

汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§ 5 托管人报告.....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 净资产变动表.....	21
6.4 报表附注.....	23
§ 7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
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.....	62
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.....	62

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.....	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§ 8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
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.....	69
§ 12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
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	汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证 A500ETF
场内简称	A500 添富
基金主代码	563880
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 18 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	1,000,996,359.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 11 月 25 日

注：扩位证券简称：A500ETF 汇添富。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	(010) 66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	(010) 66105798
注册地址	上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	鲁伟铭	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	445,658,144.73
本期利润	227,446,377.48
加权平均基金份额本期利润	0.1363
本期加权平均净值利润率	10.60%
本期基金份额净值增长率	12.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	385,634,803.44
期末可供分配基金份额利润	0.3853
期末基金资产净值	1,386,631,162.44
期末基金份额净值	1.3853
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	38.53%

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。

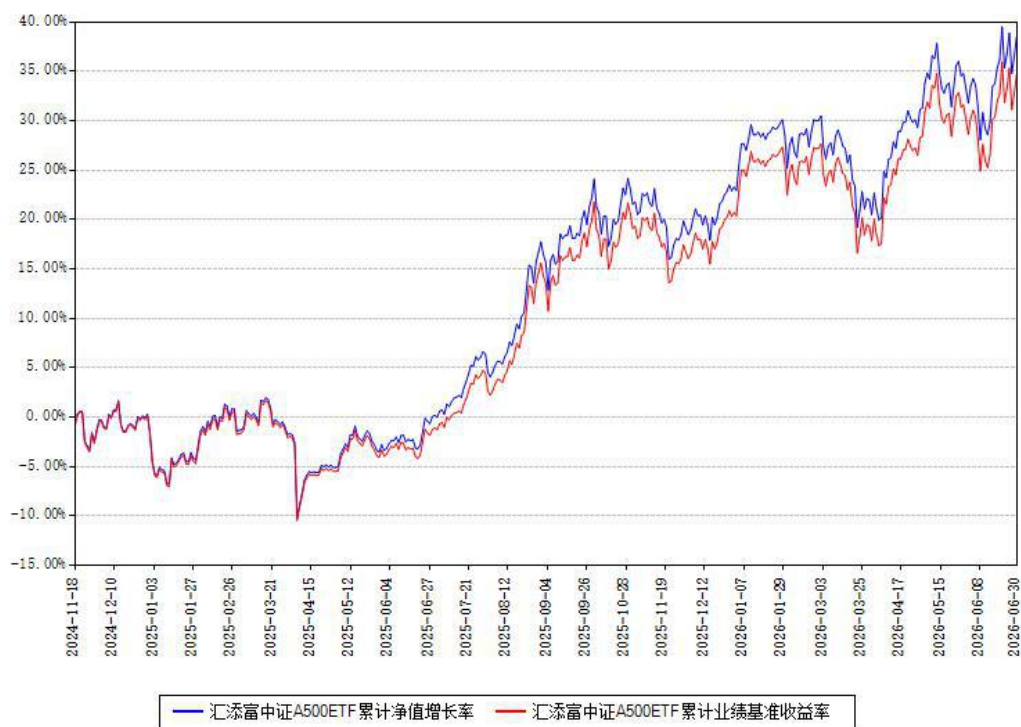
3.2 基金净值表现

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

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	14.94%	1.39%	14.26%	1.41%	0.68%	-0.02%
过去六个 月	12.67%	1.28%	11.91%	1.29%	0.76%	-0.01%
过去一年	38.45%	1.14%	36.38%	1.14%	2.07%	0.00%
自基金合 同生效起 至今	38.53%	1.12%	34.71%	1.12%	3.82%	0.00%

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

汇添富中证A500ETF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（2024 年 11 月 18 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		
孙浩	本基金的基 金经理	2024 年 11 月 18 日	—	6	国籍：中国。 学历：北京大 学金融硕士。 从业资格：证 券投资基 从业资 格,CFA。从业 经历：2020 年 7 月起任 汇添富基金 管理股份有 限公司数量 分析师。2023 年 8 月 29 日 至今任汇添 富中证国企 一带一路交 易型开放式 指数证券投 资基金联接 基金的基金 经理。2023 年 8 月 29 日 至 2026 年 5 月 26 日任中

					证上海国企 交易型开放 式指数证券 投资基金联 接基金的基 金经理。2023 年 8 月 29 日 至 2025 年 3 月 18 日任汇 添富深证 300 交易型开放 式指数证券 投资基金联 接基金的基 金经理。2023 年 8 月 29 日 至 2026 年 6 月 11 日任中 证银行交易 型开放式指 数证券投资 基金联接基 金的基金经 理。2023 年 9 月 28 日至今 任中证长三 角一体化发 展主题交易 型开放式指 数证券投资 基金联接基 金的基金经 理。2023 年 11 月 28 日至 2026 年 5 月 26 日任汇添 富 MSCI 中国 A50 互联互 通交易型开 放式指数证 券投资基金 联接基金的 基金经理。 2023 年 11 月
--	--	--	--	--	--

					28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至 2026 年 6 月 11 日任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 日至 2024 年 12 月 26 日任汇添富上证科
--	--	--	--	--	---

					科创板芯片指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 26 日至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 4 日至 2025 年 8 月 11 日任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 20 日
--	--	--	--	--	--

					至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 7 月 9 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2024 年 11 月 18 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 18 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 27 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 10 月 22 日
--	--	--	--	--	--

					至今任汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月 26 日至今任汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2026 年 5 月 26 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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 A 股整体震荡上行，上证指数累计上涨 3.16%。分行业看，电子、通信、

建材、基础化工板块涨幅领跑；消费者服务、农林牧渔、商贸零售、传媒板块表现垫底。中信一级行业涨跌幅首尾区间差值达 117.37%，市场结构性分化特征突出；风格维度成长风格显著占优，价值板块持续承压。

2026 年作为“十五五”规划开局之年，国内经济在政策红利释放、外部环境日趋复杂的双重背景下，呈现“总量增速边际走缓、行业结构分化持续加深”的运行特征。1—6 月规模以上工业增加值累计同比增长 5.4%，较一季度（1—3 月）6.1%的累计增速回落 0.7 个百分点，工业总量增速逐季走弱。高技术制造业是工业板块中唯一增速持续抬升的领域：一季度增加值累计同比增长 12.5%，上半年进一步升至 13.3%，累计增速提升 0.8 个百分点，产业升级动力充沛。6 月制造业 PMI 为 50.3%，较 5 月 50.0%小幅回升，与 4 月数值持平；指数连续三个月贴近荣枯线 50%，反映制造业仅处于弱修复区间。分项来看，新订单指数偏弱，意味着内需修复根基尚不稳固，企业生产主要依靠存量在手订单支撑。

需求端“三驾马车”走势大幅分化，出口是上半年经济的核心支撑，也是最大亮点。4、5、6 月单月出口同比增速分别达 14.0%、19.3%、27.0%，二季度出口持续高景气；1—6 月全国出口累计同比增长 17.6%，在全球外需整体疲软环境下充分彰显国内供应链韧性。本轮出口高增核心驱动为全球 AI 产业资本开支扩张，拉动国内科技产业链产品外需放量；半导体、通信设备、消费电子等高技术产品出口占比持续提升，出口结构正加速由劳动密集型向技术密集型转型。

