

# 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有期混合型 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| § 1 重要提示及目录                             | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| § 2 基金简介                                | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现                       | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| § 4 管理人报告                               | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14 |
| 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             | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17 |
| 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       | 17 |
| § 5 托管人报告                               | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17 |
| 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 | 18 |
| 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        | 18 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计）                     | 18 |
| 6.1 资产负债表                               | 18 |
| 6.2 利润表                                 | 19 |
| 6.3 净资产变动表                              | 20 |
| 6.4 报表附注                                | 22 |
| § 7 投资组合报告                              | 48 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 48 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 49 |
| 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       | 50 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 51 |
| 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      | 52 |
| 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.....             | 54 |
| 7.12 本报告期投资基金情况.....                       | 54 |
| 7.13 投资组合报告附注.....                         | 55 |
| § 8 基金份额持有人信息.....                         | 56 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 56 |
| 8.2 盈利投资者数量占比.....                         | 56 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 57 |
| 8.4 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.....      | 57 |
| § 9 开放式基金份额变动.....                         | 57 |
| § 10 重大事件揭示.....                           | 58 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 58 |
| 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.....      | 58 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 58 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 58 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....               | 58 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 58 |
| 10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....          | 58 |
| 10.8 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.....      | 59 |
| 10.9 其他重大事件.....                           | 62 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 63 |
| 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.....   | 63 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 64 |
| § 12 备查文件目录.....                           | 64 |
| 12.1 备查文件目录.....                           | 64 |
| 12.2 存放地点.....                             | 64 |
| 12.3 查阅方式.....                             | 64 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                    |                             |                       |
|--------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 基金名称               | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金 |                       |
| 基金简称               | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合         |                       |
| 基金主代码              | 017298                      |                       |
| 基金运作方式             | 契约型开放式                      |                       |
| 基金合同生效日            | 2023 年 06 月 16 日            |                       |
| 基金管理人              | 汇添富基金管理股份有限公司               |                       |
| 基金托管人              | 中国工商银行股份有限公司                |                       |
| 报告期末基金份额总额（份）      | 45,165,887.11               |                       |
| 基金合同存续期            | 不定期                         |                       |
| 下属分级基金的基金简称        | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 A       | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 C |
| 下属分级基金的交易代码        | 017298                      | 017299                |
| 报告期末下属分级基金的份额总额（份） | 28,329,208.54               | 16,836,678.57         |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                     |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。                                                                                                                        |
| 投资策略   | 本基金采取稳健的投资策略，通过债券等固定收益类资产的投资力争平稳收益，并适度参与权益类资产的投资增强回报，在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。本基金的投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、基金投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、融资投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*15%+中证港股通综合指数收益率*5%+中债综合指数收益率*75%+同期银行活期存款利率（税后）*5%                                                                                                    |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。<br>本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。                                          |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目   |    | 基金管理人         | 基金托管人        |
|------|----|---------------|--------------|
| 名称   |    | 汇添富基金管理股份有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 | 姓名 | 李鹏            | 郭明           |

|        |      |                     |                     |
|--------|------|---------------------|---------------------|
| 负责人    | 联系电话 | 021-28932888        | ( 010 ) 66105799    |
|        | 电子邮箱 | service@99fund.com  | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 |      | 400-888-9918        | 95588               |
| 传真     |      | 021-28932998        | ( 010 ) 66105798    |
| 注册地址   |      | 上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 办公地址   |      | 上海市黄浦区外马路 728 号     | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码   |      | 200010              | 100140              |
| 法定代表人  |      | 鲁伟铭                 | 廖林                  |

2.4 信息披露方式

|                   |                               |
|-------------------|-------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 《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 | 汇添富基金管理股份有限公司 | 上海市黄浦区外马路 728 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2026 年 01 月 01 日 – 2026 年 06 月 30 日) |                      |
|---------------|------------------------------------------|----------------------|
|               | 汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 A                     | 汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 C |
| 本期已实现收益       | 3,352,096.32                             | 2,589,634.81         |
| 本期利润          | 4,732,357.98                             | 3,983,125.34         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1513                                   | 0.1383               |
| 本期加权平均净值利润率   | 13.19%                                   | 12.23%               |
| 本期基金份额净值增长率   | 13.97%                                   | 13.79%               |
| 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      | 6,938,613.47                             | 3,902,523.31         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2449                                   | 0.2318               |
| 期末基金资产净值      | 35,711,226.73                            | 20,998,063.49        |
| 期末基金份额净值      | 1.2606                                   | 1.2472               |
| 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   | 26.06%                                   | 24.72%               |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 A |              |                     |                    |                           |        |       |
|-----------------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 阶段                    | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①－③    | ②－④   |
| 过去三个<br>月             | 14.33%       | 0.57%               | 1.78%              | 0.23%                     | 12.55% | 0.34% |
| 过去六个<br>月             | 13.97%       | 0.56%               | 1.12%              | 0.22%                     | 12.85% | 0.34% |
| 过去一年                  | 17.58%       | 0.52%               | 2.98%              | 0.19%                     | 14.60% | 0.33% |
| 过去三年                  | 26.29%       | 0.38%               | 9.60%              | 0.21%                     | 16.69% | 0.17% |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今    | 26.06%       | 0.38%               | 9.04%              | 0.21%                     | 17.02% | 0.17% |
| 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 C |              |                     |                    |                           |        |       |
| 阶段                    | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①－③    | ②－④   |
| 过去三个<br>月             | 14.22%       | 0.57%               | 1.78%              | 0.23%                     | 12.44% | 0.34% |
| 过去六个<br>月             | 13.79%       | 0.56%               | 1.12%              | 0.22%                     | 12.67% | 0.34% |
| 过去一年                  | 17.19%       | 0.52%               | 2.98%              | 0.19%                     | 14.21% | 0.33% |
| 过去三年                  | 24.97%       | 0.38%               | 9.60%              | 0.21%                     | 15.37% | 0.17% |
| 自基金合<br>同生效起          | 24.72%       | 0.38%               | 9.04%              | 0.21%                     | 15.68% | 0.17% |

|    |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 至今 |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|

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

汇添富添鑫多元收益9个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图





汇添富添鑫多元收益9个月持有混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023 年 06 月 16 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）<br>期限 |      | 证券从业年限（年） | 说明                                                                                                                                                                                       |
|----|-------------------|---------------------|------|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                   | 任职日期                | 离任日期 |           |                                                                                                                                                                                          |
| 宋鹏 | 本基金的基金经理,养老金投资部总监 | 2023 年 06 月 16 日    | —    | 20        | 国籍：中国。<br>学历：复旦大学金融工程硕士。从业资格：证券投资基金从业资格,特许金融分析师 CFA。<br>从业经历：<br>2006 年 7 月至 2007 年 10 月任招商基金固收研究员，2007 年 11 月至 2011 年 2 月任摩根大通研究部策略分析师，2011 年 2 月至 2019 年 5 月历任平安资产管理公司固收投资部投资经理、部门总经理。 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>2019 年 5 月至今任汇添富基金养老金投资部总监。2021 年 8 月 26 日至今任汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 11 日至 2024 年 11 月 22 日任汇添富稳健睿享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 20 日至今任汇添富稳鑫 120 天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 23 日至今任汇添富双享回报债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 1 日至今任汇添富淳享一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 16 日至今任汇添富添鑫多元收益 9</p> |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|    |          |                  |   |    |                                                                                                                                                                                 |
|----|----------|------------------|---|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |          |                  |   |    | 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 20 日至今任汇添富双享增利债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 5 日至今任汇添富稳鑫 90 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。                                                                      |
| 刘通 | 本基金的基金经理 | 2024 年 03 月 13 日 | — | 15 | 国籍：中国。学历：浙江大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 7 月至 2015 年 8 月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益分析师，2015 年 8 月至 2019 年 7 月任汇添富基金管理股份有限公司专户投资经理。2023 年 6 月 20 日至 2024 年 3 月 13 日任汇添富添鑫多元收益 9 个月持 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 有期混合型证券投资基金的基金经理助理。2020 年 3 月 23 日至今任汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 23 日至今任汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月 1 日至今任汇添富多策略纯债债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 10 日至今任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 13 日至今任汇添富添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解

