

汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	21
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64

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.....	64
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.....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	64
§ 8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	66
§ 9 开放式基金份额变动.....	67
§ 10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	68
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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.....	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§ 12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金		
基金简称	汇添富沪深 300 指数增强		
基金主代码	005530		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 11 月 03 日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额（份）	933,762,753.87		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C	汇添富沪深 300 指数增强 Y
下属分级基金的交易代码	005530	010556	022949
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	574,043,311.76	350,336,474.72	9,382,967.39

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以沪深 300 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力求实现超越标的指数的业绩表现和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 * 95% + 活期存款利率（税后） * 5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	王小飞
	联系电话	021-28932888	021-60637103
	电子邮箱	service@99fund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	021-60637228
传真		021-28932998	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200010	100033
法定代表人		鲁伟铭	张金良

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路 728 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)		
	汇添富沪深 300 指数 增强 A	汇添富沪深 300 指数 增强 C	汇添富沪深 300 指数 增强 Y
本期已实现收益	71,157,552.16	41,490,191.30	912,485.61
本期利润	58,012,669.98	37,912,574.11	822,442.38
加权平均基金份额本期利润	0.0910	0.0942	0.0981
本期加权平均净值利润率	5.62%	5.96%	6.01%
本期基金份额净值增长率	5.67%	5.46%	5.94%

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	385,280,976.06	221,422,411.19	6,422,749.81
期末可供分配基金份额利润	0.6712	0.6320	0.6845
期末基金资产净值	959,324,287.82	571,758,885.91	15,805,717.20
期末基金份额净值	1.6712	1.6320	1.6845
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	24.90%	20.75%	24.80%

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

汇添富沪深 300 指数增强 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	8.96%	1.11%	11.30%	1.19%	-2.34%	-0.08%
过去六个月	5.67%	1.03%	7.20%	1.07%	-1.53%	-0.04%
过去一年	20.46%	0.88%	25.13%	0.97%	-4.67%	-0.09%
过去三年	35.80%	0.98%	28.26%	1.06%	7.54%	-0.08%
过去五年	8.16%	1.00%	-4.02%	1.06%	12.18%	-0.06%
自基金合同生效起至今	24.90%	1.03%	5.74%	1.07%	19.16%	-0.04%
汇添富沪深 300 指数增强 C						
阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①－③	②－④

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	8.85%	1.11%	11.30%	1.19%	-2.45%	-0.08%
过去六个月	5.46%	1.03%	7.20%	1.07%	-1.74%	-0.04%
过去一年	19.97%	0.88%	25.13%	0.97%	-5.16%	-0.09%
过去三年	34.19%	0.98%	28.26%	1.06%	5.93%	-0.08%
过去五年	6.01%	1.00%	-4.02%	1.06%	10.03%	-0.06%
自基金合同生效起至今	20.75%	1.03%	4.55%	1.07%	16.20%	-0.04%
汇添富沪深 300 指数增强 Y						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去三个月	9.10%	1.11%	11.30%	1.19%	-2.20%	-0.08%
过去六个月	5.94%	1.03%	7.20%	1.07%	-1.26%	-0.04%
过去一年	21.07%	0.88%	25.13%	0.97%	-4.06%	-0.09%
自基金合同生效起至今	24.80%	0.90%	25.26%	0.96%	-0.46%	-0.06%

3.2.2 自基金转型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

汇添富沪深300指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富沪深300指数增强Y累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2020年11月03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。

本基金由原汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金于2020年11月03日转型而来。

本基金于2024年12月13日新增Y类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问、公募证券投资基金销售等业务资格。

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基金经理	2018 年 03 月 23 日	—	16	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金

					经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 2 日至 2024 年 7 月 11 日任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至 2025 年 3 月 8 日任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券
--	--	--	--	--	---

					投资基金的基金经理。 2023 年 7 月 19 日至今任汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2023 年 11 月 14 日至今任汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2024 年 1 月 31 日至 2025 年 11 月 13 日任汇添富稳元回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2024 年 3 月 28 日至今任汇添富稳兴回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2026 年 3 月 3 日至今任汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金的基金经理。 2026 年 5 月 27 日至今任汇添富创业板综合指数增强型证券
--	--	--	--	--	---

					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。

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

报告期内，中国经济总体平稳、稳中趋缓，“供强需弱”格局延续，结构分化明显。一季度经济开局良好，二季度增速有所回落。生产端韧性较强，工业增加值维持较快增长，高技术制造业增势良好，新质生产力对经济增长的贡献持续提升。出口延续强势，成为上半年经济的重要支撑。投资端整体承压，固定资产投资有所下行，房地产投资仍是主要拖累，基建与制造业投资增速明显回落，高技术产业投资保持增长。消费复苏偏弱，内需不足仍是主要约束。物价温和回升，CPI 中枢逐步抬升，PPI 同比由负转正，“促进物价合理回升”的政策效果逐步显现。政策方面，财政政策保持积极取向，增量与存量工具并举支持有效投资；货币政策稳健偏宽松，年初下调结构性货币政策工具利率，并通过公开市场操作、完善短端利率框架等方式保持流动性充裕；企业端融资需求好于居民端，但信贷需求总体偏弱；产业政策持续聚焦“新质生产力”，引导金融资源向科技创新领域倾斜。海外方面，美联储暂停降息进程，年内降息预期持续降温，美债收益率维持高位，地缘政治风险边际上升，外部环境不确定性加大。

权益市场方面，报告期内 A 股震荡上行，交投活跃度维持高位，风格与结构分化显著。一季度初市场延续上年年末的活跃态势，成长动量风格涨幅较大，随后成交缩量、行情转为

震荡，风格阶段性再均衡，红利、价值风格有所表现。二季度市场情绪再度走强，成长风格显著领先，价值及红利风格偏弱，资金向科技成长类资产集中，呈现极致分化格局。风格与因子方面，一季度风格轮动加快，红利与小盘成长相对占优，大盘成长承压；二季度成长、动量、高 Beta 等因子显著占优，价值、质量、低波动、红利等逆向因子整体回撤，因子有效性随风格切换波动较大。

组合运作方面，本基金使用量化选股策略构建沪深 300 指数增强组合，保持了相对均衡的因子配置，控制了组合相对基准在风格、行业、个股上的偏离。一季度组合相对业绩比较基准略有超额；二季度成长、动量、高 Beta 风格大幅快速上涨，组合超配的低估值、高质量、低波动风格整体表现较差，同时对科技成长类股票的配置比例不足，在风格和选股上都形成拖累，超额收益出现回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富沪深 300 指数增强 A 类份额净值增长率为 5.67%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。本报告期汇添富沪深 300 指数增强 C 类份额净值增长率为 5.46%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。本报告期汇添富沪深 300 指数增强 Y 类份额净值增长率为 5.94%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中国经济预计温和回升，修复斜率取决于内需政策落地效果、房地产企稳程度及外部环境变化。随着存量政策效果逐步释放、财政政策持续积极发力，内需有望边际改善；房地产市场经过数年调整，供求关系正趋于新的平衡；名义增长与微观主体感受之间的“温差”有望收窄。货币政策预计维持稳健偏宽松，结构性工具继续引导金融资源流向科技创新等重点领域。海外方面，美联储政策路径仍存不确定性，地缘政治与经贸关系的反复可能阶段性扰动市场预期。