消费修复力度持续偏弱。1—6 月社会消费品零售总额累计同比增长 1.3%，较一季度 2.4%的增速再度回落 1.1 个百分点。消费走弱核心原因是 2025 年以旧换新政策提前透支居民消费需求，2026 年上半年消费市场进入需求真空期。后续消费复苏节奏，将取决于居民收入预期改善与房地产市场企稳两大条件。

整体投资端持续承压，房地产投资为主要拖累项。1—6 月全国固定资产投资累计同比下降 5.7%，其中房地产开发投资累计同比下滑 18.0%，降幅较 1—5 月的 16.2%持续走阔。地产行业深度调整仍是压制整体投资的核心因素：虽然部分核心城市二手房量价边际回暖，但新房销售、投资数据依旧走弱，稳地产政策的托底成效尚未充分显现。制造业投资依托高技术产业拉动保持相对稳健，基建投资受益于财政前置发力与“十五五”储备项目落地具备一定韧性，但二者增长力度仍无法对冲地产下行带来的拖累。

物价层面，6 月 CPI 同比上涨 1.0%，上半年 CPI 累计同比约 1.0%，物价保持温和修复。PPI 二季度出现显著边际改善：6 月 PPI 同比升至 4.1%，较 3 月 0.5%大幅上行 3.6 个百分点，

上半年 PPI 累计同比上涨 1.5%。PPI 快速上行，一方面源于中东地缘冲突推高国际油价带来的输入型成本压力，另一方面也佐证制造业内需边际回暖。

宏观基本面变化与 A 股市场走势形成清晰映射：高技术制造业长期高景气叠加政策持续加持，成为上半年市场核心主线，驱动电子、通信等成长赛道大幅走强。PPI 快速上行有望修复中游制造企业盈利预期，叠加“十五五”科技创新、产业升级政策持续落地，持续提升市场对成长板块的风险偏好。反观传统制造、地产产业链，受投资下行、内需疲软制约，基本面修复动力不足，叠加消费复苏不及预期，价值板块整体表现疲软，最终造就市场极致的结构性分化行情。

A500ETF 汇添富及其联接基金跟踪中证 A500 指数。中证 A500 指数作为第三代宽基新旗舰，相较传统宽基指数在编制方法上实现了重大创新，增加了“ESG 评估”、“细分行业龙头优选”和“行业均衡”等创新编制理念，纳入更多新质生产力，更能代表中国经济产业结构升级方向，是权益底仓型配置的优良标的。报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 12.67%，同期业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济结构性分化格局预计延续，A 股市场依旧以结构性机会为主。电子、通信等成长板块上半年累计涨幅较大，当前估值处于相对高位，短期资金博弈或将加剧板块波动；但高技术制造业产业升级中长期逻辑未发生改变，叠加 PPI 上行持续修复中游制造盈利，电子、通信、高端装备等成长赛道仍具备较强配置价值，后续业绩增长有望逐步消化当前高估值。消费、地产链板块则仍需等待内需回暖、稳增长托底政策显效的明确信号。

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：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；基金管理人可每月对基金相对标的指数的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，当收益评价日核定的超额收益率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配；当基金收益分配根据基金相对标的指数的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	11,798,119.37	21,143,151.91
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,380,729,728.87	3,262,181,037.36
其中：股票投资		1,380,659,725.65	3,262,181,037.36
基金投资		-	-
债券投资		70,003.22	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,392,527,848.24	3,283,324,189.27
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,535,566.30	8,396,458.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		172,150.89	439,776.75
应付托管费		57,383.65	146,592.25
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	131,584.95	195,264.00
负债合计		5,896,685.80	9,178,091.00
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,000,996,359.00	2,662,996,359.00
未分配利润	6.4.7.9	385,634,803.44	611,149,739.27
净资产合计		1,386,631,162.44	3,274,146,098.27
负债和净资产总计		1,392,527,848.24	3,283,324,189.27

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3853 元，基金份额总额 1,000,996,359.00 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日 至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		229,681,866.77	106,469,583.47
1.利息收入		14,418.06	26,960.49
其中：存款利息收入	6.4.7.10	14,418.06	26,960.49
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		444,969,642.49	19,356,529.40
其中：股票投资收益	6.4.7.11	430,979,531.62	-55,759,596.46
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3.21	148,560.15
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	13,990,107.66	74,967,565.71
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	-218,211,767.25	89,054,312.22
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	2,909,573.47	-1,968,218.64
减：二、营业总支出		2,235,489.29	7,490,681.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,605,609.49	5,536,555.12
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	535,203.22	1,845,518.31
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	0.37
8. 其他费用	6.4.7.21	94,676.58	108,607.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		227,446,377.48	98,978,902.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		227,446,377.48	98,978,902.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		227,446,377.48	98,978,902.17

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,662,996,359.00	611,149,739.27	3,274,146,098.27
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2,662,996,359.00	611,149,739.27	3,274,146,098.27
三、本期增减变	-1,662,000,000.00	-225,514,935.83	-1,887,514,935.83

动额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	227,446,377.48	227,446,377.48
（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）	-1,662,000,000.00	-452,961,313.31	-2,114,961,313.31
其中：1.基金申购款	213,000,000.00	66,079,044.78	279,079,044.78
2.基金赎回款	-1,875,000,000.00	-519,040,358.09	-2,394,040,358.09
（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	1,000,996,359.00	385,634,803.44	1,386,631,162.44
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	9,289,996,359.00	-138,672,982.36	9,151,323,376.64
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	9,289,996,359.00	-138,672,982.36	9,151,323,376.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,522,000,000.00	142,124,877.42	-3,379,875,122.58
（一）、综合收益总额	-	98,978,902.17	98,978,902.17
（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）	-3,522,000,000.00	43,145,975.25	-3,478,854,024.75
其中：1.基金申购款	2,466,000,000.00	-88,928,653.46	2,377,071,346.54
2.基金赎回款	-5,988,000,000.00	132,074,628.71	-5,855,925,371.29
（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	5,767,996,359.00	3,451,895.06	5,771,448,254.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（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〔2024〕1528 号文《关于准予汇添富中证 A500 交易型开放式指数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。本基金募集期间为 2024 年 11 月 7 日至 2024 年 11 月 13 日，首次募集扣除认购费后的净认购金额为人民币 1,999,996,359.00 元，在募集期间产生的利息为人民币 622,886.49 元，全部归入基金财产，以上有效认购资金合计为人民币 2,000,619,245.49 元，折合 1,999,996,359.00 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（2024）验字第 70015647_B30 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于 2024 年 11 月 18 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露

管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

2. 增值税

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

银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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

3.城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4.企业所得税

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

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

5.个人所得税

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

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

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	7,018,878.75
等于：本金	7,018,609.13
加：应计利息	269.62
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	4,779,240.62
等于：本金	4,779,052.88
加：应计利息	187.74
减：坏账准备	—
合计	11,798,119.37

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,124,187,596.97	—	1,380,659,725.65	256,472,128.68
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	70,000.00	3.22	70,003.22	—

	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	70,000.00	3.22	70,003.22	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,124,257,596.97	3.22	1,380,729,728.87	256,472,128.68