聘日期。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

宋鹏 2026 年 07 月 30 日离任本基金基金经理。刘通 2026 年 07 月 30 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，债券市场在流动性持续宽裕的背景下，整体呈现"震荡偏强、信用占优"的运行格局。央行始终坚持"精准有效"的货币政策操作，通过公开市场操作与多种货币政策工具灵活调节流动性，资金利率波动率在上半年持续处于历史偏低水平，为债券市场偏强运行奠定了坚实基础。尽管宏观经济基本面表现良好，但信贷需求仍处于磨底阶段，尚未发生显著改善，优质票息资产供给持续受限，"资产荒"逻辑贯穿整个上半年，配置盘成为驱动市场的核心力量。具体来看，一季度，债券市场在流动性宽裕驱动下呈现震荡走强格局。资金面的平稳为债市偏强奠定了基础。结构上，短端明显强于长端，市场在资金利率偏低且稳定的状态下更倾向于追逐确定性较高的短端品种，而长端受制于经济预期及通胀预期的双重压制，整体呈现震荡态势。品种方面，信用债表现显著优于利率债，低波动环境下高票息优势得以充分体现。进入二季度，市场格局由一季度的单边偏强演变为"震荡分化、信用占优"。4 月上旬收益率经历一轮下行后，超长端利率开始转向震荡格局，而中短端在资金波动率维持低位的支撑下，收益率继续下行，期限利差有所走阔。信用债表现持续强于利率债，"资产荒"逻辑进一步深化——在信贷需求磨底、优质票息资产供给受限的背景下，理财规模持续增长、固收+产品申购回暖带来的配置盘需求保持旺盛，推动信用利差在低位基础上继续压缩。2026 年上半年，A 股市场在流动性充裕与产业趋势共振的驱动下，整体呈现"震荡上行、结构分化、科技占优"的格局。一季度市场在资金面平稳、风险偏好回暖下震荡走强；二季度指数转入高位震荡，但成长主线持续演绎。结构上，小盘成长显著强于大盘价值，科创、创业板及中小盘指数领涨，而大盘蓝筹相对滞涨。行业分化极致，科技成长一枝独秀：电子、通信在 AI 算力产业趋势催化下领涨全市场，而消费、金融等传统板块普遍回调，行

业首尾涨跌幅差距悬殊。整体来看，上半年科技硬件与算力产业链是贯穿全程的核心主线，市场呈现典型的结构性行情特征。组合操作上，在利率债上进行了交易，同时在化工和科技板块进行了交易。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 A 类份额净值增长率为 13.97%，同期业绩比较基准收益率为 1.12%。本报告期汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 C 类份额净值增长率为 13.79%，同期业绩比较基准收益率为 1.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年作为"十五五"规划的开局之年，我国经济在稳中求进、提质增效的总基调下延续修复态势。上半年经济运行总体平稳，一季度录得"开门红"后，二季度实际 GDP 同比增速回落至 4.3%，呈现"投资与出口偏强、消费平稳偏弱"的结构特征。展望下半年，外需与 AI 产业链仍将提供韧性，出口有望维持强劲；而消费能否修复、地产能否筑底企稳，仍是决定内需成色的关键变量，经济大概率呈现二季度探底后小幅修复的"浅 V"型走势。宏观政策将注重发挥存量政策与增量政策的集成效应，加强逆周期和跨周期调节，但更多以"抓落实、抢进度"为主，增量政策可期而非强刺激。财政政策仍是稳内需的主抓手，二季度支出节奏放缓后，下半年中央预算内投资、超长期特别国债、新型政策性金融工具及专项债资金有望加快形成实物工作量，重点投向"两重""六张网"、城市更新、地下管网、能源电网和算力网等领域。货币政策延续适度宽松基调，利率水平有望低位运行。在供给侧，将坚持把发展着力点放在实体经济上，加快培育新质生产力，谋划推进集成电路、生物医药、商业航天、低空经济等新兴支柱产业标志性工程，深入实施"人工智能+"行动，并纵深推进全国统一大市场建设、综合整治"内卷式"竞争，推动形成优质优价、良性竞争的市场秩序。具体到证券市场，债券市场方面，在经济弱修复、通胀上行压力可控、货币政策维持宽松的环境下，债市整体环境偏利好。但随着利差处于历史偏低水平，需灵活调整投资策略，根据负债稳定性进行适度波段操作；同时把握曲线和券种的结构化机会，优化组合结构，以应对市场波动。权益市场方面，结构化机会显著多于总量机会。行业配置上，建议围绕景气扩散的方向布局：一是 AI 产业链，仍是绝对高景气主线；二是先进制造，受益于外需韧性与 AI 景气外溢，关注储能、电池、船舶等优质出海制造及 AI 上游设备；三是上游周期，把握能源资源安全逻辑下的工业有色、稀有金属、化工及煤炭、电力；此外，在绝对收益资金入市背景下，红利资产尤其是受益于资本市场向好的非银板块仍具配置价值。



#### 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：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类基金份额、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；以红利再投资方式取得的基金份额的持有到期时间与投资者原持有的基金份额最短持有期到期时间一致，因多笔认购、申购导致原持有基金份额最短持有期到期时间不一致的，分别计算；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                         |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 2,151,723.57            | 4,657,482.09             |
| 结算备付金    |         | 2,242,143.64            | 2,424,104.51             |
| 存出保证金    |         | 23,762.92               | 46,865.70                |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 52,215,416.85           | 137,510,463.81           |
| 其中：股票投资  |         | 17,101,162.22           | 24,080,547.17            |
| 基金投资     |         | —                       | —                        |
| 债券投资     |         | 35,114,254.63           | 113,429,916.64           |
| 资产支持证券投资 |         | —                       | —                        |
| 贵金属投资    |         | —                       | —                        |
| 其他投资     |         | —                       | —                        |
| 衍生金融资产   | 6.4.7.3 | —                       | —                        |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | —                       | —                        |
| 债权投资     | 6.4.7.5 | —                       | —                        |
| 其中：债券投资  |         | —                       | —                        |
| 资产支持证券投资 |         | —                       | —                        |

