199,976,423.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,032,401.89	142,848,732.33	176,881,134.22
本期期初	34,032,401.89	142,848,732.33	176,881,134.22
本期利润	27,436,975.68	38,037,901.30	65,474,876.98

本期基金份额交易产生的变动数	-751,952.57	-2,812,537.61	-3,564,490.18
其中：基金申购款	730,634.71	3,009,580.32	3,740,215.03
基金赎回款	-1,482,587.28	-5,822,117.93	-7,304,705.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,717,425.00	178,074,096.02	238,791,521.02

6.4.7.9 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	1,841.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	545.38
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,387.07

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	20,460,217.85
股票投资收益——赎回差价收入	4,677,625.40
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	25,137,843.25

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	73,227,351.75
减：卖出股票成本总额	52,694,487.02
减：交易费用	72,646.88
买卖股票差价收入	20,460,217.85

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
赎回基金份额对价总额	15,304,705.21
减：现金支付赎回款总额	4,239,936.21
减：赎回股票成本总额	6,387,143.60
减：交易费用	-
赎回差价收入	4,677,625.40

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

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	3.47
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	3.47

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 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	3,441,098.33
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	3,441,098.33

6.4.7.16 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	38,037,901.30
——股票投资	38,037,901.30
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	38,037,901.30

6.4.7.17 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	-
ETF基金替代损益	-4,420.34
合计	-4,420.34

6.4.7.18 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
固定注册登记费	60,154.24
IOPV计算费	9,916.99
存托凭证服务费	141.59
合计	154,515.38

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大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

无。

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
弘毅远方基金管理有限公司（“弘毅远方基金”）	基金管理人
弘毅投资（北京）有限公司（“弘毅投资”）	基金管理人的股东

广发证券股份有限公司（“广发证券”）	基金托管人、基金销售机构
--------------------	--------------

注：下述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
广发证券	144,179,281.88	100.00%	231,271,069.95	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 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
广发证券	26,802.55	100.00%	-	-
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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比 例		额的比例
广发证券	31,305.84	100.0 0%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再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2 026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2 025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	591,252.44	403,991.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,284.27	853.26
应支付基金管理人的净管理费	588,968.17	403,138.39

注：支付基金管理人弘毅远方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

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202 6年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	394,168.26	269,327.81

注：支付基金托管人广发证券的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	363,643.00	363,643.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	180,000.00	-
报告期末持有的基金份额	183,643.00	363,643.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.09%	0.18%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

无。

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
广发证券-托管户	106,424.25	1,841.69	325,702.20	1,971.66
广发证券-证券户	2,238,009.15	545.38	1,690,579.56	3,270.10

注：本基金托管户的银行存款由基金托管人广发证券存放在交通银行广东省分行营业部；本基金证券户的存款由基金托管人广发证券保管。按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

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
688802	沐曦股份	2025-12-0	9个月	科创板打	104.66	768.89	1,065	111,462.	818,867.	-

		9		新限售				90	85	
301666	大普微	2026-04-08	6个月	创业板打新限售	46.08	463.33	619	28,523.52	286,801.27	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	103	8,433.64	163,185.99	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	科创板打新限售	22.68	42.16	3,620	82,101.60	152,619.20	-
001248	华润新能	2026-06-24	6个月	新股锁定	10.11	10.11	14,993	151,579.23	151,579.23	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9个月	科创板打新限售	83.06	126.45	1,188	98,675.28	150,222.60	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	科创板打新限售	9.47	70.14	1,218	11,534.46	85,430.52	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	科创板打新限售	44.56	468.67	178	7,931.68	83,423.26	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	新股锁定	10.12	27.73	2,388	24,166.56	66,219.24	-
001248	华润新能	2026-06-2	7个交易日	新股未上	10.11	10.11	6,425	64,956.7	64,956.7	-

		4	日	市				5	5	
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	创业板打新限售	69.66	160.06	360	25,077.60	57,621.60	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	科创板打新限售	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	科创板打新限售	92.18	463.15	103	9,494.54	47,704.45	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	科创板打新限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	科创板打新限售	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股锁定	7.82	20.74	1,666	13,028.12	34,552.84	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	222	4,368.96	31,410.78	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股锁定	17.70	84.32	267	4,725.90	22,513.44	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	科创板打新限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

				售						
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	创业板打新限售	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	创业板打新限售	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	创业板打新限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月	创业板打新限售	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	创业板打新限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	新股锁定	27.19	31.31	435	11,827.65	13,619.85	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	创业板打新限售	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	新股锁定	30.38	38.99	304	9,235.52	11,852.96	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	创业板打新限售	78.38	121.77	88	6,897.44	10,715.76	-