权益市场方面，行情驱动力预计由流动性扩张逐步转向盈利验证，指数层面或维持宽幅震荡，结构性行情仍将延续。当前板块与风格间的分化已较为极致，随着基本面边际改善和盈利修复范围扩大，极致抱团的风格有望迎来均衡轮动，增量资金可能从高位板块向估值合理、基本面稳健的板块分流。成长风格仍有产业趋势支撑，但资金配置比例已处历史高位，波动将有所加大；具备稳定盈利和分红能力的高质量资产在震荡环境中仍具配置价值。选股因子方面，因子有效性有望趋于多元和均衡，盈利质量类因子的重要性可能上升。

本基金将继续基于量化模型挑选个股，保持相对沪深 300 在风格和行业上的均衡配置，

维持清晰和稳定的大盘风格。沪深 300 指数作为 A 股市场核心蓝筹的代表，成份股盈利相对稳定、流动性好、估值合理，具备较好的长期投资价值。未来将继续推进量化选股模型和风险控制模型的迭代优化，提高对市场风格变化的应对能力，提升超额收益的稳定性。

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相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红，Y 类基金份额默认的收益分配方式是红利再投资；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；同一类别内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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	57,980,829.86	122,806,850.95
结算备付金		7,243,088.88	2,960,728.57
存出保证金		285,659.32	628,056.32
交易性金融资产	6.4.7.2	1,490,213,490.48	1,930,463,426.03
其中：股票投资		1,454,111,939.31	1,930,463,426.03
基金投资		-	-
债券投资		36,101,551.17	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		1,435,999.58	4,536,406.85
应收股利		-	-
应收申购款		1,166,962.28	4,253,911.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,558,326,030.40	2,065,649,379.79
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,548,861.69	-
应付赎回款		3,089,775.96	5,241,688.39
应付管理人报酬		932,648.28	1,442,193.11
应付托管费		233,162.07	360,548.31
应付销售服务费		181,559.58	252,259.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,113.95	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	450,017.94	848,832.69
负债合计		11,437,139.47	8,145,522.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	933,762,753.87	1,311,114,303.16
未分配利润	6.4.7.9	613,126,137.06	746,389,554.37
净资产合计		1,546,888,890.93	2,057,503,857.53
负债和净资产总计		1,558,326,030.40	2,065,649,379.79

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 933,762,753.87 份。本基金下属汇添富沪深 300 指数增强 A 基金份额净值 1.6712 元，基金份额总额 574,043,311.76 份；本基金下属汇添富沪深 300 指数增强 C 基金份额净值 1.6320 元，基金份额总额 350,336,474.72 份；本基金下属汇添富沪深 300 指数增强 Y 基金份额净值 1.6845 元，基金份额总额 9,382,967.39 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金

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 2026 年 01 月 01 日 至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		106,487,254.62	117,672,550.24
1.利息收入		198,307.35	458,068.99
其中：存款利息收入	6.4.7.10	198,307.35	458,068.99
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		122,754,915.25	186,538,786.27
其中：股票投资收益	6.4.7.11	107,066,264.82	133,290,621.10
基金投资收益	6.4.7.12	—	—
债券投资收益	6.4.7.13	75,454.48	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.15	—	—
衍生工具收益	6.4.7.16	—	—
股利收益	6.4.7.17	15,613,195.95	53,248,165.17
以摊余成本计量的金融 资产终止确认产生的收益		—	—
其他投资收益		—	—
3.公允价值变动收益(损失以“-” 号填列)	6.4.7.18	-16,812,542.60	-70,532,372.50
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	346,574.62	1,208,067.48
减：二、营业总支出		9,739,568.15	23,178,893.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,681,602.93	16,086,265.04
其中：暂估管理人报酬		—	—
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,670,400.66	4,021,566.29
3. 销售服务费		1,267,422.45	2,808,092.47
4. 投资顾问费		—	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 信用减值损失	6.4.7.20	—	—
7. 税金及附加		262.86	—
8. 其他费用	6.4.7.21	119,879.25	262,969.91
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		96,747,686.47	94,493,656.53
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号 填列）		96,747,686.47	94,493,656.53
五、其他综合收益的税后净额		—	—
六、综合收益总额		96,747,686.47	94,493,656.53

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金

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		
	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	1,311,114,303.16	746,389,554.37	2,057,503,857.53
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,311,114,303.16	746,389,554.37	2,057,503,857.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-377,351,549.29	-133,263,417.31	-510,614,966.60
（一）、综合收益总额	-	96,747,686.47	96,747,686.47
（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）	-377,351,549.29	-230,011,103.78	-607,362,653.07
其中：1.基金申购款	306,501,051.58	189,621,421.78	496,122,473.36
2.基金赎回款	-683,852,600.87	-419,632,525.56	-1,103,485,126.43
（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	933,762,753.87	613,126,137.06	1,546,888,890.93
项目	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,159,465,831.86	1,099,997,026.09	4,259,462,857.95
加：会计政策变更	-	-	-

二、本期期初净资产	3,159,465,831.86	1,099,997,026.09	4,259,462,857.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-317,125,505.45	-26,790,475.87	-343,915,981.32
（一）、综合收益总额	-	94,493,656.53	94,493,656.53
（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）	-317,125,505.45	-121,284,132.40	-438,409,637.85
其中：1.基金申购款	966,167,887.50	318,168,458.90	1,284,336,346.40
2.基金赎回款	-1,283,293,392.95	-439,452,591.30	-1,722,745,984.25
（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	2,842,340,326.41	1,073,206,550.22	3,915,546,876.63

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

汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），是由汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金变更而来。原汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资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〔2017〕1062 号文《关于准予汇添富价值多因子量化策略股票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 2018 年 3 月 23

日生效。首次设立基金募集规模为 361,461,540.37 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（2018）验字第 60466941_B17 号验资报告予以验证。

根据《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会于 2020 年 11 月 2 日表决通过了《关于汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金转型的议案》。自 2020 年 11 月 3 日起，本基金名称变更为“汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金”。《汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 3 日起生效，原《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于同一起失效。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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

自 2020 年 11 月 3 日起，本基金增设 C 类基金份额，原基金份额变更为 A 类基金份额。

自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类基金份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

2. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加

的单位外)及地方教育附加。

4.企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

5.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	57,980,829.86
等于: 本金	57,974,523.62

加：应计利息	6,306.24
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	57,980,829.86

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,369,275,367.90	—	1,454,111,939.31	84,836,571.41
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	35,824,265.00	193,105.69	36,101,551.17	84,180.48
	银行间市场	—	—	—	—
	其他	—	—	—	—
	合计	35,824,265.00	193,105.69	36,101,551.17	84,180.48
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		1,405,099,632.90	193,105.69	1,490,213,490.48	84,920,751.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	805.51
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	345,533.48
其中：交易所市场	345,533.48
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	4,500.00
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	450,017.94