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	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	-
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	-
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	42,324.80
合计	131,584.95

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,662,996,359.00	2,662,996,359.00
本期申购	213,000,000.00	213,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,875,000,000.00	-1,875,000,000.00
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	1,000,996,359.00	1,000,996,359.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	374,708,072.04	236,441,667.23	611,149,739.27
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	374,708,072.04	236,441,667.23	611,149,739.27
本期利润	445,658,144.73	-218,211,767.25	227,446,377.48

本期基金份额交易产生的变动数	-396,830,673.05	-56,130,640.26	-452,961,313.31
其中：基金申购款	71,131,374.48	-5,052,329.70	66,079,044.78
基金赎回款	-467,962,047.53	-51,078,310.56	-519,040,358.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	423,535,543.72	-37,900,740.28	385,634,803.44

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	9,713.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,704.56
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	14,418.06

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	300,011,905.47
股票投资收益——赎回差价收入	130,967,626.15
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	430,979,531.62

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,471,221,461.34
减：卖出股票成本总额	1,169,981,399.32
减：交易费用	1,228,156.55
买卖股票差价收入	300,011,905.47

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

赎回基金份额对价总额	2,394,040,358.09
减：现金支付赎回款总额	1,142,767,992.05
减：赎回股票成本总额	1,120,304,739.89
减：交易费用	—
赎回差价收入	130,967,626.15

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	3.21
债券投资收益——买卖债券(债转股及 债券到期兑付) 差价收入	—
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	3.21

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,990,107.66
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	13,990,107.66

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	-218,211,767.25
——股票投资	-218,211,767.25
——债券投资	-
——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	-218,211,767.25

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	-
替代损益	2,909,573.47
其他	-

合计	2,909,573.47
----	--------------

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	—
银行费用	5,416.43
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	94,676.58

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
中国工商银行股份有限公司 ("工商银行")	基金托管人
东方证券股份有限公司 ("东方证券")	基金管理人的股东
汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

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	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至
----	-------------------------	------------------------------

	2026 年 06 月 30 日	2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,605,609.49	5,536,555.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	111,527.26	537,972.85
应支付基金管理人的净管理费	1,494,082.23	4,998,582.27

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	535,203.22	1,845,518.31

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人

协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: 本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
东方证券股份有限公司	18,205,554.00	1.82	83,600,085.00	3.14
汇添富中证 A500 交易型开 放式指数证券投 资基金联接基金	407,608,100.00	40.72	657,991,600.00	24.71

注:除基金管理人之外的其他关联方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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	7,018,878.75	9,713.50	21,821,486.36	15,773.01

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

于本报告期末，本基金持有基金托管人工商银行发行的股票 1,347,261.00 股，占本基金净值比例为 0.69%。（于上期末，本基金持有基金托管人工商银行发行的股票 8,796,061.00 股，占本基金净值比例为 1.16%。）

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
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	122	6,497.72	7,166.28	
00136	天海	2026	6 个	新股	27.19	31.31	719	19,54	22,51	

5	电子	年 05 月 11 日	月	流通受限				9.61	1.89	
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	396	4,007.52	10,981.08	
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	
301599	理奇智能	2026 年 04 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	43	677.68	2,008.53	
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	113	5,035.28	52,959.71	
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	100.00	700	70,000.00	70,003.22	

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	832.00	2026年07月13日	890.99	8,422	2,423,046.28	7,007,104.00	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

6.4.13.3 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	11,798,119.37	-	-	-	-	-	11,798,119.37
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	70,003.22	-	-	1,380,659,725.65	1,380,729,728.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得	-	-	-	-	-	-	-

税资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,798,119.37	-	70,003.22	-	-	1,380,659,725.65	1,392,527,848.24
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	-	-	-	-	-	5,535,566.30	5,535,566.30
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	172,150.89	172,150.89
应付托管费	-	-	-	-	-	57,383.65	57,383.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.01	0.01
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	131,584.95	131,584.95
负债总计	-	-	-	-	-	5,896,685.80	5,896,685.80
利率敏感度缺口	11,798,119.37	-	70,003.22	-	-	1,374,763,039.85	1,386,631,162.44
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	21,143,151.91	-	-	-	-	-	21,143,151.91
结算备付	-	-	-	-	-	-	-

金							
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,262,181,037.36	3,262,181,037.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	21,143,151.91	-	-	-	-	3,262,181,037.36	3,283,324,189.27
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	-	-	-	-	-	8,396,458.00	8,396,458.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	439,776.75	439,776.75
应付托管费	-	-	-	-	-	146,592.25	146,592.25
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	-	-	-	-	-	195,264.00	195,264.00
负债总计	-	-	-	-	-	9,178,091.00	9,178,091.00
利率敏感度缺口	21,143,151.91	-	-	-	-	3,253,002,946.36	3,274,146,098.27

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产 – 股票投资	1,380,659,725.65	99.57	3,262,181,037.36	99.63
交易性金融资产 – 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 – 债券投资	70,003.22	0.01	-	-
交易性金融资产 – 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产 – 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,380,729,728.	99.57	3,262,181,037.	99.63

	87		36	
--	----	--	----	--

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 A500 上涨 5%	68,863,976.00	163,501,081.02
	中证 A500 下跌 5%	-68,863,976.00	-163,501,081.02

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日
第一层次	1,373,487,322.70
第二层次	7,077,107.22
第三层次	165,298.95

合计	1,380,729,728.87
----	------------------

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	1,380,659,725.65	99.15
	其中：股票	1,380,659,725.65	99.15
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	70,003.22	0.01
	其中：债券	70,003.22	0.01
	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	—	—
	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	11,798,119.37	0.85
8	其他各项资产	—	—
9	合计	1,392,527,848.24	100.00

注：此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”章节的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,352,076.00	0.31
B	采矿业	56,800,890.99	4.10
C	制造业	976,065,016.46	70.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,076,801.15	2.17
E	建筑业	16,815,049.61	1.21
F	批发和零售业	10,615,042.20	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	30,721,856.01	2.22
H	住宿和餐饮业	644,679.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	77,365,953.01	5.58
J	金融业	133,753,920.87	9.65
K	房地产业	7,718,426.00	0.56
L	租赁和商务服务业	9,985,825.20	0.72
M	科学研究和技术服务业	16,501,437.00	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	2,368,121.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	462,240.00	0.03
Q	卫生和社会工作	2,698,411.20	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,058,735.00	0.08
S	综合	2,490,880.00	0.18
	合计	1,380,495,360.70	99.56

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	165,298.95	0.01
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	—	—
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	165,298.95	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	46,540	59,105,800.00	4.26
2	300750	宁德时代	110,212	43,314,418.12	3.12
3	300502	新易盛	58,008	35,210,856.00	2.54
4	600519	贵州茅台	26,007	30,831,038.43	2.22
5	603986	兆易创新	27,800	22,657,000.00	1.63
6	601318	中国平安	444,000	21,196,560.00	1.53
7	688256	寒武纪科技	13,164	21,003,820.20	1.51

