

汇添富双享回报债券型证券投资基金 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：华夏银行股份有限公司

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。

基金托管人华夏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.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
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.....	21
§ 5 托管人报告.....	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	21
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	21
6.1 资产负债表.....	21
6.2 利润表.....	23
6.3 净资产变动表.....	24
6.4 报表附注.....	25
§ 7 投资组合报告.....	54
7.1 期末基金资产组合情况.....	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	55
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.....	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	60
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.....	61
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.....	61

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.....	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61
§ 8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
§ 9 开放式基金份额变动.....	64
§ 10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	65
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.....	66
10.8 其他重大事件.....	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§ 12 备查文件目录.....	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富双享回报债券型证券投资基金		
基金简称	汇添富双享回报债券		
基金主代码	012789		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 12 月 23 日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	华夏银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额（份）	16,768,243,408.74		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富双享回报债券 A	汇添富双享回报债券 C	汇添富双享回报债券 D
下属分级基金的交易代码	012789	012790	025410
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	9,469,319,307.16	1,210,120,169.89	6,088,803,931.69

2.2 基金产品说明

投资目标	在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	本基金采取的投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略等。在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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债新综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*5%+恒生指数收益率（经汇率调整）*5%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	华夏银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李鹏	赵伟婧
	联系电话	021-28932888	(010) 85237681
	电子邮箱	service@99fund.com	zhaoweijing@hxb.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95577
传真		021-28932998	(010) 85238680
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005)
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005)
邮政编码		200010	100005
法定代表人		鲁伟铭	杨书剑

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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)		
	汇添富双享回报债券 A	汇添富双享回报债券 C	汇添富双享回报债券 D
本期已实现收益	364,945,450.75	55,420,217.77	181,879,593.99
本期利润	1,092,998,621.81	157,361,890.09	526,782,450.20
加权平均基金份额本期利润	0.0966	0.0768	0.1117
本期加权平均净值利润率	8.14%	6.60%	9.37%
本期基金份额净值增长率	10.43%	10.21%	10.42%
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	599,168,265.43	52,384,790.37	384,524,067.86

期末可供分配基金份额利润	0.0633	0.0433	0.0632
期末基金资产净值	12,100,400,468.53	1,518,544,871.85	7,778,106,823.98
期末基金份额净值	1.2779	1.2549	1.2774
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	27.79%	25.49%	11.52%

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

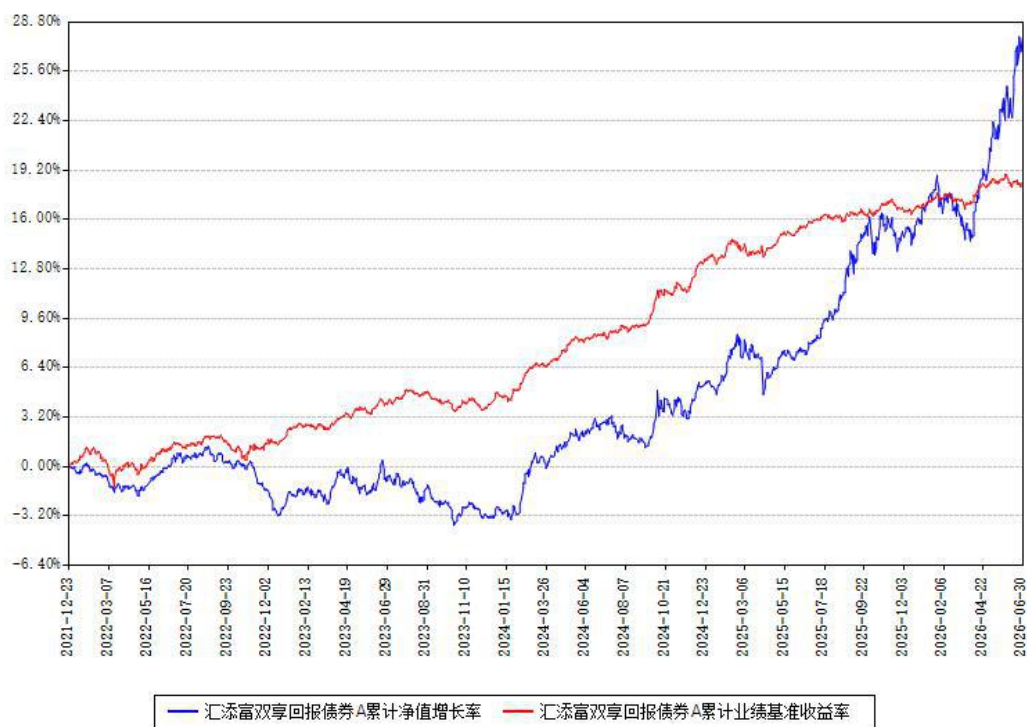
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富双享回报债券 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	11.49%	0.56%	1.14%	0.12%	10.35%	0.44%
过去六个月	10.43%	0.49%	1.40%	0.11%	9.03%	0.38%
过去一年	18.34%	0.44%	2.22%	0.10%	16.12%	0.34%
过去三年	28.63%	0.33%	13.66%	0.11%	14.97%	0.22%
自基金合同生效起至今	27.79%	0.29%	18.34%	0.12%	9.45%	0.17%
汇添富双享回报债券 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	11.38%	0.56%	1.14%	0.12%	10.24%	0.44%