				售						
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	新股锁定	53.26	58.74	174	9,267.24	10,220.76	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	科创板打新限售	55.95	57.10	169	9,455.55	9,649.90	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	创业板打新限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股锁定	11.18	17.59	388	4,337.84	6,824.92	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
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	受限期	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本	期末估值	备注

		日		类型		单价	位：张)	总额	总额	
113704	春风转债	2026-06-10	18个工作日	新债未上市	100.00	100.00	800	80,000.00	80,003.68	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月或9个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

本基金为股票型基金，预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可

转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、衍生工具（权证、股指期货等）、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的多层次立体风险管理体系。董事会及风险管理委员会、经营管理层及风险控制委员会、督察长、风控合规部以及各个业务部门、各岗位在各自职责范围内依法履行职责，形成高效、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析相结合的风险管理方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金托管人广发证券的托管账户，开立于交通银行股份有限公司，其他存款存放于广发证券，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；本基金尚未开展银行间同业市场交易。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2026年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.02%(于2025年12月31日，本基金无债券投资)。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	80,003.68	-

未评级	-	-
合计	80,003.68	-

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2026年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低(2025年12月31日：同)。

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。

本基金的投资市场主要为证券交易所等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券等），在正常情况下均具有良好的流动性。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。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。

综合上述各项流动性指标的监控结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,344,433.40	-	-	-	2,344,433.40
交易性金融资产	80,003.68	-	-	436,605,173.95	436,685,177.63
其他资产	-	-	-	59,845.76	59,845.76
资产总计	2,424,437.08	-	-	436,665,019.71	439,089,456.79
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	106,225.85	106,225.85
应付托管费	-	-	-	70,817.24	70,817.24
应交税费	-	-	-	0.23	0.23
其他负债	-	-	-	144,469.45	144,469.45
负债总计	-	-	-	321,512.77	321,512.77
利率敏感度缺口	2,424,437.08	-	-	436,343,506.94	438,767,944.02

上年度 末 2025年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,136,581.55	-	-	-	2,136,581.55
交易性金融资产	-	-	-	379,071,785.36	379,071,785.36
资产总计	2,136,581.55	-	-	379,071,785.36	381,208,366.91
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	96,485.82	96,485.82
应付托管费	-	-	-	64,323.87	64,323.87
其他负债	-	-	-	190,000.00	190,000.00
负债总计	-	-	-	350,809.69	350,809.69
利率敏感度缺口	2,136,581.55	-	-	378,720,975.67	380,857,557.22

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（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，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，追求尽可能贴近标的指数的表现。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	436,605,173.95	99.51	379,071,785.36	99.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	80,003.68	0.02	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产	-	-	-	-
—权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	436,685,177.63	99.53	379,071,785.36	99.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上涨5%	21,711,733.90	18,765,772.50
	业绩比较基准下降5%	-21,711,733.90	-18,765,772.50

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	上年度末 2025年12月31日
第一层次	434,052,068.35	378,049,559.18
第二层次	296,539.66	-
第三层次	2,336,569.62	1,022,226.18
合计	436,685,177.63	379,071,785.36

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	436,605,173.95	99.43
	其中：股票	436,605,173.95	99.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,003.68	0.02
	其中：债券	80,003.68	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金	-	-

	融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	2,344,433.40	0.53
8	其他各项资产	59,845.76	0.01
9	合计	439,089,456.79	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	637,935.00	0.15
C	制造业	385,400,791.97	87.84
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	1,346,948.00	0.31
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	22,570,074.00	5.14
J	金融业	18,938,866.38	4.32
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	4,513,315.00	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	644,138.00	0.15
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	434,052,068.35	98.93
--	----	----------------	-------

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	34,552.84	0.01
C	制造业	2,300,433.32	0.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	216,535.98	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,553,105.60	0.58