8	600036	招商银行	515,400	18,296,700.0 0	1.32
9	601899	紫金矿业	686,300	17,253,582.0 0	1.24
10	002371	北方华创	17,952	15,879,621.1 2	1.15
11	000333	美的集团	202,474	15,292,861.2 2	1.10
12	002475	立讯精密	212,500	14,960,000.0 0	1.08
13	688008	澜起科技	47,640	14,763,636.0 0	1.06
14	688012	中微半导体 设备	31,011	14,528,653.5 0	1.05
15	688041	海光信息	38,560	14,278,768.0 0	1.03
16	002384	东山精密	53,300	13,983,255.0 0	1.01
17	600900	长江电力	509,525	13,487,126.7 5	0.97
18	688981	中芯国际	84,850	13,475,877.0 0	0.97
19	000725	京东方 A	1,513,800	13,139,784.0 0	0.95
20	603259	药明康德	103,000	12,824,530.0 0	0.92
21	600030	中信证券	406,500	11,678,745.0 0	0.84
22	601166	兴业银行	705,100	11,676,456.0 0	0.84
23	300059	东方财富	527,100	10,742,298.0 0	0.77
24	600183	生益科技	60,700	10,525,380.0 0	0.76
25	600276	恒瑞医药	185,848	9,671,529.92	0.70
26	300274	阳光电源	60,425	9,608,783.50	0.69
27	601398	工商银行	1,347,261	9,525,135.27	0.69
28	300408	三环集团	55,800	9,313,020.00	0.67
29	002594	比亚迪	113,200	9,022,040.00	0.65
30	600487	亨通光电	82,300	8,998,682.00	0.65
31	300476	胜宏科技	25,350	8,782,000.50	0.63
32	601211	国泰海通	470,600	8,564,920.00	0.62
33	002463	沪电股份	56,000	8,556,800.00	0.62

34	300394	天孚通信	27,231	8,242,279.08	0.59
35	688498	源杰科技	4,200	7,921,200.00	0.57
36	688525	佰维存储	15,809	7,821,186.57	0.56
37	000988	华工科技	41,900	7,735,159.00	0.56
38	301308	江波龙	10,600	7,460,280.00	0.54
39	600176	中国巨石	100,000	7,288,000.00	0.53
40	601288	农业银行	1,195,500	7,256,685.00	0.52
41	601328	交通银行	1,111,000	7,143,730.00	0.52
42	688072	拓荆科技	8,422	7,007,104.00	0.51
43	000651	格力电器	186,500	6,993,750.00	0.50
44	600522	中天科技	113,800	6,905,384.00	0.50
45	688521	芯原微电子	17,630	6,543,198.20	0.47
46	603019	中科曙光	60,900	6,530,307.00	0.47
47	603993	洛阳钼业	363,600	6,381,180.00	0.46
48	600150	中国船舶	187,944	6,350,627.76	0.46
49	600887	伊利股份	263,200	6,306,272.00	0.45
50	300604	长川科技	18,400	6,282,128.00	0.45
51	600584	长电科技	59,600	6,171,580.00	0.45
52	000338	潍柴动力	223,800	6,098,550.00	0.44
53	000858	五 粮 液	80,890	5,985,860.00	0.43
54	688347	华虹宏力半 导体	17,086	5,746,021.80	0.41
55	601816	京沪高铁	1,222,517	5,538,002.01	0.40
56	600309	万华化学	78,300	5,356,503.00	0.39
57	688120	华海清科	16,585	5,343,355.30	0.39
58	300124	汇川技术	79,000	5,240,070.00	0.38
59	002916	深南电路	11,430	5,233,797.00	0.38
60	002415	海康威视	152,600	5,218,920.00	0.38
61	002281	光迅科技	20,100	5,164,494.00	0.37
62	002008	大族激光	34,300	5,148,773.00	0.37
63	600111	北方稀土	105,400	5,064,470.00	0.37
64	000100	TCL 科技	866,300	5,041,866.00	0.36
65	000063	中兴通讯	134,200	4,856,698.00	0.35
66	300857	协创数据	14,200	4,826,580.00	0.35
67	300136	信维通信	40,300	4,805,775.00	0.35
68	600000	浦发银行	554,760	4,776,483.60	0.34
69	600089	特变电工	210,470	4,735,575.00	0.34
70	601857	中国石油	539,500	4,682,860.00	0.34
71	002028	思源电气	25,900	4,480,700.00	0.32
72	601088	中国神华	114,451	4,468,167.04	0.32
73	300433	蓝思科技	82,800	4,443,048.00	0.32
74	600031	三一重工	247,100	4,269,888.00	0.31
75	300014	亿纬锂能	63,300	4,116,399.00	0.30

76	002050	三花智控	93,200	4,084,956.00	0.29
77	300475	香农芯创	13,600	4,080,000.00	0.29
78	601601	中国太保	142,600	4,066,952.00	0.29
79	000001	平安银行	404,100	4,061,205.00	0.29
80	000792	盐湖股份	132,200	3,991,118.00	0.29
81	300223	北京君正	16,000	3,982,400.00	0.29
82	002714	牧原股份	113,800	3,981,862.00	0.29
83	600549	厦门钨业	46,400	3,953,280.00	0.29
84	002353	杰瑞股份	25,499	3,888,597.50	0.28
85	002156	通富微电	50,500	3,831,435.00	0.28
86	600406	国电南瑞	167,300	3,822,805.00	0.28
87	601668	中国建筑	860,400	3,734,136.00	0.27
88	000657	中钨高新	38,000	3,637,360.00	0.26
89	002436	兴森科技	70,800	3,607,260.00	0.26
90	002602	世纪华通	245,600	3,462,960.00	0.25
91	601919	中远海控	260,600	3,455,556.00	0.25
92	300760	迈瑞医疗	25,200	3,422,916.00	0.25
93	601988	中国银行	596,200	3,410,264.00	0.25
94	600660	福耀玻璃	66,700	3,364,348.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	31,700	3,359,249.00	0.24
96	601728	中国电信	646,700	3,356,373.00	0.24
97	603501	豪威集团	35,300	3,348,205.00	0.24
98	601012	隆基绿能	252,437	3,311,973.44	0.24
99	601225	陕西煤业	161,500	3,286,525.00	0.24
100	002230	科大讯飞	80,100	3,271,284.00	0.24
101	600941	中国移动	37,500	3,229,875.00	0.23
102	600690	海尔智家	156,200	3,188,042.00	0.23
103	002352	顺丰控股	99,900	3,122,874.00	0.23
104	601985	中国核电	342,700	3,094,581.00	0.22
105	002460	赣锋锂业	47,100	3,080,340.00	0.22
106	688777	中控技术	26,123	3,069,452.50	0.22
107	002709	天赐材料	59,400	3,054,942.00	0.22
108	603799	华友钴业	63,200	3,050,032.00	0.22
109	002938	鹏鼎控股	28,900	3,045,482.00	0.22
110	300757	罗博特科	4,900	3,033,100.00	0.22
111	000977	浪潮信息	42,900	3,003,000.00	0.22
112	300033	同花顺	12,420	2,993,220.00	0.22
113	600160	巨化股份	56,198	2,979,055.98	0.21
114	300442	润泽科技	34,200	2,840,994.00	0.20
115	002851	麦格米特	16,819	2,811,800.42	0.20
116	000425	徐工机械	341,500	2,762,735.00	0.20
117	000938	紫光股份	95,300	2,750,358.00	0.20
118	002202	金风科技	115,000	2,748,500.00	0.20