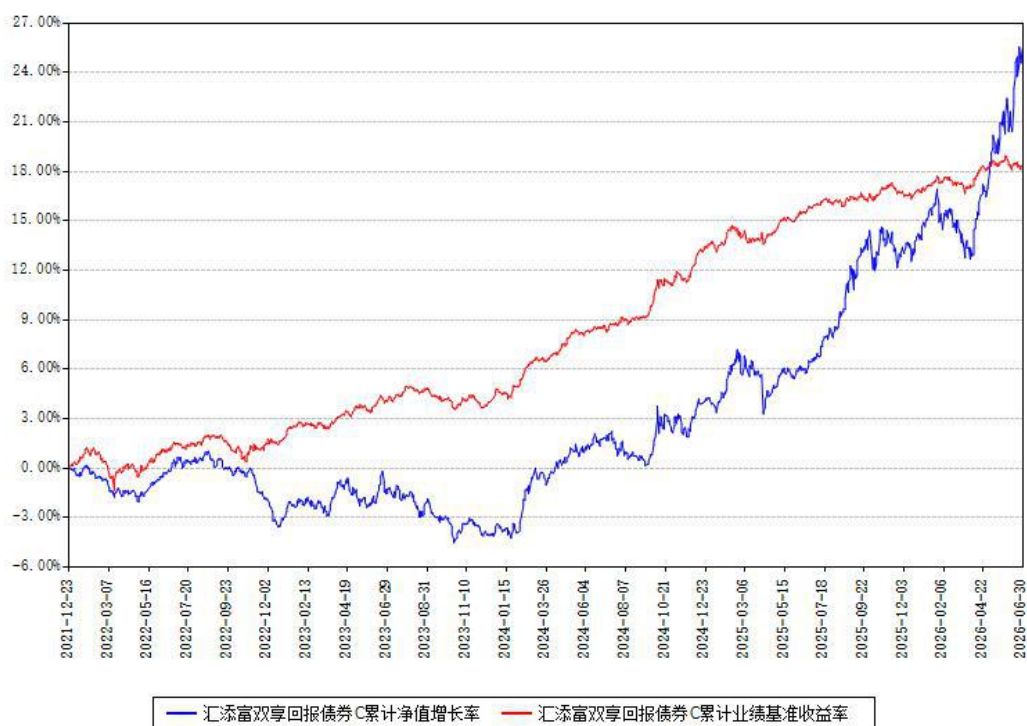
月						
过去六个月	10.21%	0.49%	1.40%	0.11%	8.81%	0.38%
过去一年	17.86%	0.44%	2.22%	0.10%	15.64%	0.34%
过去三年	27.08%	0.33%	13.66%	0.11%	13.42%	0.22%
自基金合同生效起至今	25.49%	0.29%	18.34%	0.12%	7.15%	0.17%
汇添富双享回报债券 D						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	11.48%	0.56%	1.14%	0.12%	10.34%	0.44%
过去六个月	10.42%	0.49%	1.40%	0.11%	9.02%	0.38%
自基金合同生效起至今	11.52%	0.45%	1.65%	0.11%	9.87%	0.34%

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

汇添富双享回报债券A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富双享回报债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富双享回报债券D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（2021 年 12 月 23 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。

本基金于 2025 年 09 月 12 日新增 D 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		
宋鹏	本基金的基 金经理,养老 金投资部总 监	2021 年 12 月 23 日	—	20	国籍：中国。 学历：复旦大学金融工程 硕士。从业资格：证券投资 基金从业资格,特许金融 分析师 CFA。 从业经历： 2006 年 7 月 至 2007 年 10 月任招商基 金固收研究 员，2007 年 11 月至 2011 年 2 月任摩 根大通研究 部策略分析 师，2011 年 2 月至 2019 年 5 月历任平安 资产管理公 司固收投资

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

					汇添富添鑫多元收益9个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023年6月20日至今任汇添富双享增利债券型证券投资基金的基金经理。2023年12月5日至今任汇添富稳鑫90天持有期债券型证券投资基金的基金经理。
丁巍	本基金的基金经理	2021年12月23日	—	14	国籍：中国。学历：华东师范大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格,CPA。从业经历：2012年6月至2015年3月任万家基金管理有限公司研究员，2015年3月至2019年9月任上海海通证券资产管理有限公司投资经理。2019年9月起任汇添富基金管理股份有限公司养老金投资

					部投资经理。2021 年 10 月 11 日至 2026 年 1 月 23 日任汇添富稳健睿享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 20 日至今任汇添富稳鑫 120 天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 23 日至今任汇添富双享回报债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 13 日至今任汇添富 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 1 日至今任汇添富淳享一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 6 日至 2026 年 3 月 20 日任汇添富稳进双盈一年持有期混合
--	--	--	--	--	--

					型证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 5 日至今任汇添富稳鑫 90 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 21 日至今任汇添富中债-市场隐含评级 AA+及以上信用债（1-3 年）指数发起式证券投资基金的基金经理。
王清	本基金的基金经理助理	2023 年 10 月 30 日	-	10	国籍：中国。学历：上海交通大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 7 月至 2017 年 4 月任国金证券固收研究员，2017 年 5 月至 2021 年 2 月任东方证券固定收益分析师。2021 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司任投资经理。2023 年 10 月 30 日至今任汇添富稳鑫 120

					天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 10 月 30 日至今任汇添富淳享一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2023 年 10 月 30 日至 2025 年 12 月 2 日任汇添富 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 10 月 30 日至今任汇添富双享回报债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 10 月 30 日至 2026 年 3 月 20 日任汇添富稳进双盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 10 月 30 日至 2026 年 1 月 21 日任汇添富稳健睿享一年持有期混合型证券投资
--	--	--	--	--	---

					基金的基金 经理助理。 2023 年 12 月 12 日至今任 汇添富稳鑫 90 天持有期 债券型证券 投资基金的 基金经理助 理。2025 年 8 月 19 日至 2025 年 12 月 2 日任汇添富 中债-市场隐 含评级 AA+ 及以上信用 债（1-3 年） 指数发起式 证券投资基金 的基金经 理助理。2025 年 12 月 2 日 至今任汇添 富 90 天滚动 持有短债债 券型证券投 资基金的基 金经理。2025 年 12 月 2 日 至今任汇添 富中债-市场 隐含评级 AA+及以上 信用债（1-3 年）指数发起 式证券投资 基金的基金 经理。2026 年 3 月 20 日 至今任汇添 富稳进双盈 一年持有期 混合型证券 投资基金的
--	--	--	--	--	---