|               |            |                                 |                                  |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 应收清算款         |            | 449,483.00                      | -                                |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | 3,078.59                        | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计          |            | 57,085,608.57                   | 144,638,916.11                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 06 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                 |                                  |
| 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         |            | 0.33                            | 2.95                             |
| 应付赎回款         |            | 232,353.34                      | 364,495.20                       |
| 应付管理人报酬       |            | 22,717.23                       | 88,504.98                        |
| 应付托管费         |            | 4,543.45                        | 17,700.98                        |
| 应付销售服务费       |            | 6,196.43                        | 38,267.56                        |
| 应付投资顾问费       |            | -                               | -                                |
| 应交税费          |            | 1,244.35                        | 2.36                             |
| 应付利润          |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                               | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.7    | 109,263.22                      | 231,619.82                       |
| 负债合计          |            | 376,318.35                      | 740,593.85                       |
| <b>净资产：</b>   |            |                                 |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.8    | 45,165,887.11                   | 130,762,571.63                   |
| 未分配利润         | 6.4.7.9    | 11,543,403.11                   | 13,135,750.63                    |
| 净资产合计         |            | 56,709,290.22                   | 143,898,322.26                   |
| 负债和净资产总计      |            | 57,085,608.57                   | 144,638,916.11                   |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 45,165,887.11 份。本基金下属汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 A 基金份额净值 1.2606 元，基金份额总额 28,329,208.54 份；本基金下属汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 C 基金份额净值 1.2472 元，基金份额总额 16,836,678.57 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----|-----|----|---------|
|-----|-----|----|---------|

|                                 |            | 2026 年 01 月 01 日<br>至 2026 年 06 月 30<br>日 | 2025 年 01 月 01 日<br>至 2025 年 06 月 30<br>日 |
|---------------------------------|------------|-------------------------------------------|-------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>                  |            | <b>9,075,210.64</b>                       | <b>-2,084,016.00</b>                      |
| 1.利息收入                          |            | 39,403.51                                 | 108,785.12                                |
| 其中：存款利息收入                       | 6.4.7.10   | 33,769.83                                 | 43,245.51                                 |
| 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                      |            | 5,633.68                                  | 65,539.61                                 |
| 其他利息收入                          |            | -                                         | -                                         |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）                |            | 6,262,054.94                              | -918,594.92                               |
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.11   | 6,626,959.09                              | -4,715,164.42                             |
| 基金投资收益                          | 6.4.7.12   | -79,786.33                                | 191,516.30                                |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.13   | -445,871.36                               | 3,491,357.58                              |
| 资产支持证券投资                        | 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   | 86,366.68                                 | -322,537.25                               |
| 股利收益                            | 6.4.7.17   | 74,386.86                                 | 436,232.87                                |
| 以摊余成本计量的金融<br>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“-”<br>号填列)       | 6.4.7.18   | 2,773,752.19                              | -1,274,206.20                             |
| 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   | -                                         | -                                         |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | <b>359,727.32</b>                         | <b>703,516.25</b>                         |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 171,505.69                                | 406,832.96                                |
| 其中：暂估管理人报酬                      |            | -                                         | -                                         |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 34,252.51                                 | 81,322.70                                 |
| 3. 销售服务费                        |            | 57,444.51                                 | 155,869.97                                |
| 4. 投资顾问费                        |            | -                                         | -                                         |
| 5. 利息支出                         |            | -                                         | 2,619.62                                  |
| 其中：卖出回购金融资产支出                   |            | -                                         | 2,619.62                                  |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.21   | -                                         | -                                         |
| 7. 税金及附加                        |            | 1,500.67                                  | 1,243.68                                  |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.22   | 95,023.94                                 | 55,627.32                                 |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”<br/>号填列）</b> |            | <b>8,715,483.32</b>                       | <b>-2,787,532.25</b>                      |
| 减：所得税费用                         |            | -                                         | -                                         |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号<br/>填列）</b>   |            | <b>8,715,483.32</b>                       | <b>-2,787,532.25</b>                      |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>            |            | <b>-</b>                                  | <b>-</b>                                  |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | <b>8,715,483.32</b>                       | <b>-2,787,532.25</b>                      |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>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                                | 130,762,571.63                                | 13,135,750.63  | 143,898,322.26  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                             | -              | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 130,762,571.63                                | 13,135,750.63  | 143,898,322.26  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -85,596,684.52                                | -1,592,347.52  | -87,189,032.04  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                             | 8,715,483.32   | 8,715,483.32    |
| （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）      | -85,596,684.52                                | -10,307,830.84 | -95,904,515.36  |
| 其中：1.基金申购款                               | 7,265,444.43                                  | 1,261,100.88   | 8,526,545.31    |
| 2.基金赎回款                                  | -92,862,128.95                                | -11,568,931.72 | -104,431,060.67 |
| （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                                | 45,165,887.11                                 | 11,543,403.11  | 56,709,290.22   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 48,660,472.13                                 | 2,708,787.76   | 51,369,259.89   |
| 加：会计政策变更                                 | -                                             | -              | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 48,660,472.13                                 | 2,708,787.76   | 51,369,259.89   |

|                                          |                |               |                |
|------------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 178,296,346.43 | 12,555,504.35 | 190,851,850.78 |
| （一）、综合收益总额                               | -              | -2,787,532.25 | -2,787,532.25  |
| （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）      | 178,296,346.43 | 15,343,036.60 | 193,639,383.03 |
| 其中：1.基金申购款                               | 193,577,079.90 | 16,476,609.14 | 210,053,689.04 |
| 2.基金赎回款                                  | -15,280,733.47 | -1,133,572.54 | -16,414,306.01 |
| （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                                | 226,956,818.56 | 15,264,292.11 | 242,221,110.67 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |           |            |
|-----------|-----------|------------|
| <u>张晖</u> | <u>李骁</u> | <u>雷青松</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人    |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2022〕2144 号文《关于准予汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 6 月 16 日生效。首次设立基金募集规模为 235,571,460.40 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 60466941\_B32 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金

管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

#### 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.境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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<br>2026 年 06 月 30 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 2,151,723.57            |
| 等于：本金          | 2,151,436.67            |
| 加：应计利息         | 286.90                  |
| 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     | 2,151,723.57 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 |            |               |              |
|---------------|-------|-------------------------|------------|---------------|--------------|
|               |       | 成本                      | 应计利息       | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 14,766,937.02           | -          | 17,101,162.22 | 2,334,225.20 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                       | -          | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 2,903,218.00            | 27,613.10  | 2,929,543.10  | -1,288.00    |
|               | 银行间市场 | 31,846,810.00           | 87,111.53  | 32,184,711.53 | 250,790.00   |
|               | 其他    | -                       | -          | -             | -            |
|               | 合计    | 34,750,028.00           | 114,724.63 | 35,114,254.63 | 249,502.00   |
| 资产支持证券        |       | -                       | -          | -             | -            |
| 基金            |       | -                       | -          | -             | -            |
| 其他            |       | -                       | -          | -             | -            |
| 合计            |       | 49,516,965.02           | 114,724.63 | 52,215,416.85 | 2,583,727.20 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>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         | 35,496.45               |
| 其中：交易所市场       | 31,281.45               |
| 银行间市场          | 4,215.00                |
| 应付利息           | —                       |
| 应付审计费          | 4,959.40                |
| 应付信息披露费        | 59,507.37               |
| 应付指数使用费        | —                       |
| 应付账户维护费        | 9,300.00                |
| 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             | 109,263.22              |