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富沪深 300 指数增强 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	830,687,493.63	830,687,493.63
本期申购	201,458,897.75	201,458,897.75
本期赎回（以“-”号填列）	-458,103,079.62	-458,103,079.62
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	574,043,311.76	574,043,311.76
汇添富沪深 300 指数增强 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	474,135,451.60	474,135,451.60
本期申购	100,001,908.60	100,001,908.60
本期赎回（以“-”号填列）	-223,800,885.48	-223,800,885.48
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	350,336,474.72	350,336,474.72
汇添富沪深 300 指数增强 Y		
项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,291,357.93	6,291,357.93
本期申购	5,040,245.23	5,040,245.23
本期赎回（以“-”号填列）	-1,948,635.77	-1,948,635.77
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	9,382,967.39	9,382,967.39

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

汇添富沪深 300 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	492,078,679.20	-9,002,387.58	483,076,291.62
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	492,078,679.20	-9,002,387.58	483,076,291.62
本期利润	71,157,552.16	-13,144,882.18	58,012,669.98
本期基金份额交易产生的变动数	-160,942,613.80	5,134,628.26	-155,807,985.54
其中：基金申购款	136,289,850.55	-8,221,122.70	128,068,727.85
基金赎回款	-297,232,464.35	13,355,750.96	-283,876,713.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	402,293,617.56	-17,012,641.50	385,280,976.06
汇添富沪深 300 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	339,218,373.17	-79,617,909.40	259,600,463.77
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	339,218,373.17	-79,617,909.40	259,600,463.77
本期利润	41,490,191.30	-3,577,617.19	37,912,574.11
本期基金份额交易产生的变动数	-94,007,053.73	17,916,427.04	-76,090,626.69
其中：基金申购款	77,836,812.10	-19,433,376.20	58,403,435.90
基金赎回款	-171,843,865.83	37,349,803.24	-134,494,062.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	286,701,510.74	-65,279,099.55	221,422,411.19
汇添富沪深 300 指数增强 Y			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,781,916.02	-69,117.04	3,712,798.98
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	3,781,916.02	-69,117.04	3,712,798.98
本期利润	912,485.61	-90,043.23	822,442.38
本期基金份额交易产生的变动数	2,008,585.71	-121,077.26	1,887,508.45
其中：基金申购款	3,318,764.90	-169,506.87	3,149,258.03
基金赎回款	-1,310,179.19	48,429.61	-1,261,749.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,702,987.34	-280,237.53	6,422,749.81

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	153,802.83

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	42,996.48
其他	1,508.04
合计	198,307.35

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	2,294,647,282.94
减：卖出股票成本总额	2,185,472,230.37
减：交易费用	2,108,787.75
买卖股票差价收入	107,066,264.82

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	75,454.48
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	—
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	75,454.48

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	15,613,195.95
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	15,613,195.95

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	-16,812,542.60
——股票投资	-16,896,723.08
——债券投资	84,180.48
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
——期货投资	—
3.其他	—
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	—
合计	-16,812,542.60

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	346,574.62
替代损益	-
其他	-
合计	346,574.62

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	13,500.00
银行费用	7,200.30
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	-
合计	119,879.25

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
中国建设银行股份有限公司 ("建设银行")	基金托管人,基金销售机构
东方证券股份有限公司 ("东方证券")	基金管理人的股东,基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	7,840,189.23	0.20	437,876,263.04	3.80

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	5,102,550.00	14.29	-	-

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	1,379.17	0.20	1,379.17	0.40
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	77,018.99	3.79	5,724.70	0.65

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,681,602.93	16,086,265.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,195,454.11	2,514,569.88
应支付基金管理人的净管理费	5,486,148.82	13,571,695.16

注：各类基金份额的管理费按前一日该类基金份额的基金资产净值的年管理费率计提。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的年管理费率为 0.80%，Y 类基金份额的年管理费率为 0.40%。管理费的计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,670,400.66	4,021,566.29

注：各类基金份额的托管费按前一日该类基金份额的基金资产净值的年托管费率计提。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的年托管费率为 0.20%，Y 类基金份额的年托管费率为 0.10%。托管费的计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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			
	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C	汇添富沪深 300 指数增强 Y	合计
东方证券股份有限公司	-	235.10	-	235.10
汇添富基金管理股份有限公司	-	807,594.30	-	807,594.30
中国建设银行股份有限公司	-	30,793.53	-	30,793.53
合计	-	838,622.93	-	838,622.93
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			
	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C	汇添富沪深 300 指数增强 Y	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,741,858.38	-	1,741,858.38
东方证券股份有限公司	-	3,101.82	-	3,101.82
中国建设银行股份有限公司	-	80,702.27	-	80,702.27
合计	-	1,825,662.47	-	1,825,662.47

注：本基金 A 类基金份额、Y 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 0.40%。

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 0.40% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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
建设银行	57,980,829.86	153,802.83	247,608,688.39	435,937.83

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 01 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	
301513	尚水智能	2026 年 04 月	6 个月	新股流通	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	

		月 10 日		受限						
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	
301599	理奇智能	2026 年 04 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	
301666	大普微	2026 年 04 月 08 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	
301680	固德电材	2026 年 02 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	
301683	慧谷新材	2026 年 03 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	
301696	三瑞智能	2026 年 03 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	
603284	林平发展	2026 年 02 月	6 个月	新股流通	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	

		月 03 日		受限						
603293	埃泰克汽车电子	2026 年 04 月 09 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	
688765	武汉禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新股流通受限	29.06	48.56	16,470	478,618.20	799,783.20	
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	
688785	恒运昌股份	2026 年 01 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	
688811	有研金属	2026 年 04 月	6 个月	新股流通	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	

	复材	月 01 日		受限						
688813	泰金新能	2026 年 03 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	26.28	172.0 9	234	6,149. 52	40,26 9.06	
688818	中电科蓝 天科技	2026 年 02 月 03 日	6 个 月	新股 流通 受限	9.47	70.14	1,717	16,25 9.99	120,4 30.38	
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个 月	新股 流通 受限	19.68	141.4 9	2,391	47,05 4.88	338,3 02.59	
000032	深桑达 A	2026 年 01 月 29 日	6 个 月	非公 开发 行流 通受 限	15.54	23.64	193,0 50	2,999, 997.0 0	4,563, 702.0 0	
300735	光弘科技	2026 年 05 月 14 日	6 个 月	非公 开发 行流 通受 限	18.53	20.68	80,95 0	1,500, 003.5 0	1,674, 046.0 0	
300913	兆龙互连	2025 年 12 月 29 日	6 个 月	非公 开发 行流 通受 限	39.74	47.91	50,32 7	1,999, 994.9 8	2,411, 166.5 7	
300984	金沃股份	2026 年 05 月 25 日	6 个 月	非公 开发 行流 通受 限	51.51	49.93	29,12 1	1,500, 022.7 1	1,454, 011.5 3	
603667	五洲新春	2026 年 04 月 28 日	6 个 月	非公 开发 行流 通受 限	59.00	60.61	25,42 4	1,500, 016.0 0	1,540, 948.6 4	
603906	龙蟠科技	2026 年 05 月 13 日	6 个 月	非公 开发 行流 通受 限	20.19	24.29	74,29 4	1,499, 995.8 6	1,804, 601.2 6	