					基金经理。
--	--	--	--	--	-------

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,力争在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种,以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行T检验。对于未通过T检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，债券市场在流动性宽裕的背景下，整体呈现“震荡偏强、信用占优”的格局。具体来看，一季度，债券收益率走势总体下行，长端利率震荡，中短端收益率下行，收益率曲线陡峭化，信用债表现相对较好，信用利差持续压缩；二季度，央行通过货币政策工具灵活调节，呵护资金面平稳，资金利率和波动率均处于偏低水平，为债市运行提供了有利支撑，在流动性总体宽裕的背景下，债券收益率震荡下行。操作方面，组合以配置高等级信用债为主，注重票息的确定性收益，适当运用杠杆，在严控信用风险的前提下精选个券，分散投资。

权益方面，股票市场 A 股在政策呵护、数据回暖背景下年初触底反弹、走出强势行情，随后进入震荡格局。结构上，年初受益于国产模型及机器人产业催化、降息预期及供给约束下有色表现强势，市场明显回暖。3 月中受到美伊冲突、通胀不确定性等因素压制，市场出现波动调整。4 月开始受益于 AI 科技催化，市场情绪回暖指数显著回升。报告期内，本基金对股票仓位进行动态调整；行业配置方面，本基金配置相对均衡；个股方面，主要选择业绩趋势好、长期空间大、估值相对合理的个股进行配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富双享回报债券 A 类份额净值增长率为 10.43%，同期业绩比较基准收益

率为 1.40%。本报告期汇添富双享回报债券 C 类份额净值增长率为 10.21%，同期业绩比较基准收益率为 1.40%。本报告期汇添富双享回报债券 D 类份额净值增长率为 10.42%，同期业绩比较基准收益率为 1.40%。

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 2026 年下半年，经济增长有望保持平稳，央行将实施适度宽松的货币政策，预计流动性在未来一段时间仍将维持合理充裕。债券市场收益率预计将以震荡为主，存在结构性机会。

权益方面，2026 年下半年权益市场预计维持震荡偏强格局、结构分化。我们长期看好中国经济的产业升级、科技创新等产业发展趋势，本基金将在相关产业中围绕有核心竞争优势、业绩增长确定性较高、估值相对合理的个股进行布局。

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任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，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份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富双享回报债券型证券投资基金

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	155,136,245.85	31,329,040.16
结算备付金		86,009,568.29	91,189,563.80
存出保证金		3,516,273.13	1,920,990.88
交易性金融资产	6.4.7.2	24,487,677,129.88	21,820,838,911.44
其中：股票投资		4,319,136,457.51	3,782,513,316.61
基金投资		—	—
债券投资		20,168,540,672.37	18,038,325,594.83

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	43,500,000.00	268,016,210.24
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		50,758,936.80	270,485,504.39
应收股利		708,453.90	1,444,208.00
应收申购款		68,928,716.12	118,392,117.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		24,896,235,323.97	22,603,616,546.53
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		3,270,065,919.74	3,321,299,591.08
应付清算款		201,494,592.60	15,498,423.52
应付赎回款		16,977,884.65	195,577,619.58
应付管理人报酬		4,734,415.86	4,940,902.54
应付托管费		1,578,138.58	1,646,967.51
应付销售服务费		507,699.58	821,110.82
应付投资顾问费		-	-
应交税费		789,249.79	918,297.60
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	3,035,258.81	2,292,105.95
负债合计		3,499,183,159.61	3,542,995,018.60
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	16,768,243,408.74	16,507,630,808.19
未分配利润	6.4.7.9	4,628,808,755.62	2,552,990,719.74
净资产合计		21,397,052,164.36	19,060,621,527.93
负债和净资产总计		24,896,235,323.97	22,603,616,546.53

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 16,768,243,408.74 份。本基金下属汇添富双享回报债券 A 基金份额净值 1.2779 元，基金份额总额 9,469,319,307.16 份；本基金下属汇添富双享回报债券 C 基金份额净值 1.2549 元，基金份额总额 1,210,120,169.89 份；本基金

下属汇添富双享回报债券 D 基金份额净值 1.2774 元，基金份额总额 6,088,803,931.69 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富双享回报债券型证券投资基金

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		1,849,991,862.65	117,149,664.75
1.利息收入		2,655,908.22	744,921.19
其中：存款利息收入	6.4.7.10	609,154.39	232,153.28
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		2,046,753.83	512,767.91
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		671,867,478.21	53,725,984.48
其中：股票投资收益	6.4.7.11	415,793,536.72	-34,756,879.55
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	243,995,388.90	72,866,915.27
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	12,078,552.59	15,615,948.76
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	1,174,897,699.59	60,955,292.94
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	570,776.63	1,723,466.14
减：二、营业总支出		72,848,900.55	20,180,726.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	32,110,231.44	7,935,406.23
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,703,410.43	2,645,135.38
3. 销售服务费		4,811,615.24	2,724,749.42
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		24,498,848.92	6,603,417.56
其中：卖出回购金融资产支出		24,498,848.92	6,603,417.56
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		570,940.65	146,514.01
8. 其他费用	6.4.7.21	153,853.87	125,503.68

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,777,142,962.10	96,968,938.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,777,142,962.10	96,968,938.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,777,142,962.10	96,968,938.47

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富双享回报债券型证券投资基金

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	16,507,630,808.19	2,552,990,719.74	19,060,621,527.93
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	16,507,630,808.19	2,552,990,719.74	19,060,621,527.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	260,612,600.55	2,075,818,035.88	2,336,430,636.43
（一）、综合收益总额	-	1,777,142,962.10	1,777,142,962.10
（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）	260,612,600.55	298,675,073.78	559,287,674.33
其中：1.基金申购款	18,752,835,775.17	3,664,418,461.32	22,417,254,236.49
2.基金赎回款	-18,492,223,174.62	-3,365,743,387.54	-21,857,966,562.16
（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	16,768,243,408.74	4,628,808,755.62	21,397,052,164.36