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	139,255	54,728,607.55	12.47
2	300308	中际旭创	41,400	52,578,000.00	11.98
3	300502	新易盛	42,472	25,780,504.00	5.88
4	000333	美的集团	211,070	15,942,117.10	3.63
5	300059	东方财富	711,701	14,504,466.38	3.31
6	600276	恒瑞医药	266,506	13,868,972.24	3.16
7	002384	东山精密	50,200	13,169,970.00	3.00
8	002475	立讯精密	180,000	12,672,000.00	2.89
9	300274	阳光电源	73,580	11,700,691.60	2.67
10	002594	比亚迪	145,300	11,580,410.00	2.64
11	300394	天孚通信	32,120	9,722,081.60	2.22
12	301308	江波龙	11,400	8,023,320.00	1.83
13	300124	汇川技术	119,050	7,896,586.50	1.80
14	000063	中兴通讯	203,110	7,350,550.90	1.68
15	600522	中天科技	120,800	7,330,144.00	1.67
16	002008	大族激光	48,100	7,220,291.00	1.65
17	600487	亨通光电	63,500	6,943,090.00	1.58
18	600031	三一重工	316,300	5,465,664.00	1.25
19	002028	思源电气	31,000	5,363,000.00	1.22
20	601138	工业富联	72,500	5,230,875.00	1.19
21	300014	亿纬锂能	75,600	4,916,268.00	1.12
22	600089	特变电工	216,700	4,875,750.00	1.11
23	688777	中控技术	39,300	4,617,750.00	1.05
24	002050	三花智控	103,050	4,516,681.50	1.03

25	300433	蓝思科技	84,100	4,512,806.00	1.03
26	300033	同花顺	18,400	4,434,400.00	1.01
27	688111	金山办公	20,000	4,261,000.00	0.97
28	600105	永鼎股份	61,100	4,123,028.00	0.94
29	002938	鹏鼎控股	35,900	3,783,142.00	0.86
30	300395	菲利华	26,300	3,517,099.00	0.80
31	002353	杰瑞股份	22,400	3,416,000.00	0.78
32	600660	福耀玻璃	67,300	3,394,612.00	0.77
33	002837	英维克	41,500	3,301,740.00	0.75
34	688271	联影医疗	30,800	3,117,884.00	0.71
35	002241	歌尔股份	130,300	2,935,659.00	0.67
36	601100	恒立液压	27,256	2,931,655.36	0.67
37	002625	光启技术	91,000	2,759,120.00	0.63
38	002422	科伦药业	70,200	2,704,104.00	0.62
39	002600	领益智造	155,100	2,689,434.00	0.61
40	300442	润泽科技	28,100	2,334,267.00	0.53
41	300418	昆仑万维	57,500	2,320,700.00	0.53
42	002001	新 和 成	78,188	2,222,102.96	0.51
43	601689	拓普集团	38,210	2,155,808.20	0.49
44	603799	华友钴业	44,500	2,147,570.00	0.49
45	002558	巨人网络	74,700	2,058,732.00	0.47
46	688506	百利天恒	6,300	1,852,389.00	0.42
47	603288	海天味业	53,549	1,775,684.84	0.40
48	600196	复星医药	78,700	1,768,389.00	0.40
49	601360	三六零	198,300	1,723,227.00	0.39
50	600066	宇通客车	63,100	1,691,711.00	0.39
51	002532	天山铝业	156,900	1,683,537.00	0.38
52	603296	华勤技术	22,360	1,660,677.20	0.38
53	002648	卫星化学	69,300	1,627,857.00	0.37
54	300454	深信服	16,300	1,568,060.00	0.36
55	688331	荣昌生物	11,300	1,471,938.00	0.34

56	002595	豪迈科技	31,565	1,470,929.00	0.34
57	600143	金发科技	94,700	1,463,115.00	0.33
58	002414	高德红外	108,600	1,440,036.00	0.33
59	000963	华东医药	47,900	1,346,948.00	0.31
60	603087	甘李药业	23,600	1,339,536.00	0.31
61	300759	康龙化成	44,700	1,293,171.00	0.29
62	600989	宝丰能源	62,100	1,262,493.00	0.29
63	688180	君实生物	34,500	1,166,790.00	0.27
64	002624	完美世界	91,900	1,141,398.00	0.26
65	688169	石头科技	11,936	1,133,561.92	0.26
66	600588	用友网络	121,700	1,117,206.00	0.25
67	300012	华测检测	80,600	1,117,116.00	0.25
68	300347	泰格医药	22,200	1,065,600.00	0.24
69	600699	均胜电子	48,500	1,048,085.00	0.24
70	002294	信立泰	31,900	1,017,291.00	0.23
71	603444	吉比特	2,700	967,734.00	0.22
72	300628	亿联网络	27,400	926,668.00	0.21
73	300832	新产业	21,500	903,000.00	0.21
74	600521	华海药业	59,400	855,360.00	0.19
75	002831	裕同科技	23,875	848,995.00	0.19
76	603236	移远通信	16,560	847,375.20	0.19
77	002223	鱼跃医疗	33,000	846,780.00	0.19
78	300726	宏达电子	10,000	845,700.00	0.19
79	601633	长城汽车	56,000	845,040.00	0.19
80	300122	智飞生物	70,700	826,483.00	0.19
81	002603	以岭药业	46,500	697,500.00	0.16
82	002007	华兰生物	56,600	689,954.00	0.16
83	002266	浙富控股	127,300	644,138.00	0.15
84	001203	大中矿业	21,300	637,935.00	0.15
85	603298	杭叉集团	26,300	627,518.00	0.14
86	688281	华秦科技	12,480	626,870.40	0.14

