

汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
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	19
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
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	20
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1 资产负债表	20
6.2 利润表	22
6.3 净资产变动表	23
6.4 报表附注	24
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	58
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	58

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.....	58
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.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§ 8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	60
§ 9 开放式基金份额变动.....	61
§ 10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	62
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.....	62
10.8 其他重大事件.....	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§ 12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金	
基金简称	汇添富稳荣回报债券发起式	
基金主代码	018763	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 11 月 14 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	172,445,728.18	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富稳荣回报债券发起式 A	汇添富稳荣回报债券发起式 C
下属分级基金的交易代码	018763	018764
报告期末下属分级基金的份 额总额（份）	107,599,661.58	64,846,066.60

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
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，并适度参与股票等权益类资产的投资回报，在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。本基金采取的投资策略主要包括资产配置策略、股票精选策略、存托凭证的投资策略、债券投资策略、可转债及可交换债投资策略及国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债新综合财富（总值）指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的风险与收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	方圆
	联系电话	021-28932888	95559
	电子邮箱	service@99fund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-9918	95559
传真		021-28932998	021-62701216

注册地址	上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200010	200336
法定代表人	鲁伟铭	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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)	
	汇添富稳荣回报债券发起式 A	汇添富稳荣回报债券发起式 C
本期已实现收益	2,457,568.96	2,140,322.04
本期利润	1,979,849.84	1,924,135.10
加权平均基金份额本期利润	0.0166	0.0195
本期加权平均净值利润率	1.46%	1.73%
本期基金份额净值增长率	1.47%	1.26%
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	15,297,489.13	8,441,970.63
期末可供分配基金份额利润	0.1422	0.1302
期末基金资产净值	122,897,150.71	73,288,037.23
期末基金份额净值	1.1422	1.1302
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	14.22%	13.02%

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

汇添富稳荣回报债券发起式 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	1.57%	0.22%	3.67%	0.27%	-2.10%	-0.05%
过去六个 月	1.47%	0.22%	3.93%	0.25%	-2.46%	-0.03%
过去一年	3.78%	0.18%	7.52%	0.22%	-3.74%	-0.04%
自基金合 同生效起 至今	14.22%	0.20%	18.67%	0.23%	-4.45%	-0.03%
汇添富稳荣回报债券发起式 C						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个 月	1.47%	0.22%	3.67%	0.27%	-2.20%	-0.05%
过去六个 月	1.26%	0.21%	3.93%	0.25%	-2.67%	-0.04%
过去一年	3.36%	0.18%	7.52%	0.22%	-4.16%	-0.04%
自基金合 同生效起 至今	13.02%	0.20%	18.67%	0.23%	-5.65%	-0.03%

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

汇添富稳荣回报债券发起式A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富稳荣回报债券发起式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 11 月 14 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年 限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基 金经理	2023 年 11 月 14 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。
徐光	本基金的基金经理	2025 年 12 月 29 日	—	14	国籍：中国。学历：美国伊利诺伊理工学院金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2012 年 12 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任债券交易员、高级债券交易员。2024 年 2 月 2 日至今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助理。2024 年 2 月 2 日至今任汇添富稳丰回报债

					券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2018 年 8 月 21 日至 2024 年 11 月 1 日任汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 8 月 21 日至 2020 年 3 月 23 日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。2018 年 9 月 28 日至 2024 年 11 月 13 日任汇添富高息债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至今任汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至 2020 年 9 月 1 日任汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月 24 日至
--	--	--	--	--	---

					2020 年 3 月 23 日任汇添富丰润中短债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 2 月 22 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富 AAA 级信用纯债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 15 日至 2024 年 11 月 13 日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 30 日至 2022 年 1 月 7 日任汇添富鑫福债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月 9 日至今任汇添富中短债债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 8 日至 2024 年 5 月 9 日任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 25 日至今任汇添
--	--	--	--	--	--

					富稳健添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月 8 日至今任汇添富稳乐回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 19 日至 2026 年 5 月 28 日任汇添富丰泰纯债债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 12 月 29 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。
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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。

债券市场方面，报告期内整体呈现低利率区间震荡走势，资金面平稳宽松，收益率小幅下行，波动率较低。按驱动因素不同，上半年债市主要分为三个阶段。阶段一（年初至 2 月下旬），市场主线为权益风险偏好与机构赎回、配置需求的反复切换，收益率先冲高后回落。阶段二（3 月至 4 月中旬），市场主线转向地缘冲突和输入性通胀预期，长端和超长端一度承压，但同业存款自律管理落地、资金面维持宽松，中短端表现较强，曲线明显陡峭化。阶段三（4 月中旬至 6 月底），内需偏弱、金融数据结构不佳及央行净投放推动收益率震荡下行，6 月后资金利率回升、季末止盈带来阶段性调整，但央行完善短端利率框架稳定了流动性预期，期限利差维持窄幅震荡。品种上看，信用债受益于票息需求和资产荒延续，表现持续优于利率债，信用利差和评级利差低位进一步压缩；超长债相对偏弱。