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	2,123,434,276.10	113,216,994.65	2,236,651,270.75
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2,123,434,276.10	113,216,994.65	2,236,651,270.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,388,398,222.82	457,288,699.65	5,845,686,922.47
（一）、综合收益总额	-	96,968,938.47	96,968,938.47
（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）	5,388,398,222.82	360,319,761.18	5,748,717,984.00
其中：1.基金申购款	8,862,470,393.73	578,383,694.13	9,440,854,087.86
2.基金赎回款	-3,474,072,170.91	-218,063,932.95	-3,692,136,103.86
（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	7,511,832,498.92	570,505,694.30	8,082,338,193.22

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

汇添富双享回报债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委

员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2021〕945号文《关于准予汇添富双享回报债券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2021年12月23日生效。首次设立基金募集规模为226,213,876.20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（2021）验字第60466941_B53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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

自2025年9月12日起，本基金增设D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.境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	155,136,245.85

等于：本金	155,125,136.79
加：应计利息	11,109.06
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	155,136,245.85

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		2,689,330,779.54	—	4,319,136,457.51	1,629,805,677.97
贵金属投资—金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	8,041,387,957.30	74,253,163.40	8,152,543,363.40	36,902,242.70
	银行间市场	11,883,919,632.90	116,725,308.97	12,015,997,308.97	15,352,367.10
	其他	—	—	—	—
	合计	19,925,307,590.20	190,978,472.37	20,168,540,672.37	52,254,609.80
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		22,614,638,369.74	190,978,472.37	24,487,677,129.88	1,682,060,287.77

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	43,500,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	43,500,000.00	—

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	2,936,698.66
其中：交易所市场	2,877,026.17
银行间市场	59,672.49
应付利息	—
应付审计费	29,752.78
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	3,035,258.81

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富双享回报债券 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	11,154,136,542.18	11,154,136,542.18
本期申购	7,146,890,854.14	7,146,890,854.14
本期赎回（以“-”号填列）	-8,831,708,089.16	-8,831,708,089.16
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	9,469,319,307.16	9,469,319,307.16
汇添富双享回报债券 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	2,214,146,221.84	2,214,146,221.84
本期申购	1,539,426,406.17	1,539,426,406.17
本期赎回（以“-”号填列）	-2,543,452,458.12	-2,543,452,458.12
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	1,210,120,169.89	1,210,120,169.89
汇添富双享回报债券 D		
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	3,139,348,044.17	3,139,348,044.17
本期申购	10,066,518,514.86	10,066,518,514.86
本期赎回（以“-”号填列）	-7,117,062,627.34	-7,117,062,627.34
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	6,088,803,931.69	6,088,803,931.69

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

汇添富双享回报债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	297,117,237.39	1,456,212,212.75	1,753,329,450.14
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	297,117,237.39	1,456,212,212.75	1,753,329,450.14
本期利润	364,945,450.75	728,053,171.06	1,092,998,621.81
本期基金份额交易产生的变动数	-62,894,422.71	-152,352,487.87	-215,246,910.58
其中：基金申购款	257,833,260.10	1,103,910,604.62	1,361,743,864.72
基金赎回款	-320,727,682.81	-1,256,263,092.49	-1,576,990,775.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	599,168,265.43	2,031,912,895.94	2,631,081,161.37
汇添富双享回报债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,301,865.65	285,667,081.26	306,968,946.91
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	21,301,865.65	285,667,081.26	306,968,946.91
本期利润	55,420,217.77	101,941,672.32	157,361,890.09
本期基金份额交易产生的变动数	-24,337,293.05	-131,568,841.99	-155,906,135.04
其中：基金申购款	20,470,352.28	224,962,345.01	245,432,697.29
基金赎回款	-44,807,645.33	-356,531,187.00	-401,338,832.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,384,790.37	256,039,911.59	308,424,701.96
汇添富双享回报债券 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	83,386,819.70	409,305,502.99	492,692,322.69
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	83,386,819.70	409,305,502.99	492,692,322.69
本期利润	181,879,593.99	344,902,856.21	526,782,450.20
本期基金份额交易产生的变动数	119,257,654.17	550,570,465.23	669,828,119.40
其中：基金申购款	397,816,055.77	1,659,425,843.54	2,057,241,899.31

基金赎回款	-278,558,401.60	-1,108,855,378.31	-1,387,413,779.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	384,524,067.86	1,304,778,824.43	1,689,302,892.29

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	257,293.68
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	156,395.10
其他	195,465.61
合计	609,154.39

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	7,617,975,029.47
减：卖出股票成本总额	7,189,246,561.13
减：交易费用	12,934,931.62
买卖股票差价收入	415,793,536.72

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	223,695,395.98
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	20,299,992.92
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	243,995,388.90
----	----------------

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	7,624,114,348.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,515,544,554.41
减：应计利息总额	88,051,728.76
减：交易费用	218,072.55
买卖债券差价收入	20,299,992.92

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	12,078,552.59
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	12,078,552.59

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	1,174,897,699.59
——股票投资	1,048,567,198.40
——债券投资	126,330,501.19
——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	1,174,897,699.59

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	570,776.63
替代损益	—
其他	—
合计	570,776.63

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	27,900.00
银行费用	—
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	36,693.72
合计	153,853.87

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
华夏银行股份有限公司 ("华夏银行")	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	14,295,277,533.10	100.00	1,862,710,999.95	80.63

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	4,601,675,761.90	100.00	2,523,403,950.10	92.76

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	62,829,455,000.00	100.00	38,314,196,000.00	87.88

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	6,396,258.22	100.00	2,877,026.17	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	850,711.86	80.76	561,900.83	81.38

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	32,110,231.44	7,935,406.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,174,501.92	984,018.12
应支付基金管理人的净管理费	28,935,729.52	6,951,388.11

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人与基金管理人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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	10,703,410.43	2,645,135.38