119	688126	上海硅产业集团	68,853	2,746,546.17	0.20
120	601600	中国铝业	330,074	2,713,208.28	0.20
121	600028	中国石化	606,900	2,706,774.00	0.20
122	600938	中国海油	99,597	2,704,058.55	0.20
123	300346	南大光电	28,760	2,664,614.00	0.19
124	600460	士兰微	48,600	2,656,476.00	0.19
125	002466	天齐锂业	43,100	2,642,892.00	0.19
126	002600	领益智造	152,100	2,637,414.00	0.19
127	601766	中国中车	506,600	2,634,320.00	0.19
128	300567	精测电子	8,200	2,604,320.00	0.19
129	600050	中国联通	650,900	2,603,600.00	0.19
130	300661	圣邦股份	17,958	2,576,613.84	0.19
131	002837	英维克	31,810	2,530,803.60	0.18
132	002049	紫光国微	28,300	2,511,625.00	0.18
133	002080	中材科技	27,900	2,511,000.00	0.18
134	002407	多氟多	49,700	2,496,431.00	0.18
135	002185	华天科技	110,800	2,471,948.00	0.18
136	002138	顺络电子	33,600	2,456,160.00	0.18
137	601628	中国人寿	69,400	2,453,290.00	0.18
138	002179	中航光电	52,800	2,439,360.00	0.18
139	688002	睿创微纳	15,754	2,436,986.26	0.18
140	601100	恒立液压	22,300	2,398,588.00	0.17
141	000568	泸州老窖	30,600	2,372,112.00	0.17
142	601872	招商轮船	134,500	2,363,165.00	0.17
143	600879	航天电子	110,025	2,342,432.25	0.17
144	002241	歌尔股份	103,500	2,331,855.00	0.17
145	300395	菲利华	17,391	2,325,698.43	0.17
146	603288	海天味业	69,495	2,304,454.20	0.17
147	601006	大秦铁路	496,300	2,287,943.00	0.17
148	000408	藏格矿业	32,700	2,266,764.00	0.16
149	601658	邮储银行	459,200	2,263,856.00	0.16
150	300390	天华新能	24,200	2,262,942.00	0.16
151	605117	德业股份	21,104	2,240,822.72	0.16
152	688017	绿的谐波	5,362	2,240,565.32	0.16
153	688469	芯联集成	209,504	2,222,837.44	0.16
154	600905	三峡能源	595,300	2,208,563.00	0.16
155	601888	中国中免	40,700	2,185,997.00	0.16
156	600489	中金黄金	121,100	2,185,855.00	0.16
157	002625	光启技术	71,800	2,176,976.00	0.16
158	688396	华润微电子	22,263	2,171,755.65	0.16
159	000630	铜陵有色	335,100	2,131,236.00	0.15
160	600893	航发动力	55,400	2,124,036.00	0.15

161	600673	东阳光	62,600	2,102,108.00	0.15
162	600010	包钢股份	941,800	2,100,214.00	0.15
163	688271	联影医疗	20,721	2,097,586.83	0.15
164	601127	赛力斯	34,000	2,082,500.00	0.15
165	688111	金山办公	9,709	2,068,502.45	0.15
166	300058	蓝色光标	149,620	2,058,771.20	0.15
167	002273	水晶光电	57,900	2,054,292.00	0.15
168	601689	拓普集团	36,200	2,042,404.00	0.15
169	002027	分众传媒	421,000	2,037,640.00	0.15
170	300037	新宙邦	21,897	2,033,136.45	0.15
171	600118	中国卫星	24,600	2,018,430.00	0.15
172	300751	迈为股份	7,000	1,977,220.00	0.14
173	600019	宝钢股份	362,800	1,970,004.00	0.14
174	000426	兴业银锡	59,100	1,947,936.00	0.14
175	600760	中航沈飞	47,300	1,944,030.00	0.14
176	000807	云铝股份	86,600	1,917,324.00	0.14
177	601168	西部矿业	69,500	1,886,230.00	0.14
178	600362	江西铜业	43,300	1,874,890.00	0.14
179	600104	上汽集团	191,400	1,868,064.00	0.13
180	600989	宝丰能源	91,525	1,860,703.25	0.13
181	300450	先导智能	45,683	1,860,211.76	0.13
182	601727	上海电气	262,700	1,838,900.00	0.13
183	600875	东方电气	63,500	1,826,895.00	0.13
184	688099	晶晨半导体	17,739	1,825,343.10	0.13
185	600988	赤峰黄金	69,300	1,823,976.00	0.13
186	002001	新 和 成	64,000	1,818,880.00	0.13
187	605589	圣泉集团	28,200	1,792,674.00	0.13
188	002422	科伦药业	46,500	1,791,180.00	0.13
189	601390	中国中铁	426,400	1,778,088.00	0.13
190	600667	太极实业	60,900	1,777,062.00	0.13
191	600885	宏发股份	51,520	1,776,924.80	0.13
192	002738	中矿资源	30,000	1,769,700.00	0.13
193	000538	云南白药	37,140	1,759,321.80	0.13
194	000960	锡业股份	41,200	1,758,828.00	0.13
195	002126	银轮股份	35,300	1,757,940.00	0.13
196	600547	山东黄金	75,340	1,739,600.60	0.13
197	600392	盛和资源	58,300	1,735,591.00	0.13
198	600795	国电电力	371,400	1,734,438.00	0.13
199	000831	中国稀土	30,900	1,714,641.00	0.12
200	600418	江淮汽车	65,700	1,697,031.00	0.12
201	600585	海螺水泥	99,900	1,693,305.00	0.12
202	601669	中国电建	358,700	1,685,890.00	0.12
203	002648	卫星化学	70,200	1,648,998.00	0.12

204	600141	兴发集团	35,000	1,643,950.00	0.12
205	300316	晶盛机电	27,200	1,642,880.00	0.12
206	002812	恩捷股份	24,500	1,639,295.00	0.12
207	002129	TCL 中环	134,700	1,619,094.00	0.12
208	600096	云天化	53,100	1,614,240.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	194,200	1,604,092.00	0.12
210	601179	中国西电	106,800	1,593,456.00	0.11
211	301358	湖南裕能	21,000	1,593,270.00	0.11
212	300782	卓胜微	14,300	1,566,994.00	0.11
213	600346	恒力石化	87,892	1,556,567.32	0.11
214	601868	中国能建	582,600	1,555,542.00	0.11
215	600482	中国动力	47,300	1,551,440.00	0.11
216	002195	岩山科技	236,200	1,544,748.00	0.11
217	000066	中国长城	80,700	1,537,335.00	0.11
218	600497	驰宏锌锗	125,912	1,524,794.32	0.11
219	002558	巨人网络	55,300	1,524,068.00	0.11
220	300418	昆仑万维	37,500	1,513,500.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	45,600	1,509,360.00	0.11
222	600066	宇通客车	55,300	1,482,593.00	0.11
223	000625	长安汽车	206,700	1,482,039.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	61,600	1,473,472.00	0.11
225	600157	永泰能源	908,700	1,463,007.00	0.11
226	002532	天山铝业	134,900	1,447,477.00	0.10
227	000157	中联重科	206,900	1,442,093.00	0.10
228	600895	张江高科	38,700	1,441,575.00	0.10
229	600221	海航控股	1,064,300	1,436,805.00	0.10
230	688036	传音控股	24,120	1,421,874.00	0.10
231	600711	盛屯矿业	128,700	1,411,839.00	0.10
232	002340	格林美	212,530	1,404,823.30	0.10
233	605499	东鹏饮料	11,340	1,399,696.20	0.10
234	000933	神火股份	65,600	1,390,720.00	0.10
235	600011	华能国际	183,100	1,389,729.00	0.10
236	600048	保利发展	299,100	1,384,833.00	0.10
237	300803	指南针	15,100	1,384,217.00	0.10
238	600143	金发科技	89,000	1,375,050.00	0.10
239	600438	通威股份	112,600	1,363,586.00	0.10
240	002821	凯莱英	8,400	1,360,800.00	0.10
241	600436	片仔癀	12,400	1,355,072.00	0.10
242	300017	网宿科技	104,000	1,353,040.00	0.10
243	600115	中国东航	354,400	1,350,264.00	0.10
244	002236	大华股份	81,800	1,348,882.00	0.10
245	002493	荣盛石化	124,800	1,341,600.00	0.10
246	002131	利欧股份	282,100	1,339,975.00	0.10