组合运作方面，资产配置方面，本基金权益资产配置比例相对稳定，接近基准中权益资产的配置比例，保持了“规则化”二级债基的投资定位。权益方面，组合对标中证 800 指数，使用量化选股策略构建组合，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。但上半年市场风格极致分化，组合超配的质量、低估值、低波动风格整体承压，同时组合对科技成长类股票的配置比例不足，权益部分净值收益率落后于业绩比较基准，出现一定的超额回撤。报告期内，组合债券部分久期稳定，小幅提升了信用债占比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富稳荣回报债券发起式 A 类份额净值增长率为 1.47%，同期业绩比较基准收益率为 3.93%。本报告期汇添富稳荣回报债券发起式 C 类份额净值增长率为 1.26%，同期业绩比较基准收益率为 3.93%。

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。

债券市场方面，下半年预计维持低利率、低利差、低波动的窄幅震荡格局，趋势性机会或弱于上半年，波段性和结构性机会的重要性上升。最近一年，基于历史利差周期的均值回归策略效果不佳，底层原因在于宏观背景发生深刻变化；在融资需求偏弱、物价温和的格局发生显著变化之前，收益率向上空间不大；三季度政府债供给放量、财政资金加快落地及经济数据阶段性改善可能形成一定压制，但大幅上行风险有限。央行对资金面的把控力度增强，流动性风险较低，资金面大概率维持均衡偏松。信用债利差已处历史低位，进一步压缩空间

有限，信用债日益呈现利率化特征，需重视流动性和估值波动。债券回归配置思路，票息和骑乘策略优于单纯的久期暴露。

本基金将继续保持规则化二级债基的定位，淡化择时，保持接近基准的权益配置比例，基于量化模型挑选个股，保持风格和行业均衡、个股分散的组合特点，维持清晰和稳定的大盘均衡风格。继续推进模型的迭代优化，提高对市场风格变化的应对能力，提升超额收益的稳定性。债券投资策略方面，久期策略以区间操作为主，市场调整窗口可适度积极，优选高等级、高流动性的优质信用品种，适度参与利率债的波段机会。

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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可根据实际情况进行基金收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、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；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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 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，基金托管人在汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，汇添富基金管理股份有限公司在汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金

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	20,983,680.38	41,304,194.42
结算备付金		207,951.11	2,027,060.44
存出保证金		50,536.85	45,486.58
交易性金融资产	6.4.7.2	198,885,075.24	335,044,231.88
其中：股票投资		37,660,837.15	62,920,408.80

基金投资		-	-
债券投资		161,224,238.09	272,123,823.08
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		186,700.19	-
应收股利		-	-
应收申购款		36,927.85	5,632,916.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		220,350,871.62	384,053,889.55
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		13,877,000.00	50,009,271.26
应付清算款		9,222,728.57	510,685.31
应付赎回款		822,678.68	1,631,855.68
应付管理人报酬		83,388.35	163,397.63
应付托管费		16,677.68	32,679.54
应付销售服务费		25,297.46	86,131.91
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,454.10	7,439.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	110,458.84	212,049.83
负债合计		24,165,683.68	52,653,510.21
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	172,445,728.18	295,934,458.68
未分配利润	6.4.7.9	23,739,459.76	35,465,920.66
净资产合计		196,185,187.94	331,400,379.34
负债和净资产总计		220,350,871.62	384,053,889.55

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 172,445,728.18 份。本基金下属汇添富稳荣回报债券发起式 A 基金份额净值 1.1422 元，基金份额总额 107,599,661.58 份；本基金下

属汇添富稳荣回报债券发起式 C 基金份额净值 1.1302 元，基金份额总额 64,846,066.60 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金

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		5,053,832.06	3,133,735.49
1.利息收入		30,611.21	25,268.17
其中：存款利息收入	6.4.7.10	30,611.21	17,005.03
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		-	8,263.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,715,869.19	2,741,336.28
其中：股票投资收益	6.4.7.11	3,144,281.24	1,297,546.32
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,082,261.14	1,121,614.21
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	489,326.81	322,175.75
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	-693,906.06	366,192.18
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	1,257.72	938.86
减：二、营业总支出		1,149,847.12	609,176.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	616,157.64	262,444.07
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	123,231.52	52,488.82
3. 销售服务费		223,352.05	157,216.16
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		92,158.16	118,681.73
其中：卖出回购金融资产支出		92,158.16	118,681.73
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		5,780.98	1,907.04
8. 其他费用	6.4.7.21	89,166.77	16,439.10

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,903,984.94	2,524,558.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,903,984.94	2,524,558.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,903,984.94	2,524,558.57

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金

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	295,934,458.68	35,465,920.66	331,400,379.34
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	295,934,458.68	35,465,920.66	331,400,379.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-123,488,730.50	-11,726,460.90	-135,215,191.40
（一）、综合收益总额	-	3,903,984.94	3,903,984.94
（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）	-123,488,730.50	-15,630,445.84	-139,119,176.34
其中：1.基金申购款	109,820,104.11	14,445,835.13	124,265,939.24
2.基金赎回款	-233,308,834.61	-30,076,280.97	-263,385,115.58
（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	172,445,728.18	23,739,459.76	196,185,187.94