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。由基金托管人与基金管理人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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			
	汇添富双享回报 债券 A	汇添富双享回报 债券 C	汇添富双享回报 债券 D	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,914,060.62	-	1,914,060.62
东方证券股份有限公司	-	51.77	-	51.77
华夏银行股份有限公司	-	1,890,420.09	-	1,890,420.09
合计	-	3,804,532.48	-	3,804,532.48
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			
	汇添富双享回报 债券 A	汇添富双享回报 债券 C	汇添富双享回报 债券 D	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	527,316.63	-	527,316.63
东方证券股份有限公司	-	780.17	-	780.17
华夏银行股份有限公司	-	1,486,249.76	-	1,486,249.76
合计	-	2,014,346.56	-	2,014,346.56

注：本基金 A 类、D 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按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.4% 年费率计提。

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。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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

单位：人民币元

本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买 入	基金卖 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
华夏银行股份有限 公司	30,293,2 88.76	10,123,3 17.81	-	-	-	-

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
华夏银行	155,136,245.85	257,293.68	246,195,112.55	119,415.97

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

					-	-	-	-	-	
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
118071	华峰转债	2026年06月24日	17个交易日	新债流通受限	100.00	100.00	2,450	245,000.00	245,004.30	

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	111,000	58,811,938.72	97,627,830.00	

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 3,270,065,919.74 元，于 2026 年 07 月 01 日,2026 年 07 月 02 日,2026 年 07 月 03 日,2026 年 07 月 06 日,2026 年 07 月 07 日,2026 年 07 月 08 日,2026 年 07 月 09 日,2026 年 07 月 10 日,2026 年 07 月 13 日,2026 年 07 月 14 日,2026 年 07 月 15 日,2026 年 07 月 16 日,2026 年 07 月 17 日,2026 年 07 月 20 日,2026 年 07 月 21 日,2026 年 07 月 22 日,2026 年 07 月 23 日,2026 年 07 月 24 日,2026 年 07 月 27 日,2026 年 07 月 28 日,2026 年 07 月 29 日,2026 年 07 月 30 日,2026 年 08 月 03 日,2026 年 08 月 05 日,2026 年 08 月 06 日,2026 年 08 月 10 日,2026 年 08 月 11 日,2026 年 08 月 12 日,2026 年 08 月 13 日,2026 年 08 月 14 日,2026 年 08

月 17 日,2026 年 08 月 18 日,2026 年 08 月 19 日,2026 年 08 月 20 日,2026 年 08 月 21 日,2026 年 08 月 24 日,2026 年 08 月 25 日,2026 年 08 月 26 日,2026 年 08 月 27 日,2026 年 08 月 28 日,2026 年 08 月 31 日,2026 年 09 月 01 日,2026 年 09 月 02 日,2026 年 09 月 03 日,2026 年 09 月 04 日,2026 年 09 月 07 日,2026 年 09 月 08 日,2026 年 09 月 09 日,2026 年 09 月 10 日,2026 年 09 月 11 日,2026 年 09 月 14 日,2026 年 09 月 15 日,2026 年 09 月 16 日,2026 年 09 月 17 日,2026 年 09 月 18 日,2026 年 09 月 21 日,2026 年 09 月 22 日,2026 年 09 月 23 日,2026 年 09 月 24 日,2026 年 09 月 28 日,2026 年 09 月 29 日,2026 年 09 月 30 日,2026 年 10 月 08 日,2026 年 10 月 09 日,2026 年 10 月 12 日,2026 年 10 月 13 日,2026 年 10 月 14 日,2026 年 10 月 15 日,2026 年 10 月 16 日,2026 年 10 月 19 日,2026 年 10 月 20 日,2026 年 10 月 21 日,2026 年 10 月 23 日,2026 年 10 月 27 日,2026 年 10 月 28 日,2026 年 10 月 29 日,2026 年 11 月 04 日,2026 年 11 月 05 日,2026 年 11 月 09 日,2026 年 11 月 11 日,2026 年 11 月 12 日,2026 年 11 月 13 日,2026 年 11 月 16 日,2026 年 11 月 17 日,2026 年 11 月 18 日,2026 年 11 月 19 日,2026 年 11 月 20 日,2026 年 11 月 23 日,2026 年 11 月 24 日,2026 年 11 月 25 日,2026 年 11 月 26 日,2026 年 11 月 27 日,2026 年 11 月 30 日,2026 年 12 月 01 日,2026 年 12 月 02 日,2026 年 12 月 03 日,2026 年 12 月 04 日,2026 年 12 月 07 日,2026 年 12 月 08 日,2026 年 12 月 09 日,2026 年 12 月 10 日,2026 年 12 月 11 日,2026 年 12 月 14 日,2026 年 12 月 15 日,2026 年 12 月 16 日,2026 年 12 月 21 日,2026 年 12 月 22 日,2026 年 12 月 23 日,2026 年 12 月 24 日,2026 年 12 月 25 日,2026 年 12 月 28 日,2026 年 12 月 29 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	331,957,915.08	866,051,675.01
合计	331,957,915.08	866,051,675.01

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	8,116,079,817.72	5,948,131,242.35
AAA 以下	729,140,566.68	1,007,496,117.67
未评级	10,991,362,372.89	10,216,646,559.80
合计	19,836,582,757.29	17,172,273,919.82