87	300938	信测标准	12,300	613,524.00	0.14
88	603195	公牛集团	14,046	549,900.90	0.13
89	688278	特宝生物	10,100	549,440.00	0.13
90	603486	科沃斯	10,000	507,500.00	0.12
91	301382	蜂助手	10,000	460,000.00	0.10
92	688363	华熙生物	12,100	432,817.00	0.10
93	300416	苏试试验	20,800	423,904.00	0.10
94	688708	佳驰科技	7,000	355,600.00	0.08
95	603658	安图生物	10,900	316,318.00	0.07
96	300888	稳健医疗	10,000	279,900.00	0.06
97	300048	合康新能	47,600	222,292.00	0.05
98	603049	中策橡胶	3,400	152,354.00	0.03
99	301061	匠心家居	3,700	129,759.00	0.03
100	001221	悍高集团	1,400	56,308.00	0.01

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	688802	沐曦股份	1,065	818,867.85	0.19
2	301666	大普微	619	286,801.27	0.07
3	001248	华润新能	21,418	216,535.98	0.05
4	688808	联讯仪器	103	163,185.99	0.04
5	688781	视涯科技	3,620	152,619.20	0.03
6	688790	昂瑞微	1,188	150,222.60	0.03
7	688818	电科蓝天	1,218	85,430.52	0.02
8	688797	臻宝科技	178	83,423.26	0.02
9	001399	惠科股份	2,388	66,219.24	0.02
10	301682	宏明电子	360	57,621.60	0.01
11	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01

12	688785	恒运昌	103	47,704.45	0.01
13	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
14	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
15	001257	盛龙股份	1,666	34,552.84	0.01
16	688820	盛合晶微	222	31,410.78	0.01
17	603459	红板科技	267	22,513.44	0.01
18	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
19	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
20	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
21	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
22	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
23	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
24	001365	天海电子	435	13,619.85	0.00
25	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
26	001393	维通利	304	11,852.96	0.00
27	301683	慧谷新材	88	10,715.76	0.00
28	001237	惠康科技	174	10,220.76	0.00
29	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
30	688816	易思维	169	9,649.90	0.00
31	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
32	601112	振石股份	388	6,824.92	0.00
33	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
34	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
35	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
36	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
37	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金
---	------	------	----------	-------

号				资产净值比例(%)
1	002384	东山精密	10,975,934.00	2.88
2	002008	大族激光	5,783,105.00	1.52
3	002028	思源电气	5,414,578.65	1.42
4	600089	特变电工	5,017,849.00	1.32
5	002353	杰瑞股份	3,369,073.00	0.88
6	600105	永鼎股份	3,233,756.00	0.85
7	300395	菲利华	3,195,342.00	0.84
8	002837	英维克	2,864,437.70	0.75
9	603799	华友钴业	2,254,266.00	0.59
10	002600	领益智造	2,213,116.00	0.58
11	300442	润泽科技	2,103,984.00	0.55
12	300750	宁德时代	1,788,714.00	0.47
13	002624	完美世界	1,214,133.00	0.32
14	600699	均胜电子	1,167,012.00	0.31
15	002294	信立泰	1,022,743.00	0.27
16	603444	吉比特	915,359.00	0.24
17	001203	大中矿业	910,852.00	0.24
18	688169	石头科技	906,104.45	0.24
19	300347	泰格医药	885,620.00	0.23
20	300122	智飞生物	877,658.00	0.23

注：本项"买入金额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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	300502	新易盛	10,495,904.20	2.76
2	300308	中际旭创	7,147,458.00	1.88