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	14,368,344.19	1,234,892.48	15,603,236.67
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	14,368,344.19	1,234,892.48	15,603,236.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	94,402,059.67	9,146,700.65	103,548,760.32
（一）、综合收益总额	-	2,524,558.57	2,524,558.57
（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）	94,402,059.67	6,622,142.08	101,024,201.75
其中：1.基金申购款	333,181,551.87	26,205,494.66	359,387,046.53
2.基金赎回款	-238,779,492.20	-19,583,352.58	-258,362,844.78
（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	108,770,403.86	10,381,593.13	119,151,996.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金（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〔2023〕1126 号文《关于准予汇添富稳荣回报债券型发起式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 11 月 14 日生效。首次设立基金募集规模为 78,117,353.12 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 70015647_B08 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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	20,983,680.38
等于：本金	20,983,159.95
加：应计利息	520.43
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	20,983,680.38

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		38,788,236.22	—	37,660,837.15	-1,127,399.07
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	89,167,661.88	917,642.35	89,888,039.18	-197,265.05
	银行间市场	70,510,912.05	550,198.91	71,336,198.91	275,087.95
	其他	—	—	—	—
	合计	159,678,573.93	1,467,841.26	161,224,238.09	77,822.90
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		198,466,810.15	1,467,841.26	198,885,075.24	-1,049,576.17

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	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	36,692.07
其中：交易所市场	36,044.57
银行间市场	647.50
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	110,458.84

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富稳荣回报债券发起式 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	115,027,098.97	115,027,098.97

本期申购	77,942,001.39	77,942,001.39
本期赎回（以“-”号填列）	-85,369,438.78	-85,369,438.78
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	107,599,661.58	107,599,661.58
汇添富稳荣回报债券发起式 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	180,907,359.71	180,907,359.71
本期申购	31,878,102.72	31,878,102.72
本期赎回（以“-”号填列）	-147,939,395.83	-147,939,395.83
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	64,846,066.60	64,846,066.60

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

汇添富稳荣回报债券发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,364,658.85	94,540.05	14,459,198.90
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	14,364,658.85	94,540.05	14,459,198.90
本期利润	2,457,568.96	-477,719.12	1,979,849.84
本期基金份额交易产生的变动数	-1,016,906.58	-124,653.03	-1,141,559.61
其中：基金申购款	10,542,581.27	-85,636.52	10,456,944.75
基金赎回款	-11,559,487.85	-39,016.51	-11,598,504.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,805,321.23	-507,832.10	15,297,489.13
汇添富稳荣回报债券发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,851,660.59	155,061.17	21,006,721.76
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	20,851,660.59	155,061.17	21,006,721.76
本期利润	2,140,322.04	-216,186.94	1,924,135.10
本期基金份额交易产	-14,245,942.25	-242,943.98	-14,488,886.23

生的变动数			
其中：基金申购款	3,958,631.75	30,258.63	3,988,890.38
基金赎回款	-18,204,574.00	-273,202.61	-18,477,776.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,746,040.38	-304,069.75	8,441,970.63

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	28,556.45
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	1,283.73
其他	771.03
合计	30,611.21

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	108,424,966.61
减：卖出股票成本总额	105,132,632.04
减：交易费用	148,053.33
买卖股票差价收入	3,144,281.24

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	2,320,032.98
债券投资收益——买卖债券(债转股及 债券到期兑付) 差价收入	-237,771.84

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	2,082,261.14

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	353,713,031.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	350,937,998.71
减：应计利息总额	3,009,904.70
减：交易费用	2,900.00
买卖债券差价收入	-237,771.84

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	489,326.81
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	489,326.81
----	------------

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	-693,906.06
——股票投资	-1,360,856.85
——债券投资	666,950.79
——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	-693,906.06

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	1,257.72
替代损益	-
其他	-
合计	1,257.72

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	4,959.40
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	24,700.00
银行费用	-
指数使用费	-

登记结算服务费	—
IOPV 计算与发布费	—
持有人大会-公证费	—
持有人大会-律师费	—
开户费	—
上市费	—
或有管理费	—
其他	—
合计	89,166.77

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,基金发起人
交通银行股份有限公司（"交通银行"）	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	-	-	1,828,687.30	1.13

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	100,643,992.33	30.04	23,413,680.31	11.28

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
东方证券	-	-	11,193,000.00	0.83

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	797.20	1.18	-	-

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	616,157.64	262,444.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	245,715.59	111,667.36
应支付基金管理人的净管理费	370,442.05	150,776.71

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5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 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	123,231.52	52,488.82

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5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		
	汇添富稳荣回报债券 发起式 A	汇添富稳荣回报债券 发起式 C	合计
交通银行股份有限公司	-	211,590.89	211,590.89
汇添富基金管理股份有限公司	-	28.32	28.32
合计	-	211,619.21	211,619.21
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		
	汇添富稳荣回报债券 发起式 A	汇添富稳荣回报债券 发起式 C	合计
交通银行股份有限公司	-	156,474.85	156,474.85
汇添富基金管理股份有限公司	-	32.81	32.81
合计	-	156,507.66	156,507.66