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	155,136,245.85	-	-	-	-	-	155,136,245.85
结算备付金	86,009,568.29	-	-	-	-	-	86,009,568.29
存出保证金	3,516,273.13	-	-	-	-	-	3,516,273.13
交易性金融资产	1,129,002,271.30	774,962,260.08	1,686,286,572.64	13,857,357,592.45	2,720,931,975.90	4,319,136,457.51	24,487,677,129.88
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	43,500,000.00	-	-	-	-	-	43,500,000.00
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	50,758,936.80	50,758,936.80
应收股利	-	-	-	-	-	708,453.90	708,453.90
应收申购款	-	-	-	-	-	68,928,716.12	68,928,716.12
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	1,417,164,358.57	774,962,260.08	1,686,286,572.64	13,857,357,592.45	2,720,931,975.90	4,439,532,564.33	24,896,235,323.97
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	1,378,334,003.89	609,504,104.92	1,282,227,810.93	-	-	-	3,270,065,919.74
应付清算款	-	-	-	-	-	201,494,592.60	201,494,592.60
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,977,884.65	16,977,884.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,734,415.86	4,734,415.86
应付托管费	-	-	-	-	-	1,578,138.58	1,578,138.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	507,699.58	507,699.58
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	789,249.79	789,249.79
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	3,035,258.81	3,035,258.81
负债总计	1,378,334,003.89	609,504,104.92	1,282,227,810.93	-	-	229,117,239.87	3,499,183,159.61
利率敏感度缺口	38,830,354.68	165,458,155.16	404,058,761.71	13,857,357,592.45	2,720,931,975.90	4,210,415,324.46	21,397,052,164.36
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	31,329,040.16	-	-	-	-	-	31,329,040.16
结算备付金	91,189,563.80	-	-	-	-	-	91,189,563.80

存出保证金	1,920,990.88	-	-	-	-	-	1,920,990.88
交易性金融资产	998,612,923.14	265,633,513.70	4,990,685,995.30	8,991,255,296.70	2,792,137,865.99	3,782,513,316.61	21,820,838,911.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	268,016,210.24	-	-	-	-	-	268,016,210.24
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	270,485,504.39	270,485,504.39
应收股利	-	-	-	-	-	1,444,208.00	1,444,208.00
应收申购款	-	-	-	-	-	118,392,117.62	118,392,117.62
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,391,068,728.22	265,633,513.70	4,990,685,995.30	8,991,255,296.70	2,792,137,865.99	4,172,835,146.62	22,603,616,546.53
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	2,850,876,260.75	263,711,928.13	206,711,402.20	-	-	-	3,321,299,591.08
应付清算款	-	-	-	-	-	15,498,423.52	15,498,423.52
应付赎回款	-	-	-	-	-	195,577,619.58	195,577,619.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,940,902.54	4,940,902.54
应付托管费	-	-	-	-	-	1,646,967.51	1,646,967.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	821,110.82	821,110.82
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	918,297.60	918,297.60

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,292,105.95	2,292,105.95
负债总计	2,850,876,260.75	263,711,928.13	206,711,402.20	-	-	221,695,427.52	3,542,995,018.60
利率敏感度缺口	-1,459,807,532.53	1,921,585.57	4,783,974,593.10	8,991,255,296.70	2,792,137,865.99	3,951,139,719.10	19,060,621,527.93

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	151,883,352.02	135,161,146.87
	基准利率增加 25 个基点	-148,475,798.11	-131,552,266.39

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	94,320,152.51	-	94,320,152.51
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	-	708,453.90	-	708,453.90
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	95,028,606.41	-	95,028,606.41
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	95,028,606.41	-	95,028,606.41

项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	1,318,384,476.88	-	1,318,384,476.88
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	-	1,444,208.00	-	1,444,208.00
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	1,319,828,684.88	-	1,319,828,684.88
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,319,828,684.88	-	1,319,828,684.88

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1.除汇率以外的其他市场变量保持不变,且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (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
	港币相对人民币升值 5%	4,751,430.32	65,991,434.24
	港币相对人民币贬值 5%	-4,751,430.32	-65,991,434.24

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	4,319,136,457.51	20.19	3,782,513,316.61	19.84
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产－债券投资	20,168,540,672.37	94.26	18,038,325,594.83	94.64
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	24,487,677,129.88	114.44	21,820,838,911.44	114.48

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%	391,779,490.94	300,143,138.26
	沪深 300 指数下跌 5%	-391,779,490.94	-300,143,138.26

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	5,117,915,886.53
第二层次	19,369,761,243.35
第三层次	—
合计	24,487,677,129.88

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	4,319,136,457.51	17.35
	其中：股票	4,319,136,457.51	17.35
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	20,168,540,672.37	81.01
	其中：债券	20,168,540,672.37	81.01
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	43,500,000.00	0.17
	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	241,145,814.14	0.97
8	其他各项资产	123,912,379.95	0.50
9	合计	24,896,235,323.97	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 94,320,152.51 元，占期末净值比例为 0.44%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	53,404,800.00	0.25
C	制造业	3,834,517,645.00	17.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	336,893,860.00	1.57
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	4,224,816,305.00	19.74

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	20,878,691.29	0.10
15 原材料	—	—
20 工业	—	—
25 可选消费	8,600,382.10	0.04
30 日常消费	—	—
35 医疗保健	13,260,152.85	0.06
40 金融	—	—
45 信息技术	46,727,990.00	0.22
50 电信服务	4,852,936.27	0.02
55 公用事业	—	—
60 房地产	—	—
合计	94,320,152.51	0.44

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	300308	中际旭创	448,100	569,087,000.00	2.66
2	300502	新易盛	669,000	406,083,000.00	1.90
3	002008	大族激光	1,575,000	236,423,250.00	1.10
4	688498	源杰科技	119,400	225,188,400.00	1.05
5	300750	宁德时代	452,000	177,640,520.00	0.83
6	688256	寒武纪科技	100,800	160,831,440.00	0.75
7	603986	兆易创新	192,000	156,480,000.00	0.73
8	300408	三环集团	890,000	148,541,000.00	0.69
9	600183	生益科技	800,000	138,720,000.00	0.65
10	002384	东山精密	512,000	134,323,200.00	0.63
11	002484	江海股份	1,265,000	132,825,000.00	0.62
12	300394	天孚通信	435,000	131,665,800.00	0.62
13	688702	盛科通信	258,000	100,617,420.00	0.47
14	688072	拓荆科技	111,000	97,627,830.00	0.46
15	002851	麦格米特	555,000	92,784,900.00	0.43
16	688630	芯碁微装	160,000	87,902,400.00	0.41
17	000636	风华高科	1,070,000	77,296,800.00	0.36