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 A |                                       |                |
|----------------------|---------------------------------------|----------------|
| 项目                   | 本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |                |
|                      | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末                 | 57,398,616.47                         | 57,398,616.47  |
| 本期申购                 | 6,698,241.76                          | 6,698,241.76   |
| 本期赎回（以“-”号填列）        | -35,767,649.69                        | -35,767,649.69 |

|                       |                                       |                |
|-----------------------|---------------------------------------|----------------|
| 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                   | 28,329,208.54                         | 28,329,208.54  |
| 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 C |                                       |                |
| 项目                    | 本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |                |
|                       | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末                  | 73,363,955.16                         | 73,363,955.16  |
| 本期申购                  | 567,202.67                            | 567,202.67     |
| 本期赎回（以“-”号填列）         | -57,094,479.26                        | -57,094,479.26 |
| 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                   | 16,836,678.57                         | 16,836,678.57  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

|                       |               |               |               |
|-----------------------|---------------|---------------|---------------|
| 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 A |               |               |               |
| 项目                    | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末                  | 7,021,117.44  | -933,414.74   | 6,087,702.70  |
| 加：会计政策变更              | -             | -             | -             |
| 本期期初                  | 7,021,117.44  | -933,414.74   | 6,087,702.70  |
| 本期利润                  | 3,352,096.32  | 1,380,261.66  | 4,732,357.98  |
| 本期基金份额交易产生的变动数        | -3,434,600.29 | -3,442.20     | -3,438,042.49 |
| 其中：基金申购款              | 1,188,429.98  | -13,354.71    | 1,175,075.27  |
| 基金赎回款                 | -4,623,030.27 | 9,912.51      | -4,613,117.76 |
| 本期已分配利润               | -             | -             | -             |
| 本期末                   | 6,938,613.47  | 443,404.72    | 7,382,018.19  |
| 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 C |               |               |               |
| 项目                    | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末                  | 8,245,825.22  | -1,197,777.29 | 7,048,047.93  |
| 加：会计政策变更              | -             | -             | -             |
| 本期期初                  | 8,245,825.22  | -1,197,777.29 | 7,048,047.93  |
| 本期利润                  | 2,589,634.81  | 1,393,490.53  | 3,983,125.34  |
| 本期基金份额交易产生的变动数        | -6,932,936.72 | 63,148.37     | -6,869,788.35 |
| 其中：基金申购款              | 85,364.97     | 660.64        | 86,025.61     |

|         |               |            |               |
|---------|---------------|------------|---------------|
| 基金赎回款   | -7,018,301.69 | 62,487.73  | -6,955,813.96 |
| 本期已分配利润 | -             | -          | -             |
| 本期末     | 3,902,523.31  | 258,861.61 | 4,161,384.92  |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 19,995.67                                |
| 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 | 13,561.39                                |
| 其他        | 212.77                                   |
| 合计        | 33,769.83                                |

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------|------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 78,451,577.93                            |
| 减：卖出股票成本总额 | 71,699,161.47                            |
| 减：交易费用     | 125,457.37                               |
| 买卖股票差价收入   | 6,626,959.09                             |

6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|-----------------------|------------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额           | 5,896,943.10                             |
| 减：卖出/赎回基金成本总额         | 5,974,235.60                             |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值<br>税额 | 2,019.00                                 |
| 减：交易费用                | 474.83                                   |
| 基金投资收益                | -79,786.33                               |

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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---------------------------------|------------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                    | 324,014.97                               |
| 债券投资收益——买卖债券( 债转股及债券到期兑付 ) 差价收入 | -769,886.33                              |
| 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                              | -445,871.36                              |

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<br>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   | 241,308,288.98                           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 239,929,672.99                           |
| 减：应计利息总额               | 2,140,582.32                             |
| 减：交易费用                 | 7,920.00                                 |
| 买卖债券差价收入               | -769,886.33                              |

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 |
|----------|---------------------------------------|
| 外汇期货投资收益 | -                                     |

|          |            |
|----------|------------|
| 外汇远期投资收益 | -          |
| 国债期货投资收益 | -10,108.43 |
| 股指期货投资收益 | 96,475.11  |

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 74,386.86                                |
| 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            | 74,386.86                                |

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|----------------------------|------------------------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | 2,773,752.19                             |
| ——股票投资                     | 1,577,446.64                             |
| ——债券投资                     | 1,196,305.55                             |
| ——资产支持证券投资                 | -                                        |
| ——基金投资                     | -                                        |
| ——贵金属投资                    | -                                        |
| ——其他                       | -                                        |
| 2.衍生工具                     | -                                        |
| ——权证投资                     | -                                        |
| ——期货投资                     | -                                        |
| 3.其他                       | -                                        |
| 减：应税金融商品公允价值变动<br>产生的预估增值税 | -                                        |
| 合计                         | 2,773,752.19                             |

6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.20 持有基金产生的费用

金额单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|----------------------|------------------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | -                                        |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 1,035.16                                 |

|                    |        |
|--------------------|--------|
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 207.09 |
|--------------------|--------|

6.4.7.21 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|-------------|------------------------------------------|
| 审计费用        | 4,959.40                                 |
| 信息披露费       | 59,507.37                                |
| 证券出借违约金     | —                                        |
| 账户维护费       | 27,900.00                                |
| 银行费用        | 2,549.74                                 |
| 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          | 107.43                                   |
| 合计          | 95,023.94                                |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

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



6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                 | 与本基金的关系               |
|-----------------------|-----------------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司         | 基金管理人,基金销售机构,基金注册登记机构 |
| 中国工商银行股份有限公司 ("工商银行") | 基金托管人,基金销售机构          |
| 东方证券股份有限公司 ("东方证券")   | 基金管理人的股东              |

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  | 138,270.00                            | 0.10             | 1,586,112.94                               | 0.73             |

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
|-------|---------------------------------------|

|       | 当期佣金                                       | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
|-------|--------------------------------------------|---------------|----------|-----------------|
| 东方证券  | 60.28                                      | 0.10          | 60.28    | 0.19            |
| 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  | 753.94                                     | 0.76          | 354.16   | 0.85            |

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<br>2026 年 01 月 01 日至<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至<br>2025 年 06 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 171,505.69                                  | 406,832.96                                       |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 76,761.93                                   | 198,542.31                                       |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 94,743.76                                   | 208,290.65                                       |

注：本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金所对应的基金资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金所对应的基金资产净值后余额，若为负数，则取 0

基金管理费每日计提，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首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                                 | 上年度可比期间                            |
|----------------|------------------------------------|------------------------------------|
|                | 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | 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 | 34,252.51                          | 81,322.70                          |

注：本基金对基金财产中持有的本基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人自身托管的其他基金所对应的基金资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有本基金托管人自身托管的其他基金所对应的基金资产净值后余额，若为负数，则取 0

基金托管费每日计提，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首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日      |                      |           |
|----------------|--------------------------------------------|----------------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                      |           |
|                | 汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 A                       | 汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 C | 合计        |
|                | 中国工商银行股份有限公司                               | 56,492.75            | 56,492.75 |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | 260.42                                     |                      | 260.42    |
| 合计             | 56,753.17                                  |                      | 56,753.17 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |                      |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |                      |           |
|                | 汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 A                       | 汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 C | 合计        |

|               | 益 9 个月持有混合 A | 益 9 个月持有混合 C |            |
|---------------|--------------|--------------|------------|
| 中国工商银行股份有限公司  | —            | 155,492.49   | 155,492.49 |
| 汇添富基金管理股份有限公司 | —            | 95.58        | 95.58      |
| 合计            | —            | 155,588.07   | 155,588.07 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.35% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限

费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |           | 上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |           |
|-------|---------------------------------------|-----------|--------------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                                  | 当期利息收入    | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 工商银行  | 2,151,723.57                          | 19,995.67 | 2,149,177.88                               | 32,390.20 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026<br>年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025<br>年 06 月 30 日 |
|--------------------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购<br>费（元）      | -                                           | -                                                |
| 当期交易基金产生的赎回<br>费（元）      | -                                           | -                                                |
| 当期持有基金产生的应支<br>付销售服务费（元） | -                                           | -                                                |
| 当期持有基金产生的应支<br>付管理费（元）   | -                                           | -                                                |
| 当期持有基金产生的应支              | -                                           | -                                                |

|                 |   |   |
|-----------------|---|---|
| 付托管费（元）         |   |   |
| 当期交易基金产生的交易费（元） | - | - |
| 当期交易基金产生的转换费（元） | - | - |