605218	伟时电子	2026 年 03 月 04 日	6 个月	非公开发行流通受限	16.01	15.57	31,231	500,008.31	486,266.67	
605488	福莱新材	2026 年 03 月 05 日	6 个月	非公开发行流通受限	32.66	26.47	30,619	1,000,016.54	810,484.93	
688368	晶丰明源半导体	2026 年 04 月 29 日	6 个月	非公开发行流通受限	76.25	193.87	24,917	1,899,936.50	4,830,658.79	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“晶丰明源半导体”（证券代码：688368）包含其新股发行后根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 7,119 股（根据晶丰明源半导体 2025 年年度权益分派实施公告，晶丰明源半导体以实施权益分派股权登记日登记的总股本扣减回购专用证券账户中股份后的 144,801,113 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 10 元（含税），同时以资本公积向全体股东每 10 股转增 4 股，不送红股。除权除息日为 2026 年 6 月 9 日。）。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 07 月 13 日	890.99	8,900	5,953,672.97	7,827,817.00	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于

基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配,确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外,本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法

对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	57,980,829.86	-	-	-	-	-	57,980,829.86
结算备付金	7,243,088.88	-	-	-	-	-	7,243,088.88
存出保证金	285,659.32	-	-	-	-	-	285,659.32
交易性金融资产	405,050.19	-	35,696,500.98	-	-	1,454,111,939.31	1,490,213,490.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,435,999.58	1,435,999.58
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,166,962.28	1,166,962.28
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	65,914,628.25	-	35,696,500.98	-	-	1,456,714,901.17	1,558,326,030.40
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	-	-	-	-	-	6,548,861	6,548,861

款						.69	.69
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,089,775.96	3,089,775.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	932,648.28	932,648.28
应付托管费	-	-	-	-	-	233,162.07	233,162.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	181,559.58	181,559.58
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1,113.95	1,113.95
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	450,017.94	450,017.94
负债总计	-	-	-	-	-	11,437,139.47	11,437,139.47
利率敏感度缺口	65,914,628.25	-	35,696,500.98	-	-	1,445,277,761.70	1,546,888,890.93
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	122,806,850.95	-	-	-	-	-	122,806,850.95
结算备付金	2,960,728.57	-	-	-	-	-	2,960,728.57
存出保证金	628,056.32	-	-	-	-	-	628,056.32
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,930,463,426.03	1,930,463,426.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	4,536,406.85	4,536,406.85
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购	-	-	-	-	-	4,253,911	4,253,911

款						.07	.07
递延所得 税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	126,395,635.84	-	-	-	-	1,939,253,743.95	2,065,649,379.79
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	-	-	-	-	-	5,241,688.39	5,241,688.39
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	1,442,193.11	1,442,193.11
应付托管 费	-	-	-	-	-	360,548.31	360,548.31
应付销售 服务费	-	-	-	-	-	252,259.76	252,259.76
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	-	-	-	-	-	848,832.69	848,832.69
负债总计	-	-	-	-	-	8,145,522.26	8,145,522.26
利率敏感 度缺口	126,395,635.84	-	-	-	-	1,931,108,221.69	2,057,503,857.53

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4.银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5.该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	50,590.24	-
	基准利率增加 25 个基点	-50,432.27	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产－股票投资	1,454,111,939.31	94.00	1,930,463,426.03	93.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	36,101,551.17	2.33	-	-

交易性金融资产－贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产－权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,490,213,490.48	96.34	1,930,463,426.03	93.83

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险,即从长期来看,本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关,且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变; 2.以下分析中,除市场基准发生变动,其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	69,669,893.11	88,496,914.39
	沪深 300 指数下跌 5%	-69,669,893.11	-88,496,914.39

注:本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时,将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日
---------------	-------------------------

第一层次	1,424,017,072.85
第二层次	46,165,055.73
第三层次	20,031,361.90
合计	1,490,213,490.48

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,454,111,939.31	93.31
	其中：股票	1,454,111,939.31	93.31
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	36,101,551.17	2.32
	其中：债券	36,101,551.17	2.32

	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	65,223,918.74	4.19
8	其他各项资产	2,888,621.18	0.19
9	合计	1,558,326,030.40	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,631,108.04	0.17
B	采矿业	73,115,813.92	4.73
C	制造业	778,272,400.77	50.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,488,803.53	1.84
E	建筑业	4,943,092.00	0.32
F	批发和零售业	1,155,747.40	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	17,341,869.54	1.12
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,537,703.54	4.75
J	金融业	231,053,865.62	14.94
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	3,980,416.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	14,916,298.00	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,229,437,118.36	79.48

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	145,256.00	0.01
B	采矿业	—	—
C	制造业	180,986,122.24	11.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,271,111.44	0.34

E	建筑业	6,686,552.88	0.43
F	批发和零售业	4,323,417.06	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	3,648,454.08	0.24
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,045,618.79	1.10
J	金融业	311,360.00	0.02
K	房地产业	299.60	0.00
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	6,116,463.46	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	140,059.00	0.01
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	106.40	0.00
S	综合	—	—
	合计	224,674,820.95	14.52

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	58,050	73,723,500.00	4.77
2	300750	宁德时代	143,136	56,253,879.36	3.64
3	300502	新易盛	62,220	37,767,540.00	2.44
4	600519	贵州茅台	31,022	36,776,270.78	2.38
5	601318	中国平安	614,356	29,329,355.44	1.90
6	688256	寒武纪科技	16,644	26,556,334.2	1.72

				0	
7	601899	紫金矿业	992,200	24,943,908.0 0	1.61
8	002371	北方华创	26,525	23,462,954.0 0	1.52
9	603986	兆易创新	28,600	23,309,000.0 0	1.51
10	000333	美的集团	297,063	22,437,168.3 9	1.45
11	600036	招商银行	620,938	22,043,299.0 0	1.43
12	002475	立讯精密	312,100	21,971,840.0 0	1.42
13	688012	中微半导体 设备	38,438	18,008,203.0 0	1.16
14	688041	海光信息	47,810	17,704,043.0 0	1.14
15	600030	中信证券	612,541	17,598,302.9 3	1.14
16	601166	兴业银行	1,058,891	17,535,234.9 6	1.13
17	600900	长江电力	645,299	17,081,064.5 3	1.10
18	688981	中芯国际	104,454	16,589,384.2 8	1.07
19	688008	澜起科技	52,457	16,256,424.3 0	1.05
20	603259	药明康德	119,800	14,916,298.0 0	0.96
21	002384	东山精密	52,100	13,668,435.0 0	0.88
22	601138	工业富联	184,600	13,318,890.0 0	0.86
23	600276	恒瑞医药	255,836	13,313,705.4 4	0.86
24	000725	京东方 A	1,380,000	11,978,400.0 0	0.77
25	600183	生益科技	68,800	11,929,920.0 0	0.77
26	300476	胜宏科技	34,000	11,778,620.0 0	0.76
27	300274	阳光电源	72,820	11,579,836.4 0	0.75