247	600570	恒生电子	63,100	1,337,089.00	0.10
248	600886	国投电力	100,000	1,331,000.00	0.10
249	002456	欧菲光	139,900	1,323,454.00	0.10
250	600352	浙江龙盛	108,400	1,312,724.00	0.09
251	603659	璞泰来	44,595	1,290,133.35	0.09
252	688047	龙芯中科	8,333	1,288,865.11	0.09
253	601233	桐昆股份	59,400	1,286,010.00	0.09
254	003816	中国广核	327,600	1,280,916.00	0.09
255	300339	润和软件	33,200	1,278,532.00	0.09
256	601360	三六零	145,800	1,267,002.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	109,600	1,263,688.00	0.09
258	688213	思特威电子科技	11,786	1,261,927.02	0.09
259	000301	东方盛虹	110,200	1,261,790.00	0.09
260	300759	康龙化成	43,100	1,246,883.00	0.09
261	600026	中远海能	69,500	1,246,830.00	0.09
262	002074	国轩高科	45,200	1,243,452.00	0.09
263	688578	艾力斯医药科技	11,291	1,232,977.20	0.09
264	002555	三七互娱	64,500	1,217,115.00	0.09
265	688235	百济神州	4,766	1,213,471.26	0.09
266	300438	鹏辉能源	14,600	1,209,610.00	0.09
267	688122	西部超导	19,057	1,196,970.17	0.09
268	600009	上海机场	51,700	1,194,270.00	0.09
269	600196	复星医药	52,900	1,188,663.00	0.09
270	000768	中航西飞	57,800	1,183,744.00	0.09
271	000975	山金国际	69,300	1,178,100.00	0.08
272	601111	中国国航	194,100	1,174,305.00	0.08
273	002472	双环传动	28,244	1,172,408.44	0.08
274	300207	欣旺达	61,500	1,167,885.00	0.08
275	300001	特锐德	30,800	1,165,164.00	0.08
276	600029	南方航空	224,500	1,162,910.00	0.08
277	600415	小商品城	114,300	1,161,288.00	0.08
278	002517	恺英网络	71,200	1,157,000.00	0.08
279	600674	川投能源	81,300	1,152,021.00	0.08
280	603129	春风动力	4,500	1,151,100.00	0.08
281	002601	龙佰集团	69,500	1,145,360.00	0.08
282	600219	南山铝业	286,900	1,144,731.00	0.08
283	300458	全志科技	28,900	1,140,394.00	0.08
284	601186	中国铁建	191,600	1,140,020.00	0.08
285	002128	电投能源	49,300	1,139,816.00	0.08
286	601877	正泰电器	44,800	1,123,136.00	0.08
287	600233	圆通速递	71,300	1,122,975.00	0.08

288	002595	豪迈科技	24,085	1,122,361.00	0.08
289	601117	中国化学	152,500	1,120,875.00	0.08
290	300115	长盈精密	39,600	1,106,424.00	0.08
291	301236	软通动力	25,800	1,095,210.00	0.08
292	600372	中航机载	100,767	1,093,321.95	0.08
293	002155	湖南黄金	45,640	1,089,426.80	0.08
294	600839	四川长虹	153,700	1,072,826.00	0.08
295	002465	海格通信	82,800	1,057,356.00	0.08
296	300568	星源材质	56,000	1,048,320.00	0.08
297	300454	深信服	10,800	1,038,960.00	0.07
298	000963	华东医药	36,560	1,028,067.20	0.07
299	300347	泰格医药	21,400	1,027,200.00	0.07
300	000547	航天发展	53,200	1,018,780.00	0.07
301	688506	百利天恒药 业	3,464	1,018,519.92	0.07
302	600741	华域汽车	65,600	1,018,112.00	0.07
303	603650	彤程新材	10,300	1,009,194.00	0.07
304	300024	机器人	52,100	1,007,093.00	0.07
305	002920	德赛西威	12,300	1,002,450.00	0.07
306	002130	沃尔核材	52,400	993,504.00	0.07
307	002497	雅化集团	48,100	979,797.00	0.07
308	688676	海南金盘智 能科技	11,541	976,830.24	0.07
309	300012	华测检测	70,100	971,586.00	0.07
310	001979	招商蛇口	150,100	965,143.00	0.07
311	000878	云南铜业	60,600	962,328.00	0.07
312	688331	荣昌生物	7,374	960,537.24	0.07
313	002432	九安医疗	13,500	954,180.00	0.07
314	002271	东方雨虹	79,700	946,039.00	0.07
315	300496	中科创达	15,300	945,387.00	0.07
316	300083	创世纪	69,400	945,228.00	0.07
317	002414	高德红外	71,200	944,112.00	0.07
318	300866	安克创新	9,000	940,500.00	0.07
319	000034	神州数码	33,880	940,170.00	0.07
320	002444	巨星科技	29,800	926,780.00	0.07
321	601021	春秋航空	20,300	925,274.00	0.07
322	603979	金诚信	15,500	914,965.00	0.07
323	300474	景嘉微	15,100	913,248.00	0.07
324	000733	振华科技	16,101	911,960.64	0.07
325	300763	锦浪科技	10,000	903,500.00	0.07
326	601319	中国人保	133,100	899,756.00	0.06
327	000661	长春高新	13,500	899,100.00	0.06
328	688266	泽璟制药	7,686	896,648.76	0.06