注:上述费用为本基金持有管理人及管理人关联方所管理的基金产生的费用，申购费、赎回费是实际产生的费用，销售服务费、管理费和托管费等其他费用为估算费用；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。

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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注: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

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于每份基金份额的最短持有期限之后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<br>2026 年<br>06 月 30<br>日 | 1 个月以<br>内   | 1-3 个月 | 3 个月-1<br>年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计           |
|-------------------------------|--------------|--------|-------------|-------|-------|-----|--------------|
| 资产                            |              |        |             |       |       |     |              |
| 货币资金                          | 2,151,723.57 | -      | -           | -     | -     | -   | 2,151,723.57 |
| 结算备付金                         | 2,242,143.64 | -      | -           | -     | -     | -   | 2,242,143.64 |



|           |              |   |              |   |               |               |               |
|-----------|--------------|---|--------------|---|---------------|---------------|---------------|
| 存出保证金     | 23,762.92    | - | -            | - | -             | -             | 23,762.92     |
| 交易性金融资产   | -            | - | 2,929,543.10 | - | 32,184,711.53 | 17,101,162.22 | 52,215,416.85 |
| 衍生金融资产    | -            | - | -            | - | -             | -             | -             |
| 买入返售金融资产  | -            | - | -            | - | -             | -             | -             |
| 债权投资      | -            | - | -            | - | -             | -             | -             |
| 应收清算款     | -            | - | -            | - | -             | 449,483.00    | 449,483.00    |
| 应收股利      | -            | - | -            | - | -             | -             | -             |
| 应收申购款     | -            | - | -            | - | -             | 3,078.59      | 3,078.59      |
| 递延所得税资产   | -            | - | -            | - | -             | -             | -             |
| 其他资产      | -            | - | -            | - | -             | -             | -             |
| 资产总计      | 4,417,630.13 | - | 2,929,543.10 | - | 32,184,711.53 | 17,553,723.81 | 57,085,608.57 |
| 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     | -            | - | -            | - | -             | 0.33          | 0.33          |
| 应付赎回款     | -            | - | -            | - | -             | 232,353.34    | 232,353.34    |
| 应付管理人报酬   | -            | - | -            | - | -             | 22,717.23     | 22,717.23     |
| 应付托管费     | -            | - | -            | - | -             | 4,543.45      | 4,543.45      |
| 应付销售服务费   | -            | - | -            | - | -             | 6,196.43      | 6,196.43      |
| 应付投资顾问费   | -            | - | -            | - | -             | -             | -             |
| 应交税费      | -            | - | -            | - | -             | 1,244.35      | 1,244.35      |
| 应付利润      | -            | - | -            | - | -             | -             | -             |
| 递延所得      | -            | - | -            | - | -             | -             | -             |

|                                |               |        |              |               |               |               |                |
|--------------------------------|---------------|--------|--------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 税负债                            |               |        |              |               |               |               |                |
| 其他负债                           | -             | -      | -            | -             | -             | 109,263.22    | 109,263.22     |
| 负债总计                           | -             | -      | -            | -             | -             | 376,318.35    | 376,318.35     |
| 利率敏感度缺口                        | 4,417,630.13  | -      | 2,929,543.10 | -             | 32,184,711.53 | 17,177,405.46 | 56,709,290.22  |
| 上年度末<br>2025 年<br>12 月 31<br>日 | 1 个月以<br>内    | 1-3 个月 | 3 个月-1<br>年  | 1-5 年         | 5 年以上         | 不计息           | 合计             |
| 资产                             |               |        |              |               |               |               |                |
| 货币资金                           | 4,657,482.09  | -      | -            | -             | -             | -             | 4,657,482.09   |
| 结算备付金                          | 2,424,104.51  | -      | -            | -             | -             | -             | 2,424,104.51   |
| 存出保证金                          | 46,865.70     | -      | -            | -             | -             | -             | 46,865.70      |
| 交易性金融资产                        | 10,617,128.22 | -      | -            | 50,459,367.12 | 52,353,421.30 | 24,080,547.17 | 137,510,463.81 |
| 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                           | 17,745,580.52 | -      | -            | 50,459,367.12 | 52,353,421.30 | 24,080,547.17 | 144,638,916.11 |
| 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   | -             | - | - | -             | -             | 2.95          | 2.95           |
| 应付赎回款   | -             | - | - | -             | -             | 364,495.20    | 364,495.20     |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | -             | -             | 88,504.98     | 88,504.98      |
| 应付托管费   | -             | - | - | -             | -             | 17,700.98     | 17,700.98      |
| 应付销售服务费 | -             | - | - | -             | -             | 38,267.56     | 38,267.56      |
| 应付投资顾问费 | -             | - | - | -             | -             | -             | -              |
| 应交税费    | -             | - | - | -             | -             | 2.36          | 2.36           |
| 应付利润    | -             | - | - | -             | -             | -             | -              |
| 递延所得税负债 | -             | - | - | -             | -             | -             | -              |
| 其他负债    | -             | - | - | -             | -             | 231,619.82    | 231,619.82     |
| 负债总计    | -             | - | - | -             | -             | 740,593.85    | 740,593.85     |
| 利率敏感度缺口 | 17,745,580.52 | - | - | 50,459,367.12 | 52,353,421.30 | 23,339,953.32 | 143,898,322.26 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

|  |                   | 本期末 2026 年 06 月<br>30 日 | 上年度末 2025 年 12<br>月 31 日 |
|--|-------------------|-------------------------|--------------------------|
|  | 基准利率减少 25 个<br>基点 | 1,785,490.95            | 2,458,506.78             |
|  | 基准利率增加 25 个<br>基点 | -1,638,834.89           | -2,340,469.87            |

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目        | 本期末 2026 年 06 月 30 日 |              |           |              |
|-----------|----------------------|--------------|-----------|--------------|
|           | 美元折合人民币              | 港币折合人民币      | 其他币种折合人民币 | 合计           |
| 以外币计价的资产  |                      |              |           |              |
| 货币资金      | -                    | -            | -         | -            |
| 结算备付金     | -                    | -            | -         | -            |
| 存出保证金     | -                    | -            | -         | -            |
| 交易性金融资产   | -                    | 1,474,472.19 | -         | 1,474,472.19 |
| 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      | -                    | -            | -         | -            |
| 资产合计      | -                    | 1,474,472.19 | -         | 1,474,472.19 |
| 以外币计价的负债  |                      |              |           |              |
| 短期借款      | -                    | -            | -         | -            |
| 交易性金融负债   | -                    | -            | -         | -            |
| 衍生金融负债    | -                    | -            | -         | -            |
| 卖出回购金融资产款 | -                    | -            | -         | -            |