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 0.4%。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 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

份额单位：份

汇添富稳荣回报债券发起式 A		
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
基金合同生效日（2023 年 11 月 14 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00

报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	9.29	33.35
汇添富稳荣回报债券发起式 C		
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
基金合同生效日（2023 年 11 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 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
交通银行	20,983,680.38	28,556.45	597,822.02	14,796.17

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
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	12,870	199,999.80	304,246.80	
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
113704	春风转债	2026 年 06 月 11 日	17 个交易日	新债流通受限	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.05	

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	400	208,230.00	351,812.00	

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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 13,877,000.00 元，于 2026 年 07 月 01 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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同责任，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,689,692.99	50,319,942.19
合计	12,689,692.99	50,319,942.19

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、超短期融资券、中央票据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	66,058,415.58	155,726,490.30
AAA 以下	5,247.12	-
未评级	82,470,882.40	66,077,390.59
合计	148,534,545.10	221,803,880.89

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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	20,983,68 0.38	-	-	-	-	-	20,983,68 0.38
结算备付 金	207,951.1 1	-	-	-	-	-	207,951.1 1
存出保证 金	50,536.85	-	-	-	-	-	50,536.85
交易性金 融资产	4,084,516 .82	9,185,966 .25	26,910,99 4.30	104,945,7 96.63	16,096,96 4.09	37,660,83 7.15	198,885,0 75.24
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售 金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算 款	-	-	-	-	-	186,700.1 9	186,700.1 9
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购 款	-	-	-	-	-	36,927.85	36,927.85
递延所得 税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	25,326,68 5.16	9,185,966 .25	26,910,99 4.30	104,945,7 96.63	16,096,96 4.09	37,884,46 5.19	220,350,8 71.62
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	13,877,00 0.00	-	-	-	-	-	13,877,00 0.00
应付清算 款	-	-	-	-	-	9,222,728 .57	9,222,728 .57
应付赎回	-	-	-	-	-	822,678.6	822,678.6

款						8	8
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	83,388.35	83,388.35
应付托管费	-	-	-	-	-	16,677.68	16,677.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-	25,297.46	25,297.46
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	7,454.10	7,454.10
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	110,458.84	110,458.84
负债总计	13,877,000.00	-	-	-	-	10,288,683.68	24,165,683.68
利率敏感度缺口	11,449,685.16	9,185,966.25	26,910,994.30	104,945,796.63	16,096,964.09	27,595,781.51	196,185,187.94
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	41,304,194.42	-	-	-	-	-	41,304,194.42
结算备付金	2,027,060.44	-	-	-	-	-	2,027,060.44
存出保证金	45,486.58	-	-	-	-	-	45,486.58
交易性金融资产	-	5,152,924.66	80,885,013.57	166,980,533.25	19,105,351.60	62,920,408.80	335,044,231.88
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	-	-	-	-	-	5,632,916.23	5,632,916.23
递延所得	-	-	-	-	-	-	-

税资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	43,376,74 1.44	5,152,924 .66	80,885,01 3.57	166,980,5 33.25	19,105,35 1.60	68,553,32 5.03	384,053,8 89.55
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	50,009,27 1.26	-	-	-	-	-	50,009,27 1.26
应付清算款	-	-	-	-	-	510,685.3 1	510,685.3 1
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,631,855 .68	1,631,855 .68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	163,397.6 3	163,397.6 3
应付托管费	-	-	-	-	-	32,679.54	32,679.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-	86,131.91	86,131.91
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	7,439.05	7,439.05
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	212,049.8 3	212,049.8 3
负债总计	50,009,27 1.26	-	-	-	-	2,644,238 .95	52,653,51 0.21
利率敏感度缺口	-6,632,5 29.82	5,152,924 .66	80,885,01 3.57	166,980,5 33.25	19,105,35 1.60	65,909,08 6.08	331,400,3 79.34

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	892,066.61	1,589,988.65
	基准利率增加 25 个基点	-880,313.44	-1,570,586.59

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	37,660,837.15	19.20	62,920,408.80	18.99
交易性金融资产－基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产－债券投资	161,224,238.09	82.18	272,123,823.08	82.11
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	198,885,075.24	101.38	335,044,231.88	101.10
----	----------------	--------	----------------	--------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险,即从长期来看,本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关,且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变; 2.以下分析中,除市场基准发生变动,其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	中证 800 指数上涨 5%	1,633,948.16	2,320,203.81
	中证 800 指数下跌 5%	-1,633,948.16	-2,320,203.81

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	37,009,025.42
第二层次	161,571,803.02