329	002756	永兴材料	15,600	883,584.00	0.06
330	600699	均胜电子	40,700	879,527.00	0.06
331	300748	金力永磁	28,500	879,225.00	0.06
332	601615	明阳智能	75,400	872,378.00	0.06
333	002078	太阳纸业	69,800	871,802.00	0.06
334	002025	航天电器	11,400	868,908.00	0.06
335	300142	沃森生物	66,600	865,134.00	0.06
336	300073	当升科技	18,000	864,720.00	0.06
337	300432	富临精工	42,800	859,852.00	0.06
338	601677	明泰铝业	51,700	858,220.00	0.06
339	300919	中伟新材	19,500	853,125.00	0.06
340	603606	东方电缆	20,540	852,615.40	0.06
341	600039	四川路桥	108,700	850,034.00	0.06
342	000423	东阿阿胶	18,700	848,232.00	0.06
343	601800	中国交建	148,200	846,222.00	0.06
344	603087	甘李药业	14,800	840,048.00	0.06
345	000002	万 科 A	283,600	839,456.00	0.06
346	002252	上海莱士	192,100	833,714.00	0.06
347	600226	亨通股份	86,600	830,494.00	0.06
348	300724	捷佳伟创	11,700	826,020.00	0.06
349	688599	天合光能	58,498	825,991.76	0.06
350	688608	恒玄科技	4,902	819,565.38	0.06
351	688169	石头科技	8,627	819,306.19	0.06
352	688223	晶科能源	171,069	812,577.75	0.06
353	002064	华峰化学	82,800	785,772.00	0.06
354	600588	用友网络	85,318	783,219.24	0.06
355	601633	长城汽车	51,900	783,171.00	0.06
356	001965	招商公路	84,800	776,768.00	0.06
357	000786	北新建材	42,600	770,634.00	0.06
358	688390	固德威电源	7,041	764,018.91	0.06
359	002831	裕同科技	21,400	760,984.00	0.05
360	688180	君实生物	22,481	760,307.42	0.05
361	300677	英科医疗	19,000	744,230.00	0.05
362	002294	信立泰	23,200	739,848.00	0.05
363	000519	中兵红箭	34,800	733,236.00	0.05
364	603806	福斯特	43,500	730,365.00	0.05
365	601618	中国中冶	297,400	725,656.00	0.05
366	600516	方大炭素	117,312	723,815.04	0.05
367	688188	上海柏楚电 子科技	6,779	723,319.30	0.05
368	688065	凯赛生物	15,113	723,157.05	0.05
369	600177	雅戈尔	95,684	720,500.52	0.05
370	601607	上海医药	46,500	716,100.00	0.05

371	002176	江特电机	71,100	711,711.00	0.05
372	300972	万辰集团	4,100	710,981.00	0.05
373	603260	合盛硅业	14,704	709,615.04	0.05
374	000623	吉林敖东	39,900	707,427.00	0.05
375	302132	中航成飞	12,100	705,672.00	0.05
376	000617	中油资本	105,300	693,927.00	0.05
377	300699	光威复材	24,200	693,330.00	0.05
378	300558	贝达药业	10,600	689,742.00	0.05
379	002085	万丰奥威	61,900	686,471.00	0.05
380	300832	新产业	16,300	684,600.00	0.05
381	002318	久立特材	28,500	681,150.00	0.05
382	300251	光线传媒	61,100	677,599.00	0.05
383	002459	晶澳科技	82,796	670,647.60	0.05
384	002065	东华软件	93,400	666,876.00	0.05
385	600499	科达制造	48,000	662,400.00	0.05
386	002266	浙富控股	130,400	659,824.00	0.05
387	600085	同仁堂	28,500	658,635.00	0.05
388	300342	天银机电	14,000	658,000.00	0.05
389	688472	阿特斯阳光 电力	60,665	656,395.30	0.05
390	002044	美年健康	130,400	655,912.00	0.05
391	600515	海南机场	237,900	651,846.00	0.05
392	688617	惠泰医疗	3,585	650,892.60	0.05
393	605090	九丰能源	17,500	650,475.00	0.05
394	300409	道氏技术	32,600	649,718.00	0.05
395	603596	伯特利	26,096	648,224.64	0.05
396	000400	许继电气	29,700	644,490.00	0.05
397	688005	容百科技	20,965	641,529.00	0.05
398	002223	鱼跃医疗	25,000	641,500.00	0.05
399	301550	斯菱智驱	7,000	640,010.00	0.05
400	002405	四维图新	98,700	638,589.00	0.05
401	300003	乐普医疗	53,700	636,345.00	0.05
402	000032	深桑达 A	25,300	631,235.00	0.05
403	600521	华海药业	43,700	629,280.00	0.05
404	000415	渤海租赁	154,500	628,815.00	0.05
405	600862	中航高科	34,800	627,444.00	0.05
406	000683	博源化工	108,400	624,384.00	0.05
407	601216	君正集团	139,800	623,508.00	0.04
408	000039	中集集团	76,800	622,848.00	0.04
409	000999	华润三九	27,680	622,523.20	0.04
410	603766	隆鑫通用	51,200	610,816.00	0.04
411	600803	新奥股份	38,600	609,880.00	0.04
412	600704	物产中大	129,200	609,824.00	0.04

413	603605	珀莱雅	10,000	599,200.00	0.04
414	600312	平高电气	33,900	598,674.00	0.04
415	600018	上港集团	126,000	594,720.00	0.04
416	000967	盈峰环境	55,900	588,627.00	0.04
417	000887	中鼎股份	32,900	588,581.00	0.04
418	600332	白云山	29,300	587,172.00	0.04
419	688116	天奈科技	15,359	586,713.80	0.04
420	600765	中航重机	45,300	585,276.00	0.04
421	300122	智飞生物	49,700	580,993.00	0.04
422	600166	福田汽车	197,800	575,598.00	0.04
423	600153	建发股份	72,300	573,339.00	0.04
424	000830	鲁西化工	47,700	572,400.00	0.04
425	002410	广联达	68,800	561,408.00	0.04
426	600323	瀚蓝环境	20,300	557,438.00	0.04
427	002007	华兰生物	45,700	557,083.00	0.04
428	300896	爱美客	6,300	549,360.00	0.04
429	601799	星宇股份	6,000	543,720.00	0.04
430	688114	华大智造	10,439	533,224.12	0.04
431	603568	伟明环保	34,200	525,996.00	0.04
432	600398	海澜之家	100,000	523,000.00	0.04
433	002603	以岭药业	34,800	522,000.00	0.04
434	600486	扬农化工	10,200	517,140.00	0.04
435	688009	中国通号	107,717	512,732.92	0.04
436	601000	唐山港	123,300	511,695.00	0.04
437	601018	宁波港	162,000	510,300.00	0.04
438	002389	航天彩虹	28,700	509,999.00	0.04
439	600529	山东药玻	27,600	509,220.00	0.04
440	600208	衢州发展	177,200	501,476.00	0.04
441	000738	航发控制	27,400	501,146.00	0.04
442	600008	首创环保	183,520	499,174.40	0.04
443	600316	洪都航空	17,800	497,332.00	0.04
444	000932	华菱钢铁	142,800	495,516.00	0.04
445	600170	上海建工	222,000	492,840.00	0.04
446	600998	九州通	105,000	492,450.00	0.04
447	603486	科沃斯	9,700	492,275.00	0.04
448	600820	隧道股份	91,641	477,449.61	0.03
449	600161	天坛生物	41,200	477,096.00	0.03
450	300118	东方日升	38,000	473,100.00	0.03
451	603885	吉祥航空	45,600	469,224.00	0.03
452	601238	广汽集团	92,200	468,376.00	0.03
453	688303	大全能源	26,568	463,080.24	0.03
454	002607	中公教育	256,800	462,240.00	0.03
455	603816	顾家家居	20,400	456,144.00	0.03