|                   |                       |              |           |              |
|-------------------|-----------------------|--------------|-----------|--------------|
| 应付清算款             | -                     | -            | -         | -            |
| 应付赎回款             | -                     | -            | -         | -            |
| 应付管理人报酬           | -                     | -            | -         | -            |
| 应付托管费             | -                     | -            | -         | -            |
| 应付销售服务费           | -                     | -            | -         | -            |
| 应付投资顾问费           | -                     | -            | -         | -            |
| 应交税费              | -                     | -            | -         | -            |
| 应付利润              | -                     | -            | -         | -            |
| 递延所得税负债           | -                     | -            | -         | -            |
| 其他负债              | -                     | -            | -         | -            |
| 负债合计              | -                     | -            | -         | -            |
| 资产负债表外汇<br>风险敞口净额 | -                     | 1,474,472.19 | -         | 1,474,472.19 |
| 项目                | 上年度末 2025 年 12 月 31 日 |              |           |              |
|                   | 美元折合人民币               | 港币折合人民币      | 其他币种折合人民币 | 合计           |
| 以外币计价的资产          |                       |              |           |              |
| 货币资金              | -                     | -            | -         | -            |
| 结算备付金             | -                     | -            | -         | -            |
| 存出保证金             | -                     | -            | -         | -            |
| 交易性金融资产           | -                     | 5,985,523.32 | -         | 5,985,523.32 |
| 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              | -                     | -            | -         | -            |
| 资产合计              | -                     | 5,985,523.32 | -         | 5,985,523.32 |
| 以外币计价的负债          |                       |              |           |              |
| 短期借款              | -                     | -            | -         | -            |
| 交易性金融负债           | -                     | -            | -         | -            |
| 衍生金融负债            | -                     | -            | -         | -            |
| 卖出回购金融资产款         | -                     | -            | -         | -            |
| 应付清算款             | -                     | -            | -         | -            |
| 应付赎回款             | -                     | -            | -         | -            |
| 应付管理人报酬           | -                     | -            | -         | -            |
| 应付托管费             | -                     | -            | -         | -            |

|                   |   |              |   |              |
|-------------------|---|--------------|---|--------------|
| 应付销售服务费           | - | -            | - | -            |
| 应付投资顾问费           | - | -            | - | -            |
| 应交税费              | - | -            | - | -            |
| 应付利润              | - | -            | - | -            |
| 递延所得税负债           | - | -            | - | -            |
| 其他负债              | - | -            | - | -            |
| 负债合计              | - | -            | - | -            |
| 资产负债表外汇<br>风险敞口净额 | - | 5,985,523.32 | - | 5,985,523.32 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 1.除汇率以外的其他市场变量保持不变,且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。 |                                 |                          |
|----|--------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 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<br>(单位:人民币元) |                          |
|    |                                                  | 本期末 2026 年 06 月<br>30 日         | 上年度末 2025 年 12<br>月 31 日 |
|    | 港币相对人民币升值<br>5%                                  | 73,723.61                       | 299,276.17               |
|    | 港币相对人民币贬值<br>5%                                  | -73,723.61                      | -299,276.17              |

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<br>值比例 (%) | 公允价值                  | 占基金资产净<br>值比例 (%) |
| 交易性金融资产－股票投资  | 17,101,162.22        | 30.16             | 24,080,547.17         | 16.73             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                    | -                 | -                     | -                 |
| 交易性金融资产－债券投资  | 35,114,254.63        | 61.92             | 113,429,916.64        | 78.83             |
| 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          | 52,215,416.85 | 92.08 | 137,510,463.81 | 95.56 |

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;<br>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<br>(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 |
|    | 沪深 300 指数上涨 5%                                                                                                                  | 1,019,643.78                    | 2,266,303.30          |
|    | 沪深 300 指数下跌 5%                                                                                                                  | -1,019,643.78                   | -2,266,303.30         |

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<br>2026 年 06 月 30 日 |
| 第一层次          | 17,101,162.22           |

|      |               |
|------|---------------|
| 第二层次 | 35,114,254.63 |
| 第三层次 | —             |
| 合计   | 52,215,416.85 |

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业务等情况，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   | 17,101,162.22 | 29.96        |
|    | 其中：股票  | 17,101,162.22 | 29.96        |
| 2  | 基金投资   | —             | —            |
| 3  | 固定收益投资 | 35,114,254.63 | 61.51        |
|    | 其中：债券  | 35,114,254.63 | 61.51        |
|    | 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      | 4,393,867.21  | 7.70   |
| 8 | 其他各项资产            | 476,324.51    | 0.83   |
| 9 | 合计                | 57,085,608.57 | 100.00 |

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 1,474,472.19 元,占期末净值比例为 2.6%。

## 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              | 14,988,470.03 | 26.43        |
| 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  | 638,220.00    | 1.13         |
| 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               | 15,626,690.03 | 27.56        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别   | 公允价值（人民币）  | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|------------|--------------|
| 10 能源  | —          | —            |
| 15 原材料 | 828,596.70 | 1.46         |
| 20 工业  | —          | —            |

|         |              |      |
|---------|--------------|------|
| 25 可选消费 | -            | -    |
| 30 日常消费 | -            | -    |
| 35 医疗保健 | -            | -    |
| 40 金融   | -            | -    |
| 45 信息技术 | 645,875.49   | 1.14 |
| 50 电信服务 | -            | -    |
| 55 公用事业 | -            | -    |
| 60 房地产  | -            | -    |
| 合计      | 1,474,472.19 | 2.60 |

注: (1) 以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

(2) 由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

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<br>(元)  | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|--------|--------------|----------------------|
| 1  | 300037 | 新宙邦   | 34,100 | 3,166,185.00 | 5.58                 |
| 2  | 002001 | 新 和 成 | 68,900 | 1,958,138.00 | 3.45                 |
| 3  | 600114 | 东睦股份  | 29,700 | 1,121,472.00 | 1.98                 |
| 4  | 002409 | 雅克科技  | 4,200  | 942,900.00   | 1.66                 |
| 5  | 688409 | 富创精密  | 2,889  | 884,756.25   | 1.56                 |
| 6  | 300285 | 国瓷材料  | 8,500  | 877,030.00   | 1.55                 |
| 7  | 00189  | 东岳集团  | 50,000 | 828,596.70   | 1.46                 |
| 8  | 000510 | 新金路   | 32,900 | 817,236.00   | 1.44                 |
| 9  | 300835 | 龙磁科技  | 3,000  | 688,470.00   | 1.21                 |
| 10 | 688170 | 德龙激光  | 6,994  | 671,493.94   | 1.18                 |
| 11 | 01888  | 建滔积层板 | 7,500  | 645,875.49   | 1.14                 |
| 12 | 688256 | 寒武纪科技 | 400    | 638,220.00   | 1.13                 |
| 13 | 300014 | 亿纬锂能  | 9,300  | 604,779.00   | 1.07                 |
| 14 | 300750 | 宁德时代  | 1,500  | 589,515.00   | 1.04                 |
| 15 | 600183 | 生益科技  | 3,300  | 572,220.00   | 1.01                 |
| 16 | 002938 | 鹏鼎控股  | 5,000  | 526,900.00   | 0.93                 |
| 17 | 601138 | 工业富联  | 7,000  | 505,050.00   | 0.89                 |
| 18 | 300136 | 信维通信  | 3,000  | 357,750.00   | 0.63                 |
| 19 | 002436 | 兴森科技  | 6,600  | 336,270.00   | 0.59                 |
| 20 | 605589 | 圣泉集团  | 2,400  | 152,568.00   | 0.27                 |
| 21 | 688187 | 时代电气  | 1,674  | 114,936.84   | 0.20                 |
| 22 | 300806 | 斯迪克   | 900    | 100,800.00   | 0.18                 |