				0	
18	688981	中芯国际	445,000	70,674,900.0 0	0.33
19	600487	亨通光电	500,000	54,670,000.0 0	0.26
20	605376	博迁新材	190,000	51,547,000.0 0	0.24
21	002938	鹏鼎控股	480,000	50,582,400.0 0	0.24
22	688041	海光信息	135,000	49,990,500.0 0	0.23
23	688777	中控技术	420,000	49,350,000.0 0	0.23
24	002138	顺络电子	660,000	48,246,000.0 0	0.23
25	688200	华峰测控	90,000	47,259,000.0 0	0.22
26	300604	长川科技	138,000	47,115,960.0 0	0.22
27	01347	华虹宏力	250,000	46,727,990.0 0	0.22
28	002371	北方华创	52,000	45,997,120.0 0	0.21
29	688008	澜起科技	142,500	44,160,750.0 0	0.21
30	301377	鼎泰高科	80,000	44,072,000.0 0	0.21
31	002353	杰瑞股份	273,000	41,632,500.0 0	0.19
32	002463	沪电股份	260,000	39,728,000.0 0	0.19
33	300285	国瓷材料	385,000	39,724,300.0 0	0.19
34	301511	德福科技	270,000	38,839,500.0 0	0.18
35	002080	中材科技	400,000	36,000,000.0 0	0.17
36	603993	洛阳钼业	1,940,000	34,047,000.0 0	0.16
37	605117	德业股份	290,000	30,792,200.0 0	0.14
38	688627	精智达技术	37,500	26,812,500.0 0	0.13

39	688141	杰华特微电子	170,000	26,095,000.00	0.12
40	688409	富创精密	84,000	25,725,000.00	0.12
41	688249	晶合集成	400,000	23,612,000.00	0.11
42	605358	立昂微	270,000	20,952,000.00	0.10
43	00883	中国海洋石油	1,183,000	20,878,691.29	0.10
44	000338	潍柴动力	750,000	20,437,500.00	0.10
45	688596	正帆科技	255,000	20,160,300.00	0.09
46	601899	紫金矿业	770,000	19,357,800.00	0.09
47	603773	沃格光电	97,000	15,808,090.00	0.07
48	300260	新莱应材	155,000	15,571,300.00	0.07
49	300666	江丰电子	40,000	14,744,000.00	0.07
50	688403	汇成股份	340,000	13,498,000.00	0.06
51	06990	科伦博泰生物	35,000	13,260,152.85	0.06
52	002436	兴森科技	260,000	13,247,000.00	0.06
53	300776	帝尔激光	60,000	12,897,600.00	0.06
54	301611	珂玛科技	60,000	10,804,200.00	0.05
55	09992	泡泡玛特	40,000	5,374,587.40	0.03
56	00700	腾讯控股	13,000	4,852,936.27	0.02
57	002916	深南电路	8,000	3,663,200.00	0.02
58	09988	阿里巴巴 - W	40,000	3,225,794.70	0.02
59	600519	贵州茅台	2,500	2,963,725.00	0.01

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	300750	宁德时代	222,452,810.25	1.17
2	601899	紫金矿业	193,315,968.50	1.01
3	300308	中际旭创	177,299,429.97	0.93
4	00883	中国海洋石油	174,321,765.16	0.91
5	002008	大族激光	167,265,010.90	0.88
6	603993	洛阳钼业	160,561,728.64	0.84
7	00700	腾讯控股	144,907,934.52	0.76
8	300502	新易盛	143,742,069.94	0.75
9	300394	天孚通信	142,042,409.70	0.75
10	002484	江海股份	126,297,495.40	0.66
11	300408	三环集团	113,795,303.63	0.60
12	09988	阿里巴巴 - W	111,795,425.08	0.59
13	000636	风华高科	98,433,942.09	0.52
14	000338	潍柴动力	96,299,405.50	0.51
15	688702	盛科通信	92,969,699.73	0.49
16	600183	生益科技	90,243,239.74	0.47
17	600487	亨通光电	89,307,942.40	0.47
18	000657	中钨高新	86,523,108.00	0.45
19	605117	德业股份	85,335,533.40	0.45
20	002384	东山精密	84,822,954.15	0.45

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	09988	阿里巴巴 - W	367,555,691.37	1.93
2	00700	腾讯控股	352,455,119.66	1.85
3	601899	紫金矿业	319,813,415.18	1.68
4	00883	中国海洋石油	277,080,815.80	1.45
5	603993	洛阳钼业	239,836,825.07	1.26
6	300750	宁德时代	206,482,544.63	1.08
7	00981	中芯国际	134,871,385.88	0.71
7	688981	中芯国际	7,474,041.46	0.04
8	002028	思源电气	141,359,229.51	0.74
9	300308	中际旭创	136,524,062.46	0.72
10	300274	阳光电源	131,924,159.79	0.69
11	002371	北方华创	125,455,200.79	0.66

12	600426	华鲁恒升	122,712,656.81	0.64
13	002353	杰瑞股份	106,531,896.00	0.56
14	603986	兆易创新	101,711,539.12	0.53
15	300502	新易盛	100,415,288.80	0.53
16	06869	长飞光纤光缆	99,599,108.38	0.52
17	01347	华虹宏力	93,602,415.18	0.49
18	601318	中国平安	93,105,969.15	0.49
19	000338	潍柴动力	87,879,916.00	0.46
20	01378	中国宏桥	83,902,520.97	0.44

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	6,677,302,503.63
卖出股票收入（成交）总额	7,617,975,029.47

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	1,024,021,075.88	4.79
2	央行票据	—	—
3	金融债券	4,555,819,461.39	21.29
	其中：政策性金融债	2,295,348,470.98	10.73
4	企业债券	6,840,199,244.16	31.97
5	企业短期融资券	20,326,860.27	0.09
6	中期票据	6,831,521,767.35	31.93
7	可转债（可交换债）	896,652,263.32	4.19
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	20,168,540,672.37	94.26