第三层次	304,246.80
合计	198,885,075.24

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	37,660,837.15	17.09
	其中：股票	37,660,837.15	17.09
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	161,224,238.09	73.17
	其中：债券	161,224,238.09	73.17
	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	21,191,631.49	9.62
8	其他各项资产	274,164.89	0.12
9	合计	220,350,871.62	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	53,116.00	0.03
B	采矿业	1,688,726.04	0.86
C	制造业	26,094,041.31	13.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	899,484.00	0.46
E	建筑业	365,874.80	0.19
F	批发和零售业	258,120.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	286,258.00	0.15
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,364,697.00	1.21
J	金融业	4,980,865.00	2.54
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	276,232.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	393,423.00	0.20
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	37,660,837.15	19.20

7.2.2 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	1,100	1,397,000.00	0.71
2	300750	宁德时代	3,200	1,257,632.00	0.64

3	600519	贵州茅台	800	948,392.00	0.48
4	601318	中国平安	15,700	749,518.00	0.38
5	601899	紫金矿业	26,136	657,059.04	0.33
6	002371	北方华创	735	650,151.60	0.33
7	002475	立讯精密	9,000	633,600.00	0.32
8	000333	美的集团	8,100	611,793.00	0.31
9	600030	中信证券	18,800	540,124.00	0.28
10	601166	兴业银行	31,200	516,672.00	0.26
11	603986	兆易创新	600	489,000.00	0.25
12	600036	招商银行	13,600	482,800.00	0.25
13	300502	新易盛	780	473,460.00	0.24
14	002415	海康威视	11,800	403,560.00	0.21
15	601628	中国人寿	11,400	402,990.00	0.21
16	002916	深南电路	800	366,320.00	0.19
17	000792	盐湖股份	12,100	365,299.00	0.19
18	600031	三一重工	20,800	359,424.00	0.18
19	600406	国电南瑞	15,400	351,890.00	0.18
20	688072	拓荆科技	400	351,812.00	0.18
21	688012	中微半导体 设备	747	349,969.50	0.18
22	601601	中国太保	12,200	347,944.00	0.18
23	600900	长江电力	12,800	338,816.00	0.17
24	688041	海光信息	900	333,270.00	0.17
25	600919	江苏银行	30,800	332,024.00	0.17
26	601728	中国电信	61,000	316,590.00	0.16
27	603799	华友钴业	6,500	313,690.00	0.16
28	300476	胜宏科技	900	311,787.00	0.16
29	688002	睿创微纳	2,000	309,380.00	0.16
30	000032	深桑达 A	12,870	304,246.80	0.16
31	688981	中芯国际	1,900	301,758.00	0.15
32	601088	中国神华	7,700	300,608.00	0.15
33	000425	徐工机械	37,100	300,139.00	0.15
34	601138	工业富联	4,100	295,815.00	0.15
35	600309	万华化学	4,300	294,163.00	0.15
36	688728	格科微有限 公司	13,900	292,456.00	0.15
37	002273	水晶光电	8,200	290,936.00	0.15
38	600489	中金黄金	15,400	277,970.00	0.14
39	002241	歌尔股份	11,800	265,854.00	0.14
40	601727	上海电气	37,700	263,900.00	0.13
41	002402	和而泰	10,100	260,883.00	0.13
42	000538	云南白药	5,440	257,692.80	0.13
43	002027	分众传媒	51,400	248,776.00	0.13

44	000807	云铝股份	11,200	247,968.00	0.13
45	600795	国电电力	53,000	247,510.00	0.13
46	300458	全志科技	6,200	244,652.00	0.12
47	300623	捷捷微电	5,300	238,447.00	0.12
48	600660	福耀玻璃	4,700	237,068.00	0.12
49	601877	正泰电器	9,300	233,151.00	0.12
50	600050	中国联通	57,800	231,200.00	0.12
51	002414	高德红外	17,300	229,398.00	0.12
52	002600	领益智造	13,100	227,154.00	0.12
53	000166	申万宏源	51,600	227,040.00	0.12
54	603893	瑞芯微	1,200	226,032.00	0.12
55	600276	恒瑞医药	4,300	223,772.00	0.11
56	600741	华域汽车	14,400	223,488.00	0.11
57	300699	光威复材	7,800	223,470.00	0.11
58	300274	阳光电源	1,400	222,628.00	0.11
59	601360	三六零	25,600	222,464.00	0.11
60	000423	东阿阿胶	4,800	217,728.00	0.11
61	600061	国投资本	33,100	216,805.00	0.11
62	000895	双汇发展	9,600	215,040.00	0.11
63	002065	东华软件	30,100	214,914.00	0.11
64	600887	伊利股份	8,700	208,452.00	0.11
65	601018	宁波港	65,000	204,750.00	0.10
66	603160	汇顶科技	3,300	203,643.00	0.10
67	002338	奥普光电	3,500	200,200.00	0.10
68	688475	萤石网络	7,295	199,518.25	0.10
69	600685	中船防务	7,800	198,432.00	0.10
70	300493	润欣科技	13,300	198,303.00	0.10
71	600132	重庆啤酒	4,700	194,110.00	0.10
72	002152	广电运通	20,600	193,228.00	0.10
73	603858	步长制药	13,100	191,260.00	0.10
74	688128	中国电器研 究院	7,941	188,519.34	0.10
75	300701	森霸传感	19,600	187,572.00	0.10
76	300127	银河磁体	6,700	187,265.00	0.10
77	688008	澜起科技	600	185,940.00	0.09
78	002077	大港股份	9,600	185,184.00	0.09
79	002340	格林美	28,000	185,080.00	0.09
80	002017	东信和平	12,600	184,338.00	0.09
81	300613	富瀚微	2,300	184,184.00	0.09
82	000001	平安银行	18,300	183,915.00	0.09
83	002090	金智科技	20,700	182,988.00	0.09
84	301289	国缆检测	3,800	178,638.00	0.09
85	000045	深纺织 A	16,900	178,126.00	0.09