456	603939	益丰药房	25,200	453,096.00	0.03
457	688166	博瑞生物医药	12,783	447,532.83	0.03
458	600763	通策医疗	12,940	438,407.20	0.03
459	601567	三星电气	29,200	436,248.00	0.03
460	300049	福瑞医科	11,100	431,568.00	0.03
461	300676	华大基因	12,300	431,238.00	0.03
462	600038	中直股份	17,000	429,930.00	0.03
463	300573	兴齐眼药	10,433	425,249.08	0.03
464	603392	万泰生物	15,722	424,022.34	0.03
465	601880	辽港股份	306,800	423,384.00	0.03
466	600535	天士力	31,100	411,453.00	0.03
467	600511	国药股份	15,600	406,224.00	0.03
468	600816	建元信托	164,000	400,160.00	0.03
469	300100	双林股份	14,200	394,476.00	0.03
470	002244	滨江集团	51,700	392,920.00	0.03
471	000833	粤桂股份	16,600	388,772.00	0.03
472	601155	新城控股	37,700	386,802.00	0.03
473	002120	韵达股份	60,300	383,508.00	0.03
474	300144	宋城演艺	65,600	381,136.00	0.03
475	688063	派能科技	7,110	378,749.70	0.03
476	000998	隆平高科	49,100	370,214.00	0.03
477	002544	普天科技	19,800	360,756.00	0.03
478	601866	中远海发	162,400	358,904.00	0.03
479	600064	南京高科	50,300	358,639.00	0.03
480	600635	大众公用	80,700	345,396.00	0.02
481	600754	锦江酒店	18,900	340,011.00	0.02
482	300457	赢合科技	16,000	337,280.00	0.02
483	000035	中国天楹	69,600	336,168.00	0.02
484	600655	豫园股份	81,100	333,321.00	0.02
485	300601	康泰生物	27,900	316,386.00	0.02
486	600004	白云机场	43,000	312,180.00	0.02
487	603899	晨光股份	15,100	311,513.00	0.02
488	600663	陆家嘴	49,300	309,604.00	0.02
489	600258	首旅酒店	27,900	304,668.00	0.02
490	600859	王府井	32,800	301,104.00	0.02
491	002091	江苏国泰	40,700	294,261.00	0.02
492	300070	碧水源	90,500	288,695.00	0.02
493	000069	华侨城 A	167,400	274,536.00	0.02
494	600864	哈投股份	51,900	269,361.00	0.02
495	301078	孩子王	36,900	249,444.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	37,000	242,720.00	0.02
497	603833	欧派家居	7,700	231,847.00	0.02

498	002891	中宠股份	8,100	216,432.00	0.02
499	600325	华发股份	91,600	211,596.00	0.02
500	002572	索菲亚	24,000	175,200.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688797	臻宝科技	113	52,959.71	0.00
2	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
3	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
4	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
5	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
6	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
7	001399	惠科股份	396	10,981.08	0.00
8	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
9	001237	惠康科技	122	7,166.28	0.00
10	603435	嘉德利	43	2,008.53	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	600519	贵州茅台	18,118,067.00	0.55
2	002371	北方华创	17,083,529.00	0.52
3	688041	海光信息	12,705,131.70	0.39
4	300394	天孚通信	9,416,182.00	0.29
5	300750	宁德时代	9,297,177.00	0.28
6	300308	中际旭创	8,379,042.79	0.26
7	688498	源杰科技	6,253,946.56	0.19
8	300476	胜宏科技	6,037,052.00	0.18
9	301308	江波龙	5,956,108.08	0.18
10	300502	新易盛	5,619,707.00	0.17
11	688525	佰维存储	5,612,853.29	0.17

12	688008	澜起科技	5,578,217.69	0.17
13	300223	北京君正	5,429,817.54	0.17
14	002384	东山精密	5,307,916.00	0.16
15	688777	中控技术	5,267,322.29	0.16
16	300604	长川科技	5,064,518.00	0.15
17	002594	比亚迪	4,796,842.00	0.15
18	002920	德赛西威	4,794,229.00	0.15
19	000858	五 粮 液	4,747,101.31	0.14
20	002475	立讯精密	4,680,575.38	0.14

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	84,587,654.54	2.58
2	300308	中际旭创	62,860,295.21	1.92
3	300502	新易盛	39,169,882.57	1.20
4	002371	北方华创	32,375,485.06	0.99
5	000333	美的集团	31,500,254.40	0.96
6	002475	立讯精密	25,202,987.27	0.77
7	002594	比亚迪	24,127,939.00	0.74
8	300059	东方财富	21,767,056.03	0.66
9	688256	寒武纪科技	21,151,551.92	0.65
10	300394	天孚通信	19,303,634.28	0.59
11	300274	阳光电源	19,159,181.40	0.59
12	000858	五 粮 液	19,045,492.74	0.58
13	300476	胜宏科技	18,644,849.00	0.57
14	002384	东山精密	16,505,908.58	0.50
15	000651	格力电器	14,727,249.04	0.45
16	300124	汇川技术	13,335,468.00	0.41
17	000725	京东方 A	13,198,997.00	0.40
18	002028	思源电气	12,796,997.00	0.39
19	688012	中微半导体设备	12,188,798.57	0.37
20	000338	潍柴动力	11,686,669.88	0.36

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	498,996,111.67
卖出股票收入（成交）总额	1,471,221,461.34

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	70,003.22	0.01
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	70,003.22	0.01

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	113704	春风转债	700	70,003.22	0.01

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,招商银行股份有限公司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

注：本基金本报告期末无其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688797	臻宝科技	52,959.71	0.00	新股流通受限
2	001365	天海电子	22,511.89	0.00	新股流通受限
3	301669	高特电子	15,506.40	0.00	新股流通受限
4	001393	维通利	15,089.13	0.00	新股流通受限

5	301531	春光集团	14,952.40	0.00	新股流通受限
---	--------	------	-----------	------	--------

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		中国工商银行股份有限公司-汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
4,419	226,521.01	856,058,544.00	85.52	144,937,815.00	14.48	407,608,100.00	40.72

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 11 月 18 日）基金份额总额	1,999,996,359.00
本报告期期初基金份额总额	2,662,996,359.00
本报告期基金总申购份额	213,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,875,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,000,996,359.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 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

本报告期内托管人无重大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无重大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 (%)	
银河证券	6	1,969,868,918.24	100.00	366,189.82	100.00	

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 (%)
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

制交易单元的分配比例。

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加世纪证券为申购赎回代理券商的公告	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 12 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金公司为申购赎回代理券商的公告	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 02 月 03 日
4	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
5	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
6	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
7	2025 年度汇添富基金管理股份有	公司网站	2026 年 04 月 30 日

	限公司以股东身份(通过公募基金持股)参与股东大会投票信息披露		
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加金融街证券为申购赎回代理券商的公告	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 05 月 18 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华源证券为申购赎回代理券商的公告	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 06 月 03 日
10	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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
中国工商银行股份有限公司－汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	657,991,600.00	142,749,800.00	393,133,300.00	407,608,100.00	40.72
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

2、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

3、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 A500 交易型开放式指数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、报告期内汇添富中证 A500 交易型开放式指数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