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	250205	25 国开 05	5,000,000	496,599,726.	2.32

				03	
2	240210	24 国开 10	3,500,000	367,571,917.81	1.72
3	240205	24 国开 05	2,400,000	258,753,008.22	1.21
4	250431	25 农发 31	2,500,000	253,172,739.73	1.18
5	250210	25 国开 10	2,400,000	241,737,205.48	1.13

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:本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

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、中国农业发展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	3,516,273.13
2	应收清算款	50,758,936.80
3	应收股利	708,453.90
4	应收利息	—
5	应收申购款	68,928,716.12
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	123,912,379.95

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	115,526,438.36	0.54
2	113056	重银转债	89,066,080.83	0.42
3	113052	兴业转债	77,108,721.37	0.36
4	127037	银轮转债	53,495,837.26	0.25
5	123158	宙邦转债	41,123,168.22	0.19
6	123176	精测转 2	40,295,835.62	0.19
7	123255	鼎龙转债	39,642,062.19	0.19
8	113677	华懋转债	36,475,347.95	0.17
9	118058	微导转债	34,370,545.81	0.16
10	132026	G 三峡 EB2	28,174,126.68	0.13
11	123241	欧通转债	25,665,946.08	0.12
12	118024	冠宇转债	21,435,466.44	0.10
13	113699	金 25 转债	19,680,111.78	0.09
14	127070	大中转债	19,393,637.19	0.09
15	118059	顾中转债	18,982,865.21	0.09
16	113062	常银转债	18,617,278.81	0.09
17	127030	盛虹转债	18,477,238.36	0.09
18	113697	应流转债	16,956,957.81	0.08
19	118056	路维转债	15,204,086.30	0.07
20	110085	通 22 转债	14,889,488.47	0.07
21	127067	恒逸转 2	13,009,882.19	0.06
22	110090	爱迪转债	12,730,062.47	0.06
23	113046	金田转债	12,671,360.27	0.06
24	127110	广核转债	11,194,201.92	0.05
25	127045	牧原转债	11,149,082.88	0.05
26	118030	睿创转债	9,680,911.23	0.05
27	113049	长汽转债	9,640,984.93	0.05
28	113616	韦尔转债	9,432,440.55	0.04

29	123247	万凯转债	7,656,106.03	0.04
30	113059	福莱转债	7,148,141.92	0.03
31	128136	立讯转债	7,050,102.74	0.03
32	118053	正帆转债	6,534,661.64	0.03
33	118060	瑞可转债	6,070,089.21	0.03
34	118012	微芯转债	5,352,206.11	0.03
35	113652	伟 22 转债	3,857,728.77	0.02
36	127038	国微转债	3,378,529.31	0.02
37	127064	杭氧转债	3,350,372.16	0.02
38	123258	胜蓝转 02	3,155,351.18	0.01
39	118031	天 23 转债	2,426,673.97	0.01
40	123252	银邦转债	2,121,801.37	0.01
41	127089	晶澳转债	1,708,247.01	0.01
42	123250	嘉益转债	1,424,122.85	0.01
43	123133	佩蒂转债	1,082,957.57	0.01

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（%）
汇添富双享回报债券 A	1,830	5,174,491.42	9,306,251,927.87	98.28	163,067,379.29	1.72
汇添富双享回报债券 C	4,342	278,701.10	766,616,042.47	63.35	443,504,127.42	36.65
汇添富双享回报债券 D	298	20,432,227.96	6,087,578,839.70	99.98	1,225,091.99	0.02
合计	6,470	2,591,691.41	16,160,446,810.04	96.38	607,796,598.70	3.62

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	汇添富双享回报债券 A	20,815,256.32	0.22
	汇添富双享回报债券 C	120,566.84	0.01
	汇添富双享回报债券 D	873.06	0.00
	合计	20,936,696.22	0.12

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	汇添富双享回报债券 A	>100
	汇添富双享回报债券 C	0
	汇添富双享回报债券 D	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富双享回报债券 A	>100
	汇添富双享回报债券 C	0
	汇添富双享回报债券 D	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富双享回报债券 A	汇添富双享回报债券 C	汇添富双享回报债券 D
基金合同生效日（2021 年 12 月 23 日）基金份额总额	149,669,178.19	76,544,698.01	—
本报告期期初基金份额总额	11,154,136,542.18	2,214,146,221.84	3,139,348,044.17
本报告期基金总申购份额	7,146,890,854.14	1,539,426,406.17	10,066,518,514.86
减：本报告期基金总赎回份额	8,831,708,089.16	2,543,452,458.12	7,117,062,627.34
本报告期基金拆分变	—	—	—

动份额			
本报告期期末基金份 额总额	9,469,319,307.16	1,210,120,169.89	6,088,803,931.69

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，本基金托管人于 2026 年 3 月 12 日发布公告，朱绍纲先生自 2026 年 3 月 9 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 4 月 21 日发布公告，陈秀良先生自 2026 年 3 月 16 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部总经理。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 6 月 22 日发布公告，赵伟婧女士自 2026 年 6 月 22 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

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，托管人未有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

本报告期内，托管人相关从业人员未有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 (%)	
东方证券	2	14,295,277,533.10	100.00	6,396,258.22	100.00	
国泰海通	3	—	—	—	—	
中信证券	1	—	—	—	—	

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

10.7.2 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 (%)
东方证券	4,601,675,761.90	100.00	62,829,455,000.00	100.00	—	—	—	—

国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
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	关于汇添富双享回报债券型证券投资基金开通同一基金不同类别份额转换业务的公告	证券时报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 16 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调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	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 27 日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金合同	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所	2026 年 06 月 27 日
10	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双享回报债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富双享回报债券型证券投资基金基金合同》；

- 3、《汇添富双享回报债券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、报告期内汇添富双享回报债券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