86	002516	旷达科技	31,100	173,538.00	0.09
87	002690	美亚光电	12,100	173,393.00	0.09
88	603025	大豪科技	12,700	173,228.00	0.09
89	601398	工商银行	24,400	172,508.00	0.09
90	300722	新余国科	7,700	171,710.00	0.09
91	002651	利君股份	23,300	170,323.00	0.09
92	301339	通行宝	16,100	164,703.00	0.08
93	600460	士兰微	3,000	163,980.00	0.08
94	002349	精华制药	26,400	163,944.00	0.08
95	600941	中国移动	1,900	163,647.00	0.08
96	000027	深圳能源	26,000	161,200.00	0.08
97	601998	中信银行	23,000	159,390.00	0.08
98	600690	海尔智家	7,800	159,198.00	0.08
99	301019	宁波色母	8,800	156,904.00	0.08
100	300014	亿纬锂能	2,400	156,072.00	0.08
101	300628	亿联网络	4,600	155,572.00	0.08
102	603259	药明康德	1,200	149,412.00	0.08
103	600171	上海贝岭	4,500	143,730.00	0.07
104	301536	星辰科技	1,100	141,581.00	0.07
105	002602	世纪华通	10,000	141,000.00	0.07
106	603993	洛阳钼业	8,000	140,400.00	0.07
107	000338	潍柴动力	5,100	138,975.00	0.07
108	000683	博源化工	23,600	135,936.00	0.07
109	601766	中国中车	26,100	135,720.00	0.07
110	600884	杉杉股份	10,000	135,500.00	0.07
111	600558	大西洋	27,200	134,368.00	0.07
112	002287	奇正藏药	6,700	126,228.00	0.06
113	300373	扬杰科技	800	125,784.00	0.06
114	300847	中船汉光	9,700	125,518.00	0.06
115	000795	英洛华	14,400	124,560.00	0.06
116	688110	东芯股份	600	122,220.00	0.06
117	300627	华测导航	4,300	122,120.00	0.06
118	002517	恺英网络	7,500	121,875.00	0.06
119	600526	菲达环保	29,500	121,245.00	0.06
120	300414	中光防雷	10,700	117,914.00	0.06
121	600267	海正药业	11,500	116,265.00	0.06
122	601600	中国铝业	14,000	115,080.00	0.06
123	601688	华泰证券	5,500	113,410.00	0.06
124	002493	荣盛石化	10,100	108,575.00	0.06
125	601857	中国石油	12,400	107,632.00	0.05
126	600210	紫江企业	17,300	107,260.00	0.05
127	002384	东山精密	400	104,940.00	0.05
128	600640	国脉文化	10,600	102,502.00	0.05

129	600479	千金药业	11,000	102,300.00	0.05
130	605118	力鼎光电	2,900	101,181.00	0.05
131	688100	威胜信息	3,300	100,947.00	0.05
132	603235	天新药业	4,500	100,125.00	0.05
133	300223	北京君正	400	99,560.00	0.05
134	002444	巨星科技	3,200	99,520.00	0.05
135	002576	通达动力	6,500	91,975.00	0.05
136	002275	桂林三金	7,400	90,206.00	0.05
137	001286	陕西能源	8,800	89,232.00	0.05
138	301223	中荣股份	5,500	88,660.00	0.05
139	000975	山金国际	5,200	88,400.00	0.05
140	601881	中国银河	6,700	84,219.00	0.04
141	601788	光大证券	5,700	82,251.00	0.04
142	003015	日久光电	6,300	82,089.00	0.04
143	688230	芯导科技	1,000	78,810.00	0.04
144	688385	复旦微电	1,100	78,419.00	0.04
145	301359	东南电子	4,900	77,812.00	0.04
146	601326	秦港股份	24,300	76,788.00	0.04
147	601288	农业银行	12,600	76,482.00	0.04
148	603501	豪威集团	800	75,880.00	0.04
149	601211	国泰海通	4,100	74,620.00	0.04
150	002004	华邦健康	17,400	68,382.00	0.03
151	300054	鼎龙股份	600	63,582.00	0.03
152	002593	日上集团	15,900	63,441.00	0.03
153	002049	紫光国微	700	62,125.00	0.03
154	601668	中国建筑	14,200	61,628.00	0.03
155	002463	沪电股份	400	61,120.00	0.03
156	601009	南京银行	6,100	60,329.00	0.03
157	301299	卓创资讯	1,300	57,278.00	0.03
158	601216	君正集团	12,600	56,196.00	0.03
159	605005	合兴股份	3,500	55,335.00	0.03
160	601100	恒立液压	500	53,780.00	0.03
161	600598	北大荒	4,900	53,116.00	0.03
162	600183	生益科技	300	52,020.00	0.03
163	600845	宝信软件	3,000	49,890.00	0.03
164	600150	中国船舶	1,458	49,265.82	0.03
165	601225	陕西煤业	2,300	46,805.00	0.02
166	001218	丽臣实业	2,100	46,326.00	0.02
167	600028	中国石化	10,200	45,492.00	0.02
168	300678	中科信息	1,900	42,560.00	0.02
169	600885	宏发股份	1,200	41,388.00	0.02
170	601995	中金公司	1,100	39,765.00	0.02
171	002532	天山铝业	3,500	37,555.00	0.02