28	601398	工商银行	1,567,000	11,078,690.0 0	0.72
29	600919	江苏银行	988,400	10,654,952.0 0	0.69
30	002415	海康威视	308,581	10,553,470.2 0	0.68
31	601211	国泰海通	547,534	9,965,118.80	0.64
32	002463	沪电股份	63,200	9,656,960.00	0.62
33	600031	三一重工	527,100	9,108,288.00	0.59
34	600887	伊利股份	373,500	8,949,060.00	0.58
35	300408	三环集团	53,150	8,870,735.00	0.57
36	300059	东方财富	430,537	8,774,344.06	0.57
37	601288	农业银行	1,422,300	8,633,361.00	0.56
38	600406	国电南瑞	372,758	8,517,520.30	0.55
39	603993	洛阳钼业	479,400	8,413,470.00	0.54
40	600309	万华化学	122,774	8,398,969.34	0.54
41	601088	中国神华	215,000	8,393,600.00	0.54
42	601601	中国太保	292,800	8,350,656.00	0.54
43	600150	中国船舶	243,565	8,230,061.35	0.53
44	601328	交通银行	1,268,600	8,157,098.00	0.53
45	000651	格力电器	214,321	8,037,037.50	0.52
46	688072	拓荆科技	8,900	7,827,817.00	0.51
47	601728	中国电信	1,494,900	7,758,531.00	0.50
48	000338	潍柴动力	282,400	7,695,400.00	0.50
49	000792	盐湖股份	244,100	7,369,379.00	0.48
50	002600	领益智造	416,200	7,216,908.00	0.47
51	300394	天孚通信	22,800	6,901,104.00	0.45
52	600660	福耀玻璃	134,500	6,784,180.00	0.44
53	600489	中金黄金	373,300	6,738,065.00	0.44
54	600176	中国巨石	92,400	6,734,112.00	0.44
55	002916	深南电路	14,700	6,731,130.00	0.44
56	000001	平安银行	668,000	6,713,400.00	0.43
57	002594	比亚迪	82,500	6,575,250.00	0.43
58	601727	上海电气	923,900	6,467,300.00	0.42
59	000807	云铝股份	289,100	6,400,674.00	0.41
60	601688	华泰证券	298,500	6,155,070.00	0.40
61	600111	北方稀土	125,608	6,035,464.40	0.39
62	603799	华友钴业	123,300	5,950,458.00	0.38
63	600941	中国移动	67,998	5,856,667.74	0.38
64	000063	中兴通讯	161,200	5,833,828.00	0.38
65	000538	云南白药	122,740	5,814,193.80	0.38
66	000100	TCL 科技	998,000	5,808,360.00	0.38
67	600795	国电电力	1,194,800	5,579,716.00	0.36

68	601360	三六零	639,700	5,558,993.00	0.36
69	600089	特变电工	247,000	5,557,500.00	0.36
70	600050	中国联通	1,388,900	5,555,600.00	0.36
71	600741	华域汽车	341,500	5,300,080.00	0.34
72	601857	中国石油	602,069	5,225,958.92	0.34
73	600061	国投资本	767,700	5,028,435.00	0.33
74	300124	汇川技术	75,300	4,994,649.00	0.32
75	300014	亿纬锂能	76,400	4,968,292.00	0.32
76	600690	海尔智家	242,300	4,945,343.00	0.32
77	000425	徐工机械	610,600	4,939,754.00	0.32
78	601877	正泰电器	196,200	4,918,734.00	0.32
79	000988	华工科技	26,600	4,910,626.00	0.32
80	000166	申万宏源	1,107,400	4,872,560.00	0.31
81	301308	江波龙	6,900	4,856,220.00	0.31
82	000895	双汇发展	216,432	4,848,076.80	0.31
83	601898	中煤能源	392,600	4,781,868.00	0.31
84	601018	宁波港	1,486,400	4,682,160.00	0.30
85	600845	宝信软件	276,100	4,591,543.00	0.30
86	601668	中国建筑	1,020,400	4,428,536.00	0.29
87	600460	士兰微	80,400	4,394,664.00	0.28
88	601600	中国铝业	528,200	4,341,804.00	0.28
89	002142	宁波银行	145,935	4,332,810.15	0.28
90	601229	上海银行	498,800	4,329,584.00	0.28
91	601818	光大银行	1,469,373	4,246,487.97	0.27
92	601225	陕西煤业	207,600	4,224,660.00	0.27
93	600522	中天科技	69,200	4,199,056.00	0.27
94	002602	世纪华通	286,763	4,043,358.30	0.26
95	603501	豪威集团	42,360	4,017,846.00	0.26
96	002027	分众传媒	822,400	3,980,416.00	0.26
97	601766	中国中车	764,000	3,972,800.00	0.26
98	601816	京沪高铁	862,158	3,905,575.74	0.25
99	002352	顺丰控股	116,400	3,638,664.00	0.24
100	688521	芯原微电子	9,400	3,488,716.00	0.23
101	600000	浦发银行	400,023	3,444,198.03	0.22
102	002028	思源电气	19,300	3,338,900.00	0.22
103	603019	中科曙光	30,200	3,238,346.00	0.21
104	000776	广发证券	135,800	3,177,720.00	0.21
105	600584	长电科技	30,600	3,168,630.00	0.20
106	002532	天山铝业	289,400	3,105,262.00	0.20
107	601788	光大证券	214,070	3,089,030.10	0.20
108	002241	歌尔股份	137,100	3,088,863.00	0.20
109	600028	中国石化	690,800	3,080,968.00	0.20
110	601009	南京银行	310,100	3,066,889.00	0.20