3	603501	豪威集团	4,877,199.00	1.28
4	300054	鼎龙股份	3,646,676.00	0.96
5	600570	恒生电子	2,514,404.00	0.66
6	002074	国轩高科	1,941,110.00	0.51
7	300059	东方财富	1,932,993.00	0.51
8	002714	牧原股份	1,907,900.92	0.50
9	000333	美的集团	1,324,232.00	0.35
10	601058	赛轮轮胎	1,291,066.00	0.34
11	600276	恒瑞医药	1,268,039.00	0.33
12	603129	春风动力	1,247,113.00	0.33
13	688036	传音控股	1,239,293.23	0.33
14	689009	九号公司	1,220,139.92	0.32
15	601138	工业富联	1,207,288.00	0.32
16	300394	天孚通信	1,206,839.00	0.32
17	300498	温氏股份	1,064,471.00	0.28
18	601233	桐昆股份	935,033.00	0.25
19	301236	软通动力	931,679.00	0.24
20	002065	东华软件	907,653.00	0.24

注：本项"卖出金额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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	72,998,695.91
卖出股票收入（成交）总额	73,227,351.75

注：本项"买入股票的成本（成交）总额"和"卖出股票的收入（成交）总额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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)	80,003.68	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	80,003.68	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113704	春风转债	800	80,003.68	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
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	59,845.76
8	其他	-
9	合计	59,845.76

无。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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的情况。

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	688802	沐曦股份	818,867.85	0.19	科创板打新限售
2	301666	大普微	286,801.27	0.07	创业板打新限售

3	001248	华润新能	216,535.98	0.05	新股未上市
4	688808	联讯仪器	163,185.99	0.04	科创板打新限售
5	688781	视涯科技	152,619.20	0.03	科创板打新限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
299	668,817.47	3,280,833.00	1.64%	196,695,590.00	98.36%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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07月16日)基金份额总额	384,976,423.00
本报告期期初基金份额总额	203,976,423.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	199,976,423.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人未发生受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员未发生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，基金托管人的专门基金托管部门未发生受稽查或处罚等情况。

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，基金托管人的专门基金托管部门相关从业人员未发生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	
广发证券	4	144,179,281.88	100.00%	26,802.55	100.00%	-

注：1、本基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，具备健全的内控制度，合规风控能力较强，交易能力、投研综合实力较强的证券经纪服务商提供服务。

2、本基金管理人完成内部审批程序后与证券经纪服务商、基金托管人签署证券经纪服务协议，对账户管理、数据传输、证券交易、资金管理、交易监控、费用收取等事项进行约定，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

3、本基金本报告期内交易单元未发生变更情况。

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	弘毅远方基金管理有限公司旗下基金2025年度基金份额净值和基金份额累计净值的公告	公司官网	2026-01-01
2	弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2026-01-22
3	弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金2025年第4季度报告提示性公告	上海证券报	2026-01-22
4	弘毅远方基金管理有限公司关于弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告	中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、公司网站	2026-02-09

	告		
5	弘毅远方基金管理有限公司关于暂停英大证券有限责任公司办理旗下基金相关销售业务公告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2026-01-30
6	弘毅远方基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	中国证监会基金电子披露网站、证券时报、公司网站	2026-02-04
7	弘毅远方基金管理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、证券时报、公司网站	2026-03-31
8	弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金2025年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2026-03-31
9	弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金2025年年度报告提示性公告	上海证券报	2026-03-31
10	关于弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、公司网站	2026-04-16
11	弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、公司网站	2026-04-22
12	弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金2026年第1季度报告提示性公告	上海证券报	2026-04-22

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

资 者 类 别	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
个人	1	20260101-20260630	194,976,982.00	0.00	0.00	194,976,982.00	97.50%
产品特有风险							
1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。 2、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。 3、基金运作发生重大变更的风险 极端情况下，单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产净值连续低于5000万元，需要根据基金合同约定采取相关解决措施，从而使得基金运作发生重大变更。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、基金管理人于2026年2月4日发布《弘毅远方基金管理有限公司关于增加注册资本的公告》，基金管理人股东弘毅投资（北京）有限公司向基金管理人增加出资人民币2900万元，增资完成后，基金管理人注册资本由人民币3.8亿元增加至人民币4.09亿元。
- 2、基金管理人于2026年2月9日发布《弘毅远方基金管理有限公司关于弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告》，基金管理人决定自2026年2月10日起变更本基金的场内简称，场内简称变更前为“民企ETF”，变更后为“民企ETF弘毅远方”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、关于申请募集注册弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金的法律意见书；

8、报告期内弘毅远方国证民企领先100交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站www.honyfunds.com查阅和下载。