172	603987	康德莱	5,200	35,880.00	0.02
173	002078	太阳纸业	2,800	34,972.00	0.02
174	301508	中机认检	1,500	34,710.00	0.02
175	002236	大华股份	2,100	34,629.00	0.02
176	300512	中亚股份	5,000	34,100.00	0.02
177	600886	国投电力	2,500	33,275.00	0.02
178	600019	宝钢股份	6,000	32,580.00	0.02
179	601058	赛轮轮胎	2,800	32,284.00	0.02
180	601658	邮储银行	6,100	30,073.00	0.02
181	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.02
182	300012	华测检测	2,100	29,106.00	0.01
183	603659	璞泰来	1,000	28,930.00	0.01
184	601229	上海银行	3,200	27,776.00	0.01
185	603648	畅联股份	3,200	27,456.00	0.01
186	603129	春风动力	100	25,580.00	0.01
187	688676	海南金盘智能科技	300	25,392.00	0.01
188	000963	华东医药	900	25,308.00	0.01
189	600372	中航机载	2,300	24,955.00	0.01
190	600499	科达制造	1,800	24,840.00	0.01
191	601898	中煤能源	2,000	24,360.00	0.01
192	601319	中国人保	3,500	23,660.00	0.01
193	300172	中电环保	5,700	23,541.00	0.01
194	600176	中国巨石	300	21,864.00	0.01
195	002953	日丰股份	2,500	21,800.00	0.01
196	600298	安琪酵母	600	21,720.00	0.01
197	002454	松芝股份	3,600	17,208.00	0.01
198	603107	上海汽配	1,400	15,890.00	0.01
199	000650	仁和药业	3,000	15,270.00	0.01
200	000729	燕京啤酒	1,500	15,195.00	0.01
201	000708	中信特钢	1,000	12,620.00	0.01
202	000009	中国宝安	1,900	11,837.00	0.01
203	000513	丽珠集团	400	11,556.00	0.01
204	002130	沃尔核材	600	11,376.00	0.01
205	300115	长盈精密	400	11,176.00	0.01
206	600369	西南证券	2,500	10,050.00	0.01
207	002942	新农股份	700	10,031.00	0.01
208	603288	海天味业	300	9,948.00	0.01
209	601608	中信重工	1,900	9,063.00	0.00
210	002926	华西证券	1,100	8,987.00	0.00
211	603606	东方电缆	200	8,302.00	0.00
212	002032	苏泊尔	200	7,920.00	0.00
213	600801	华新建材	500	7,800.00	0.00

214	000999	华润三九	300	6,747.00	0.00
215	301606	绿联科技	100	6,102.00	0.00
216	600098	广州发展	1,000	5,910.00	0.00
217	002500	山西证券	1,100	5,676.00	0.00
218	600018	上港集团	1,000	4,720.00	0.00
219	603233	大参林	300	4,509.00	0.00
220	600562	国睿科技	200	4,244.00	0.00
221	603111	康尼机电	300	1,698.00	0.00
222	301215	中汽股份	300	1,557.00	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	601600	中国铝业	957,882.00	0.29
2	300750	宁德时代	900,493.00	0.27
3	300502	新易盛	876,542.00	0.26
4	601318	中国平安	843,316.00	0.25
5	601899	紫金矿业	795,032.00	0.24
6	002600	领益智造	735,975.00	0.22
7	600276	恒瑞医药	727,447.00	0.22
8	600036	招商银行	702,670.00	0.21
9	002371	北方华创	699,535.00	0.21
10	000807	云铝股份	694,416.00	0.21
11	601088	中国神华	689,331.00	0.21
12	300033	同花顺	680,797.00	0.21
13	002414	高德红外	644,552.00	0.19
14	300458	全志科技	642,228.00	0.19
15	300274	阳光电源	637,987.00	0.19
16	603799	华友钴业	627,771.00	0.19
17	601138	工业富联	619,954.00	0.19
18	000425	徐工机械	612,942.00	0.18
19	002156	通富微电	585,942.00	0.18
20	300699	光威复材	585,046.00	0.18