111	600938	中国海油	108,800	2,953,920.00	0.19
112	002049	紫光国微	32,700	2,902,125.00	0.19
113	000858	五 粮 液	38,947	2,882,078.00	0.19
114	601100	恒立液压	26,300	2,828,828.00	0.18
115	601628	中国人寿	79,600	2,813,860.00	0.18
116	603288	海天味业	83,400	2,765,544.00	0.18
117	600926	杭州银行	187,300	2,706,485.00	0.17
118	601998	中信银行	386,100	2,675,673.00	0.17
119	002714	牧原股份	75,196	2,631,108.04	0.17
120	002236	大华股份	158,800	2,618,612.00	0.17
121	601988	中国银行	455,500	2,605,460.00	0.17
122	688396	华润微电子	26,673	2,601,951.15	0.17
123	601658	邮储银行	526,000	2,593,180.00	0.17
124	000408	藏格矿业	37,295	2,585,289.40	0.17
125	002353	杰瑞股份	16,800	2,562,000.00	0.17
126	600372	中航机载	235,100	2,550,835.00	0.16
127	000975	山金国际	141,800	2,410,600.00	0.16
128	600019	宝钢股份	430,500	2,337,615.00	0.15
129	600875	东方电气	76,400	2,198,028.00	0.14
130	601377	兴业证券	346,200	2,091,048.00	0.14
131	300628	亿联网络	61,500	2,079,930.00	0.13
132	601336	新华保险	34,800	2,076,168.00	0.13
133	002493	荣盛石化	192,600	2,070,450.00	0.13
134	601985	中国核电	227,400	2,053,422.00	0.13
135	601995	中金公司	55,800	2,017,170.00	0.13
136	603893	瑞芯微	10,600	1,996,616.00	0.13
137	603296	华勤技术	26,320	1,954,786.40	0.13
138	600547	山东黄金	84,400	1,948,796.00	0.13
139	600585	海螺水泥	111,600	1,891,620.00	0.12
140	002938	鹏鼎控股	16,800	1,770,384.00	0.11
141	002311	海大集团	39,075	1,743,135.75	0.11
142	601012	隆基绿能	131,900	1,730,528.00	0.11
143	601919	中远海控	127,090	1,685,213.40	0.11
144	601077	渝农商行	266,100	1,625,871.00	0.11
145	600570	恒生电子	76,000	1,610,440.00	0.10
146	600886	国投电力	115,300	1,534,643.00	0.10
147	300033	同花顺	6,320	1,523,120.00	0.10
148	600160	巨化股份	28,600	1,516,086.00	0.10
149	601058	赛轮轮胎	124,900	1,440,097.00	0.09
150	600018	上港集团	302,545	1,428,012.40	0.09
151	600196	复星医药	62,100	1,395,387.00	0.09
152	601881	中国银河	107,600	1,352,532.00	0.09
153	003816	中国广核	320,600	1,253,546.00	0.08

154	000938	紫光股份	41,300	1,191,918.00	0.08
155	000963	华东医药	41,100	1,155,732.00	0.07
156	601916	浙商银行	430,500	1,132,215.00	0.07
157	600999	招商证券	49,588	1,046,306.80	0.07
158	601319	中国人保	150,000	1,014,000.00	0.07
159	300433	蓝思科技	18,700	1,003,442.00	0.06
160	600362	江西铜业	21,300	922,290.00	0.06
161	300661	圣邦股份	6,100	875,228.00	0.06
162	600918	中泰证券	158,800	844,816.00	0.05
163	000999	华润三九	32,900	739,921.00	0.05
164	000157	中联重科	104,300	726,971.00	0.05
165	600233	圆通速递	45,700	719,775.00	0.05
166	601169	北京银行	143,100	701,190.00	0.05
167	300999	金龙鱼	29,700	690,822.00	0.04
168	600893	航发动力	17,400	667,116.00	0.04
169	600085	同仁堂	28,600	660,946.00	0.04
170	600803	新奥股份	40,600	641,480.00	0.04
171	600015	华夏银行	96,534	616,852.26	0.04
172	600066	宇通客车	22,500	603,225.00	0.04
173	000708	中信特钢	46,000	580,520.00	0.04
174	600115	中国东航	148,800	566,928.00	0.04
175	600039	四川路桥	65,800	514,556.00	0.03
176	600989	宝丰能源	25,000	508,250.00	0.03
177	600016	民生银行	153,046	492,808.12	0.03
178	000568	泸州老窖	6,200	480,624.00	0.03
179	600549	厦门钨业	5,500	468,600.00	0.03
180	002050	三花智控	10,200	447,066.00	0.03
181	600482	中国动力	12,700	416,560.00	0.03
182	688271	联影医疗	3,647	369,185.81	0.02
183	002202	金风科技	15,300	365,670.00	0.02
184	601136	首创证券	26,000	362,700.00	0.02
185	001965	招商公路	38,900	356,324.00	0.02
186	600025	华能水电	38,800	344,932.00	0.02
187	600426	华鲁恒升	13,400	320,528.00	0.02
188	600760	中航沈飞	6,500	267,150.00	0.02
189	600029	南方航空	41,900	217,042.00	0.01
190	000630	铜陵有色	29,700	188,892.00	0.01
191	002736	国信证券	18,600	185,814.00	0.01
192	002460	赣锋锂业	2,700	176,580.00	0.01
193	000657	中钨高新	1,600	153,152.00	0.01
194	601111	中国国航	23,500	142,175.00	0.01
195	688036	传音控股	2,400	141,480.00	0.01
196	002001	新 和 成	26	738.92	0.00

197	601607	上海医药	1	15.40	0.00
-----	--------	------	---	-------	------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	600299	安迪苏	795,756	6,246,684.60	0.40
2	688368	晶丰明源半 导体	24,917	4,830,658.79	0.31
3	000032	深桑达 A	193,050	4,563,702.00	0.30
4	002338	奥普光电	66,000	3,775,200.00	0.24
5	300493	润欣科技	249,400	3,718,554.00	0.24
6	300699	光威复材	128,500	3,681,525.00	0.24
7	688475	萤石网络	133,800	3,659,430.00	0.24
8	002065	东华软件	504,700	3,603,558.00	0.23
9	600685	中船防务	141,100	3,589,584.00	0.23
10	002090	金智科技	400,300	3,538,652.00	0.23
11	002152	广电运通	374,200	3,509,996.00	0.23
12	300127	银河磁体	125,100	3,496,545.00	0.23
13	000423	东阿阿胶	76,500	3,470,040.00	0.22
14	002017	东信和平	235,700	3,448,291.00	0.22
15	002349	精华制药	553,300	3,435,993.00	0.22
16	688002	睿创微纳	22,201	3,434,272.69	0.22
17	300458	全志科技	86,900	3,429,074.00	0.22
18	688128	中国电器研 究院	143,200	3,399,568.00	0.22
19	300623	捷捷微电	75,300	3,387,747.00	0.22
20	002953	日丰股份	384,100	3,349,352.00	0.22
21	002454	松芝股份	692,720	3,311,201.60	0.21
22	002414	高德红外	248,300	3,292,458.00	0.21
23	002516	旷达科技	589,100	3,287,178.00	0.21
24	605118	力鼎光电	93,500	3,262,215.00	0.21
25	300722	新余国科	146,200	3,260,260.00	0.21
26	600479	千金药业	344,100	3,200,130.00	0.21
27	002593	日上集团	792,900	3,163,671.00	0.20
28	002651	利君股份	428,900	3,135,259.00	0.20
29	003015	日久光电	233,600	3,043,808.00	0.20
30	601326	秦港股份	951,500	3,006,740.00	0.19