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  | 300037 | 新宙邦      | 2,742,971.00 | 1.91           |
| 2  | 002001 | 新 和 成    | 2,601,733.56 | 1.81           |
| 3  | 600409 | 三友化工     | 2,462,622.00 | 1.71           |
| 4  | 601168 | 西部矿业     | 2,361,388.00 | 1.64           |
| 5  | 688256 | 寒武纪科技    | 2,299,150.00 | 1.60           |
| 6  | 09988  | 阿里巴巴 - W | 2,275,431.97 | 1.58           |
| 7  | 300835 | 龙磁科技     | 1,711,575.00 | 1.19           |
| 8  | 600114 | 东睦股份     | 1,556,064.00 | 1.08           |
| 9  | 600547 | 山东黄金     | 1,534,771.00 | 1.07           |
| 10 | 002008 | 大族激光     | 1,421,748.00 | 0.99           |
| 11 | 002938 | 鹏鼎控股     | 1,301,027.03 | 0.90           |
| 12 | 601899 | 紫金矿业     | 1,286,461.00 | 0.89           |
| 13 | 688008 | 澜起科技     | 1,263,101.67 | 0.88           |
| 14 | 002782 | 可立克      | 1,157,883.00 | 0.80           |
| 15 | 002223 | 鱼跃医疗     | 1,039,989.00 | 0.72           |
| 16 | 605376 | 博迁新材     | 862,631.00   | 0.60           |
| 17 | 300394 | 天孚通信     | 851,654.00   | 0.59           |
| 18 | 601021 | 春秋航空     | 825,519.00   | 0.57           |
| 19 | 00189  | 东岳集团     | 819,936.98   | 0.57           |
| 20 | 002409 | 雅克科技     | 817,620.00   | 0.57           |

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  | 09988  | 阿里巴巴 - W | 4,017,739.89 | 2.79           |
| 2  | 601168 | 西部矿业     | 2,420,543.00 | 1.68           |
| 3  | 300308 | 中际旭创     | 2,346,127.00 | 1.63           |
| 4  | 002008 | 大族激光     | 2,316,852.00 | 1.61           |
| 5  | 600409 | 三友化工     | 2,084,154.00 | 1.45           |
| 6  | 601126 | 四方股份     | 2,041,067.79 | 1.42           |
| 7  | 300835 | 龙磁科技     | 1,752,775.00 | 1.22           |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 8  | 600547 | 山东黄金   | 1,662,532.92 | 1.16 |
| 9  | 688256 | 寒武纪科技  | 1,651,556.00 | 1.15 |
| 10 | 300274 | 阳光电源   | 1,536,212.00 | 1.07 |
| 11 | 605376 | 博迁新材   | 1,471,299.00 | 1.02 |
| 12 | 01209  | 华润万象生活 | 1,410,296.65 | 0.98 |
| 13 | 002001 | 新 和 成  | 1,373,823.00 | 0.95 |
| 14 | 300037 | 新宙邦    | 1,329,294.00 | 0.92 |
| 15 | 601899 | 紫金矿业   | 1,314,047.00 | 0.91 |
| 16 | 002922 | 伊戈尔    | 1,291,909.00 | 0.90 |
| 17 | 688008 | 澜起科技   | 1,291,135.34 | 0.90 |
| 18 | 600489 | 中金黄金   | 1,281,733.00 | 0.89 |
| 19 | 01208  | 五矿资源   | 1,219,167.91 | 0.85 |
| 20 | 002782 | 可立克    | 1,162,312.00 | 0.81 |

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 | 63,142,329.88 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 78,451,577.93 |

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      | 25,209,377.92 | 44.45        |
| 2  | 央行票据      | —             | —            |
| 3  | 金融债券      | 9,904,876.71  | 17.47        |
|    | 其中：政策性金融债 | 9,904,876.71  | 17.47        |
| 4  | 企业债券      | —             | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —             | —            |
| 6  | 中期票据      | —             | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | —             | —            |
| 8  | 同业存单      | —             | —            |
| 9  | 地方政府债     | —             | —            |
| 10 | 其他        | —             | —            |
| 11 | 合计        | 35,114,254.63 | 61.92        |

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<br>净值比例<br>(%) |
|----|---------|------------------|---------|---------------|----------------------|
| 1  | 2600003 | 26 超长特别<br>国债 03 | 170,000 | 17,604,627.17 | 31.04                |
| 2  | 250215  | 25 国开 15         | 100,000 | 9,904,876.71  | 17.47                |
| 3  | 2500002 | 25 超长特别<br>国债 02 | 50,000  | 4,675,207.65  | 8.24                 |
| 4  | 019792  | 25 国债 19         | 28,000  | 2,829,378.52  | 4.99                 |
| 5  | 019835  | 26 国债 09         | 1,000   | 100,164.58    | 0.18                 |

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与股指期货交易，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期国债期货投资在一定程度上对冲了利率波动的风险，符合既定的投资政策和投资目标。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策与风险说明

#### 一、投资政策

(1) 对于非上市证券投资基金，本基金仅投资于同一基金管理人旗下的股票型基金、偏股混合型基金。其中偏股混合型基金包含以下两类：第一类是在基金合同中约定投资于股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例在 60% 以上的混合型证券投资基金；第二类是过去最近 4 个季度定期报告中披露的股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例均在 60% 以上的混合型证券投资基金。基金管理人基于对市场中长期投资趋势的判断，采用定量和定性分析相结合的方法（根据历史业绩、风险调整后的收益、基金规模和流动性、基金评级等一系列量化指标对基金进行分析；运用基金分析评价体系，对基金进行表现分析、归因分析、稳定性分析、个股分析和风险分析），聚焦基金管理人旗下中长期业绩持续稳定、风格清晰，且具备竞争优势的证券投资基金，精选基金构建投资组合，进行中长期持有。

(2) 对于上市证券投资基金，本基金仅投资于境内股票型 ETF 基金。本基金将重点分析基金的长期表现和跟踪效率、基金所跟踪指数和市场的代表性、基金的流动性以及基金的费率。基于上述分析，本基金将在全市场范围中精选出代表性强、跟踪效果好、流动性高、费率低的境内股票型 ETF 基金。

#### 二、风险说明

本基金可以投资于其他公开募集证券投资基金的基金份额,因此本基金所持有的基金的业绩表现、持有基金的基金管理人水平等因素将影响到本基金的基金业绩表现。

本基金除了承担投资其他基金的管理费、托管费和销售费用(其中申购本基金基金管理人自身管理的其他基金不收取申购费、赎回费(不包括按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取,并计入基金财产的赎回费用)、销售服务费等)外,还须承担本基金本身的管理费、托管费和销售费用(其中不收取基金财产中持有本基金管理人管理的其他基金部分的管理费、本基金托管人托管的其他基金部分的托管费),因此,本基金最终获取的回报与直接投资于其他基金获取的回报存在差异。

本基金主动管理风险指的是基金经理对基金的主动性操作导致的风险。本基金为主动管理型的偏债混合型基金,在精选基金的操作过程中,基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断,其精选出的基金的业绩表现并不一定持续的优于其他基金。

本基金投资流通受限基金时,对于封闭式基金而言,当要卖出基金的时候,可能会面临在一定的价格下无法卖出而要降价卖出的风险;对于流通受限基金而言,由于流通受限基金的非流通特性,在本基金参与投资后将在一定的期限内无法流通。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

注: 本基金本报告期末未持有基金投资。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,国家开发银行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。