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	2,025,723.00	0.61
2	601899	紫金矿业	1,475,779.00	0.45
3	600519	贵州茅台	1,406,802.00	0.42
4	603259	药明康德	1,267,745.05	0.38
5	300033	同花顺	1,225,912.40	0.37
6	603993	洛阳钼业	1,223,801.00	0.37
7	000725	京东方 A	1,128,824.00	0.34
8	300433	蓝思科技	1,126,790.00	0.34
9	601600	中国铝业	1,078,739.00	0.33
10	601318	中国平安	1,065,351.00	0.32
11	601168	西部矿业	1,046,729.00	0.32
12	600036	招商银行	1,040,326.00	0.31
13	000333	美的集团	1,015,753.00	0.31
14	002475	立讯精密	985,982.00	0.30
15	300502	新易盛	956,098.00	0.29
16	000021	深科技	918,614.00	0.28
17	300373	扬杰科技	905,798.00	0.27
18	002056	横店东磁	836,366.00	0.25
19	002156	通富微电	834,317.00	0.25
20	603501	豪威集团	815,027.00	0.25

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	81,233,917.24
卖出股票收入（成交）总额	108,424,966.61

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	27,148,531.54	13.84
2	央行票据	—	—
3	金融债券	10,965,661.64	5.59
	其中：政策性金融债	9,904,876.71	5.05
4	企业债券	61,673,475.59	31.44
5	企业短期融资券	—	—

6	中期票据	61,431,322.20	31.31
7	可转债（可交换债）	5,247.12	0.00
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	161,224,238.09	82.18

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	106,000	10,668,708.33	5.44
2	102380497	23 渝富资本 MTN001(科创票据)	100,000	10,423,216.44	5.31
3	102583018	25 菏泽投资 MTN002	100,000	10,286,136.44	5.24
4	102484172	24 科学广州 MTN003	100,000	10,266,041.10	5.23
5	102380048	23 宜昌高新 MTN001	100,000	10,183,972.60	5.19

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,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。

7.12.2

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	50,536.85
2	应收清算款	186,700.19
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	36,927.85
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	274,164.89

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

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（%）
汇添富稳荣回报债券发起式	2,071	51,955.41	77,101,238.20	71.66	30,498,423.38	28.34

A						
汇添富稳荣回报债券发起式 C	848	76,469.42	0.00	0.00	64,846,066.60	100.00
合计	2,919	59,076.99	77,101,238.20	44.71	95,344,489.98	55.29

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	汇添富稳荣回报债券发起式 A	102,270.69	0.10
	汇添富稳荣回报债券发起式 C	0.00	0.00
	合计	102,270.69	0.06

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	汇添富稳荣回报债券发起式 A	0
	汇添富稳荣回报债券发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富稳荣回报债券发起式 A	10~50
	汇添富稳荣回报债券发起式 C	0
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	5.80	10,000,000.00	5.80	3 年

基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	102,074.51	0.06	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	196.18	0.00	—	—	
合计	10,102,270.69	5.86	10,000,000.00	5.80	

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富稳荣回报债券发起式 A	汇添富稳荣回报债券发起式 C
基金合同生效日（2023 年 11 月 14 日）基金份额总额	34,327,332.34	43,790,020.78
本报告期期初基金份额总额	115,027,098.97	180,907,359.71
本报告期基金总申购份额	77,942,001.39	31,878,102.72
减：本报告期基金总赎回份额	85,369,438.78	147,939,395.83
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	107,599,661.58	64,846,066.60

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。

本报告期内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

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
华福证券	2	165,748,355.44	87.49	72,250.08	88.45	
广发证券	4	6,991,417.97	3.69	2,147.60	2.63	
财通证券	2	4,829,818.13	2.55	2,105.30	2.58	
中信建投证券	2	4,816,216.19	2.54	2,099.43	2.57	

国联民生	2	3,718,685.40	1.96	1,620.87	1.98	
华安证券	2	3,354,390.92	1.77	1,462.26	1.79	
东方证券	2	—	—	—	—	
长江证券	3	—	—	—	—	
国泰海通	2	—	—	—	—	
华金证券	2	—	—	—	—	
华泰证券	2	—	—	—	—	
摩根大通 证券	2	—	—	—	—	
南京证券	1	—	—	—	—	
银河证券	2	—	—	—	—	
招商证券	4	—	—	—	—	
中信证券	3	—	—	—	—	

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
华福证券	225,361,315.71	67.26	322,504,000.00	98.62	—	—	—	—
广发证券	—	—	4,500,000.00	1.38	—	—	—	—
财通证券	—	—	—	—	—	—	—	—
中信建投证券	—	—	—	—	—	—	—	—
国联民生	9,064,530.00	2.71	—	—	—	—	—	—
华安证券	—	—	—	—	—	—	—	—
东方证券	100,643,992.33	30.04	—	—	—	—	—	—

长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 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关于旗下部分基金获配非公开发行业股票的公告	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
3	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
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 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
6	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
7	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
8	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稳荣回报债券型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富稳荣回报债券型发起式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、报告期内汇添富稳荣回报债券型发起式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