31	688728	格科微有限公司	142,900	3,006,616.00	0.19
32	688522	纳睿雷达科技	149,300	2,988,986.00	0.19
33	300563	神宇股份	103,900	2,949,721.00	0.19
34	603858	步长制药	200,400	2,925,840.00	0.19
35	301289	国缆检测	62,100	2,919,321.00	0.19
36	000795	英洛华	333,600	2,885,640.00	0.19
37	000045	深纺织 A	271,100	2,857,394.00	0.18
38	301339	通行宝	273,400	2,796,882.00	0.18
39	002340	格林美	418,000	2,762,980.00	0.18
40	000027	深圳能源	442,000	2,740,400.00	0.18
41	603025	大豪科技	196,900	2,685,716.00	0.17
42	300847	中船汉光	194,500	2,516,830.00	0.16
43	600558	大西洋	494,000	2,440,360.00	0.16
44	300678	中科信息	108,600	2,432,640.00	0.16
45	600526	菲达环保	590,900	2,428,599.00	0.16
46	300913	兆龙互连	50,327	2,411,166.57	0.16
47	688230	芯导科技	30,200	2,380,062.00	0.15
48	002077	大港股份	121,300	2,339,877.00	0.15
49	605005	合兴股份	147,300	2,328,813.00	0.15
50	600506	统一股份	157,340	2,185,452.60	0.14
51	002307	北新路桥	737,101	2,122,850.88	0.14
52	600132	重庆啤酒	49,700	2,052,610.00	0.13
53	600267	海正药业	196,400	1,985,604.00	0.13
54	002004	华邦健康	501,100	1,969,323.00	0.13
55	301508	中机认检	85,000	1,966,900.00	0.13
56	002287	奇正藏药	100,273	1,889,143.32	0.12
57	600210	紫江企业	303,600	1,882,320.00	0.12
58	603906	龙蟠科技	74,294	1,804,601.26	0.12
59	002273	水晶光电	50,700	1,798,836.00	0.12
60	000683	博源化工	305,600	1,760,256.00	0.11
61	300735	光弘科技	80,950	1,674,046.00	0.11
62	600789	鲁抗医药	244,200	1,663,002.00	0.11
63	002239	奥特佳	652,100	1,610,687.00	0.10
64	600288	大恒科技	120,500	1,602,650.00	0.10
65	603667	五洲新春	25,424	1,540,948.64	0.10
66	301202	朗威股份	44,500	1,483,185.00	0.10
67	000650	仁和药业	290,900	1,480,681.00	0.10
68	300984	金沃股份	29,121	1,454,011.53	0.09
69	002275	桂林三金	114,300	1,393,317.00	0.09
70	002690	美亚光电	96,700	1,385,711.00	0.09
71	601218	吉鑫科技	319,800	1,375,140.00	0.09

72	603551	奥普科技	146,400	1,316,136.00	0.09
73	603235	天新药业	53,000	1,179,250.00	0.08
74	001286	陕西能源	105,600	1,070,784.00	0.07
75	600640	国脉文化	98,500	952,495.00	0.06
76	603107	上海汽配	83,100	943,185.00	0.06
77	600884	杉杉股份	66,300	898,365.00	0.06
78	601216	君正集团	193,400	862,564.00	0.06
79	605488	福莱新材	30,619	810,484.93	0.05
80	301215	中汽股份	154,400	801,336.00	0.05
81	300627	华测导航	28,200	800,880.00	0.05
82	688765	武汉禾元生物	16,470	799,783.20	0.05
83	300613	富瀚微	9,600	768,768.00	0.05
84	603927	中科软	59,700	758,787.00	0.05
85	603053	成都燃气	89,800	750,728.00	0.05
86	600171	上海贝岭	22,500	718,650.00	0.05
87	003039	顺控发展	64,400	709,044.00	0.05
88	600351	亚宝药业	117,200	673,900.00	0.04
89	603068	博通集成	16,300	655,749.00	0.04
90	600717	天津港	164,558	640,130.62	0.04
91	002401	中远海科	54,000	626,940.00	0.04
92	301048	金鹰重工	70,800	609,588.00	0.04
93	603928	兴业股份	40,820	604,136.00	0.04
94	002441	众业达	77,000	600,600.00	0.04
95	300978	东箭科技	71,000	575,810.00	0.04
96	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
97	001399	惠科股份	16,218	551,403.64	0.04
98	300079	数码视讯	125,700	527,940.00	0.03
99	605218	伟时电子	31,231	486,266.67	0.03
100	300447	全信股份	32,000	477,760.00	0.03
101	002444	巨星科技	14,100	438,510.00	0.03
102	603160	汇顶科技	7,000	431,970.00	0.03
103	300012	华测检测	30,700	425,502.00	0.03
104	300822	贝仕达克	32,900	384,930.00	0.02
105	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.02
106	300008	天海防务	55,600	336,936.00	0.02
107	001236	弘业期货	44,800	311,360.00	0.02
108	603268	松发股份	2,200	306,416.00	0.02
109	300299	富春股份	56,100	274,890.00	0.02
110	603508	思维列控	12,800	273,408.00	0.02
111	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
112	002111	威海广泰	29,600	266,400.00	0.02
113	300690	双一科技	11,300	252,442.00	0.02

114	603111	康尼机电	44,500	251,870.00	0.02
115	601089	福元医药	12,700	206,756.00	0.01
116	603013	亚普股份	12,600	198,954.00	0.01
117	001318	阳光乳业	18,000	178,380.00	0.01
118	688809	强一股份	259	161,357.00	0.01
119	300341	麦克奥迪	11,700	155,025.00	0.01
120	600598	北大荒	13,400	145,256.00	0.01
121	300388	节能国祯	22,700	140,059.00	0.01
122	688818	中电科蓝天科技	1,717	120,430.38	0.01
123	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
124	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
125	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
126	688785	恒运昌股份	116	53,725.40	0.00
127	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
128	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
129	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
130	688811	有研金属复材	834	20,124.42	0.00
131	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
132	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
133	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
134	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
135	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
136	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
137	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
138	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
139	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
140	688805	健信超导	265	12,447.05	0.00
141	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
142	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
143	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
144	300898	熊猫乳品	496	8,987.52	0.00
145	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
146	300389	艾比森	400	5,128.00	0.00
147	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
148	300892	品渥食品	227	4,263.06	0.00
149	002138	顺络电子	47	3,435.70	0.00
150	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
151	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
152	603293	埃泰克汽车电子	72	2,442.96	0.00
153	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00