7.13.2

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。

7.13.3 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 | 23,762.92 |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 2 | 应收清算款 | 449,483.00 |
| 3 | 应收股利  | —          |
| 4 | 应收利息  | —          |
| 5 | 应收申购款 | 3,078.59   |
| 6 | 其他应收款 | —          |
| 7 | 待摊费用  | —          |
| 8 | 其他    | —          |
| 9 | 合计    | 476,324.51 |

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别                 | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额  | 持有人结构 |           |               |           |
|----------------------|----------|------------|-------|-----------|---------------|-----------|
|                      |          |            | 机构投资者 |           | 个人投资者         |           |
|                      |          |            | 持有份额  | 占总份额比例（%） | 持有份额          | 占总份额比例（%） |
| 汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 A | 291      | 97,351.23  | 0.00  | 0.00      | 28,329,208.54 | 100.00    |
| 汇添富添鑫多元收益 9 个月持有混合 C | 119      | 141,484.69 | 0.00  | 0.00      | 16,836,678.57 | 100.00    |
| 合计                   | 410      | 110,160.70 | 0.00  | 0.00      | 45,165,887.11 | 100.00    |

8.2 盈利投资者数量占比



|           |                                         |
|-----------|-----------------------------------------|
| 项目        | 过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日） |
| 盈利投资者数量占比 | 99.89%                                  |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别                  | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|-----------------------|------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 A | 703,584.51 | 2.48        |
|                  | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 C | 0.00       | 0.00        |
|                  | 合计                    | 703,584.51 | 1.56        |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别                  | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-----------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 A | 0                 |
|                                | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 C | 0                 |
|                                | 合计                    | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 A | 50~100            |
|                                | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 C | 0                 |
|                                | 合计                    | 50~100            |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 A | 汇添富添添鑫多元收益 9 个月持有混合 C |
|---------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 基金合同生效日（2023 年 06 月 16 日）基金份额总额 | 223,417,994.67        | 12,153,465.73         |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 57,398,616.47         | 73,363,955.16         |
| 本报告期基金总申购份额                     | 6,698,241.76          | 567,202.67            |
| 减：本报告期基金总赎回份                    | 35,767,649.69         | 57,094,479.26         |

|              |               |               |
|--------------|---------------|---------------|
| 额            |               |               |
| 本报告期基金拆分变动份额 | -             | -             |
| 本报告期期末基金份额总额 | 28,329,208.54 | 16,836,678.57 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

注：本基金本报告期持有的基金无重大影响事件。

10.6 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）。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.8 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

10.8.1 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 (%) |    |
| 国海证券   | 2      | 82,212,266.78 | 58.06            | 36,591.60 | 58.19          |    |
| 瑞银证券   | 2      | 26,733,854.68 | 18.88            | 11,938.86 | 18.98          |    |
| 国联民生   | 2      | 7,593,613.48  | 5.36             | 3,325.43  | 5.29           |    |
| 国信证券   | 2      | 7,478,299.34  | 5.28             | 3,300.97  | 5.25           |    |
| 财通证券   | 2      | 4,264,457.24  | 3.01             | 1,879.14  | 2.99           |    |
| 华泰证券   | 2      | 3,562,971.87  | 2.52             | 1,553.09  | 2.47           |    |
| 摩根大通证券 | 2      | 2,441,575.86  | 1.72             | 1,138.95  | 1.81           |    |
| 平安证券   | 3      | 1,857,894.45  | 1.31             | 822.71    | 1.31           |    |
| 广发证券   | 1      | 1,767,963.36  | 1.25             | 770.63    | 1.23           |    |
| 中信证券   | 4      | 1,767,939.00  | 1.25             | 770.66    | 1.23           |    |
| 兴业证券   | 3      | 1,392,922.72  | 0.98             | 607.14    | 0.97           |    |
| 中金公司   | 2      | 381,879.03    | 0.27             | 128.27    | 0.20           |    |
| 东方证券   | 6      | 138,270.00    | 0.10             | 60.28     | 0.10           |    |
| 长城证券   | 2      | —             | —                | —         | —              |    |
| 长江证券   | 1      | —             | —                | —         | —              |    |

|            |   |   |   |   |   |  |
|------------|---|---|---|---|---|--|
| 东北证券       | 2 | — | — | — | — |  |
| 东吴证券       | 1 | — | — | — | — |  |
| 东兴证券       | 1 | — | — | — | — |  |
| 国泰海通       | 6 | — | — | — | — |  |
| 恒泰证券       | 2 | — | — | — | — |  |
| 华安证券       | 1 | — | — | — | — |  |
| 申万宏源<br>证券 | 3 | — | — | — | — |  |
| 信达证券       | 1 | — | — | — | — |  |
| 银河证券       | 1 | — | — | — | — |  |
| 中金财富       | 2 | — | — | — | — |  |
| 中泰证券       | 1 | — | — | — | — |  |
| 中信建投<br>证券 | 1 | — | — | — | — |  |

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。

10.8.2 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 (%) |
| 国海证券   | 15,728,348.00 | 93.46            | 34,000,000.00 | 62.96              | —    | —                | 3,136,339.90 | 26.42            |
| 瑞银证券   | 600,594.00    | 3.57             | 13,000,000.00 | 24.07              | —    | —                | 8,393,265.00 | 70.70            |
| 国联民生   | —             | —                | —             | —                  | —    | —                | —            | —                |
| 国信证券   | 500,695.00    | 2.98             | —             | —                  | —    | —                | 341,573.80   | 2.88             |
| 财通证券   | —             | —                | —             | —                  | —    | —                | —            | —                |
| 华泰证券   | —             | —                | 7,000,000.00  | 12.96              | —    | —                | —            | —                |
| 摩根大通证券 | —             | —                | —             | —                  | —    | —                | —            | —                |

|            |   |   |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 平安证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公<br>司   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长城证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东北证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰海<br>通   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华安证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏<br>源证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 信达证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金财<br>富   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证<br>券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建<br>投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

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。

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                            | 法定披露方式                         | 法定披露日期           |
|----|-------------------------------------------------|--------------------------------|------------------|
| 1  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告                  | 中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报 | 2026 年 01 月 22 日 |
| 2  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）   | 中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报 | 2026 年 03 月 31 日 |
| 3  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告                    | 中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报 | 2026 年 03 月 31 日 |
| 4  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告                  | 中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报 | 2026 年 04 月 22 日 |
| 5  | 2025 年度汇添富基金管理股份有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露 | 公司网站                           | 2026 年 04 月 30 日 |

|   |                                                   |                        |                  |
|---|---------------------------------------------------|------------------------|------------------|
| 6 | 汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报 | 2026 年 06 月 06 日 |
| 7 | 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要                     | 中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所 | 2026 年 06 月 18 日 |
| 8 | 汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书                        | 中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所 | 2026 年 06 月 18 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（%） |
| 个人                                                                                                | 1              | 2026 年 4 月 24 日至 2026 年 6 月 30 日 | 10,581,763.46 | -    | -    | 10,581,763.46 | 23.43   |
| 产品特有风险                                                                                            |                |                                  |               |      |      |               |         |
| 1、持有人大会投票权集中的风险<br>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、巨额赎回的风险<br>持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。                          |                |                                  |               |      |      |               |         |
| 3、基金规模较小导致的风险<br>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。 |                |                                  |               |      |      |               |         |
| 4、基金净值大幅波动的风险<br>持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。                               |                |                                  |               |      |      |               |         |

5、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、转换运作方式或与其他基金合并。

## 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、中国证监会批准汇添富添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富添鑫多元收益 9 个月持有期混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日