154	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
155	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
156	300887	谱尼测试	138	960.48	0.00
157	600848	上海临港	40	299.60	0.00
158	600874	创业环保	29	155.44	0.00
159	600551	时代出版	16	106.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金 额	占期初基金资产 净值比例（%）
1	300308	中际旭创	18,580,892.00	0.90
2	000807	云铝股份	16,214,724.00	0.79
3	300502	新易盛	16,051,168.00	0.78
4	600183	生益科技	16,017,027.00	0.78
5	002600	领益智造	15,988,997.65	0.78
6	688012	中微半导体设备	15,634,349.68	0.76
7	688256	寒武纪科技	15,395,811.49	0.75
8	600309	万华化学	15,004,195.18	0.73
9	300394	天孚通信	14,148,336.60	0.69
10	688041	海光信息	13,612,271.59	0.66
11	600089	特变电工	13,586,098.00	0.66
12	300476	胜宏科技	13,576,080.00	0.66
13	601318	中国平安	13,545,405.00	0.66
14	300433	蓝思科技	13,270,306.00	0.64
15	600489	中金黄金	13,137,031.00	0.64
16	601600	中国铝业	12,860,539.00	0.63
17	600111	北方稀土	12,559,520.08	0.61
18	601288	农业银行	12,365,552.00	0.60
19	603799	华友钴业	12,336,934.10	0.60
20	601601	中国太保	12,285,868.48	0.60

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	300750	宁德时代	41,794,681.00	2.03
2	600519	贵州茅台	38,196,397.82	1.86
3	300308	中际旭创	28,585,024.41	1.39
4	601318	中国平安	26,519,621.00	1.29
5	300433	蓝思科技	26,491,188.45	1.29
6	601899	紫金矿业	26,290,716.80	1.28
7	300033	同花顺	23,416,162.65	1.14
8	600584	长电科技	22,403,901.94	1.09
9	600036	招商银行	21,823,843.00	1.06
10	300502	新易盛	21,599,387.60	1.05
11	000725	京东方 A	19,973,813.00	0.97
12	000333	美的集团	19,379,136.44	0.94
13	002475	立讯精密	19,359,278.00	0.94
14	603993	洛阳钼业	18,835,090.00	0.92
15	300408	三环集团	18,745,341.00	0.91
16	600150	中国船舶	18,296,003.86	0.89
17	603259	药明康德	17,681,516.24	0.86
18	600989	宝丰能源	16,909,074.00	0.82
19	000100	TCL 科技	16,636,949.00	0.81
20	601166	兴业银行	16,133,384.50	0.78

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,726,017,466.73
卖出股票收入（成交）总额	2,294,647,282.94

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	35,910,905.06	2.32
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	190,646.11	0.01
8	同业存单	—	—

9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	36,101,551.17	2.33

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	019827	26 国债 01	182,000	18,317,970.90	1.18
2	019835	26 国债 09	99,000	9,916,292.96	0.64
3	019792	25 国债 19	64,000	6,467,150.90	0.42
4	019761	24 国债 24	8,000	804,440.11	0.05
5	019785	25 国债 13	4,000	405,050.19	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处

罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	285,659.32
2	应收清算款	1,435,999.58
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,166,962.28
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,888,621.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688368	晶丰明源半导体	4,830,658.79	0.31	非公开发行流通受限
2	000032	深桑达 A	4,563,702.00	0.30	非公开发行流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富沪深 300 指数增强 A	44,003	13,045.55	288,887,320.25	50.33	285,155,991.51	49.67
汇添富沪深 300 指数增强 C	39,102	8,959.55	236,809,531.36	67.59	113,526,943.36	32.41
汇添富沪深 300 指数增强 Y	2,068	4,537.22	0.00	0.00	9,382,967.39	100.00
合计	85,173	10,963.13	525,696,851.61	56.30	408,065,902.26	43.70

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富沪深 300 指数增强 A	878,196.98	0.15
	汇添富沪深 300 指数增强 C	64,503.29	0.02
	汇添富沪深 300 指数增强 Y	263,130.29	2.80
	合计	1,205,830.56	0.13

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富沪深 300 指数增强 A	0~10
	汇添富沪深 300 指数增强 C	0~10
	汇添富沪深 300 指数增强 Y	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富沪深 300 指数增强 A	10~50
	汇添富沪深 300 指数增强 C	0
	汇添富沪深 300 指数增强 Y	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富沪深 300 指数 增强 A	汇添富沪深 300 指数 增强 C	汇添富沪深 300 指数 增强 Y
基金合同生效日 (2020 年 11 月 03 日) 基金份额总额	194,012,600.68	—	—
本报告期期初基金份 额总额	830,687,493.63	474,135,451.60	6,291,357.93
本报告期基金总申购 份额	201,458,897.75	100,001,908.60	5,040,245.23
减：本报告期基金总 赎回份额	458,103,079.62	223,800,885.48	1,948,635.77
本报告期基金拆分变 动份额	—	—	—
本报告期期末基金份 额总额	574,043,311.76	350,336,474.72	9,382,967.39

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。

本报告期内，本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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
方正证券	2	1,177,738,760.74	29.40	207,157.46	29.40	
中信证券	5	693,039,843.33	17.30	121,907.74	17.30	
平安证券	1	658,400,640.02	16.44	115,816.82	16.44	
中信建投证券	4	546,296,744.99	13.64	96,094.47	13.64	
申万宏源证券	3	468,078,357.67	11.69	82,335.30	11.69	
招商证券	4	313,392,322.38	7.82	55,122.15	7.82	

国投证券	2	140,942,076.55	3.52	24,791.98	3.52	
东方证券	2	7,840,189.23	0.20	1,379.17	0.20	
财通证券	2	—	—	—	—	
长江证券	2	—	—	—	—	
大和证券	2	—	—	—	—	
东北证券	1	—	—	—	—	
东吴证券	3	—	—	—	—	
广发证券	3	—	—	—	—	
国金证券	2	—	—	—	—	
国联民生	2	—	—	—	—	
国泰海通	6	—	—	—	—	
华安证券	1	—	—	—	—	
华泰证券	4	—	—	—	—	
华西证券	2	—	—	—	—	
华兴证券	2	—	—	—	—	
摩根大通 证券	2	—	—	—	—	
上海证券	2	—	—	—	—	
太平洋证 券	1	—	—	—	—	
天风证券	2	—	—	—	—	
西部证券	2	—	—	—	—	
野村东方 国际	2	—	—	—	—	
银河证券	2	—	—	—	—	
粤开证券	1	—	—	—	—	
浙商证券	1	—	—	—	—	
中金财富	2	—	—	—	—	
中泰证券	2	—	—	—	—	
中邮证券	2	—	—	—	—	

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额的 比例 (%)		购成交 总额的 比例 (%)		交总额的 比例 (%)		交总额的 比例 (%)
方正证 券	19,193, 007.00	53.76	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	1,501,4 55.00	4.21	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	7,003,4 72.00	19.62	-	-	-	-	-	-
招商证 券	2,902,5 81.00	8.13	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	5,102,5 50.00	14.29	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
大和证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民 生	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

华兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司,租用其交易单元。

(2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限,需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 01 月 06 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 01 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 03 月 06 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 03 月 07 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下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
8	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
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 04 月 30 日
10	2025 年度汇添富基金管理股份有	公司网站	2026 年 04 月 30 日

	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		
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 05 月 01 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 05 月 15 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 05 月 16 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 05 月 27 日
15	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
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,上证报	2026 年 06 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 指数增强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、报告期内汇添富沪深 300 指数增强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 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