

汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 （LOF）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：中国国际金融股份有限公司

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。

基金托管人中国国际金融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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	19
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.....	20
§ 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.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59

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.....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§ 8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	61
§ 9 开放式基金份额变动.....	61
§ 10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	62
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§ 12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	汇添富沪深 300 指数（LOF）	
基金主代码	501043	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 09 月 06 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国国际金融股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	195,143,011.99	
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	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富沪深 300 指数（LOF） A	汇添富沪深 300 指数（LOF） C
下属分级基金场内简称	沪深 300A	沪深 300C
下属分级基金的交易代码	501043	501045
报告期末下属分级基金的份 额总额（份）	142,610,522.53	52,532,489.46

注：汇添富沪深 300 指数（LOF）A 类份额扩位证券简称：沪深 300LOF；汇添富沪深 300 指数（LOF）C 类份额扩位证券简称：沪深 300LOFC。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
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，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益

	的品种。同时本基金为指数基金，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	中国国际金融股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	刘晴川
	联系电话	021-28932888	010-65051166
	电子邮箱	service@99fund.com	AC_Product@cicc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	010-65353060；010-65351622
传真		021-28932998	010-65059873
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
邮政编码		200010	100004
法定代表人		鲁伟铭	陈亮

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)	
	汇添富沪深 300 指数（LOF） A	汇添富沪深 300 指数（LOF） C
本期已实现收益	11,105,446.09	3,983,975.79
本期利润	19,414,569.72	6,649,023.15
加权平均基金份额本期利润	0.1240	0.1123
本期加权平均净值利润率	7.67%	7.08%
本期基金份额净值增长率	7.82%	7.69%

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	84,803,177.63	29,795,058.49
期末可供分配基金份额利润	0.5946	0.5672
期末基金资产净值	242,824,153.22	87,793,849.57
期末基金份额净值	1.7027	1.6712
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	70.27%	67.12%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富沪深 300 指数（LOF）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	11.90%	1.19%	11.30%	1.19%	0.60%	0.00%
过去六个月	7.82%	1.07%	7.20%	1.07%	0.62%	0.00%
过去一年	27.22%	0.97%	25.13%	0.97%	2.09%	0.00%
过去三年	36.24%	1.05%	28.26%	1.06%	7.98%	-0.01%
过去五年	6.71%	1.06%	-4.02%	1.06%	10.73%	0.00%
过去七年	64.34%	1.10%	29.33%	1.11%	35.01%	-0.01%
自基金合 同生效起 至今	70.27%	1.14%	28.60%	1.14%	41.67%	0.00%
汇添富沪深 300 指数（LOF）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	①－③	②－④

				④		
过去三个月	11.83%	1.19%	11.30%	1.19%	0.53%	0.00%
过去六个月	7.69%	1.07%	7.20%	1.07%	0.49%	0.00%
过去一年	26.89%	0.97%	25.13%	0.97%	1.76%	0.00%
过去三年	35.21%	1.05%	28.26%	1.06%	6.95%	-0.01%
过去五年	5.38%	1.06%	-4.02%	1.06%	9.40%	0.00%
过去七年	61.52%	1.10%	29.33%	1.11%	32.19%	-0.01%
自基金合同生效起至今	67.12%	1.14%	28.60%	1.14%	38.52%	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

汇添富沪深300指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富沪深300指数（LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 09 月 06 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		
董瑾	本基金的基 金经理	2019 年 12 月 31 日	—	17	国籍：中国。 学历：北京大 学西方经济 学硕士。从业 资格：证券投 资基金从业 资格。从业经 历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰 基金管理有 限公司产品 经理助理， 2012 年 12 月 至 2015 年 9 月任汇添富 基金管理股 份有限公司 产品经理， 2015 年 9 月 至 2016 年 10 月任万家基 金管理有限 公司量化投 资部基金经

					理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 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助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发
--	--	--	--	--	---

					起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 5 月 8 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 8 月 29 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。2020 年 3 月 5 日至 2023 年 8 月 29 日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。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 9 日至今任汇添富中证光伏产业交易型开
--	--	--	--	--	--

					放式指数证 券投资基金 的基金经理。 2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日 任汇添富中 证电池主题 指数型发起 式证券投资 基金的基金 经理。2022 年 1 月 26 日 至 2022 年 10 月 11 日任汇 添富中证沪 港深 500 交 易型开放式 指数证券投资 基金联接 基金的基金 经理。2022 年 3 月 3 日至 今任汇添富 中证电池主 题交易型开 放式指数证 券投资基金 的基金经理。 2022 年 4 月 28 日至今任 汇添富中证 全指医疗器 械交易型开 放式指数证 券投资基金 的基金经理。 2022 年 5 月 23 日至今任 汇添富中证 电池主题交 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。2022 年 6 月 13 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的基金经理。2022 年 7 月 13 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 29 日至今任汇添富中证全指医疗器械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。2023 年 1 月 16 日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月 27 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证
--	--	--	--	--	--

					券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 6 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2023 年 5 月 9 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2023 年 8 月 23 日至 2024 年 10 月 26 日任汇添富中证沪港深消费龙头指数型发起式证券投资基金
--	--	--	--	--	--

					的基金经理。2023 年 9 月 13 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 24 日至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月 12 日至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2025 年 3 月 21 日至今任汇添富中证细分有色金属产业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。2025 年 5 月 22 日至今任汇添富中证
--	--	--	--	--	---

					港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 2 日至今任汇添富沪深 300 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。2026 年 3 月 25 日至今任汇添富中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月 9 日至今任汇添富中证港股通医疗主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月 22 日至今任汇添富中证家电龙头交易型开放式指数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。

董瑾 2026 年 07 月 03 日离任本基金基金经理。

本基金的基金经理董瑾女士于 2025 年 9 月 29 日起休产假，自 2026 年 5 月 6 日起恢复履行本基金的基金经理职务，在此期间本基金由吴振翔先生代为履行基金经理职责。（详情请见基金管理人 2025 年 9 月 26 日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于代为履行基金经理职责的公告》，以及 2026 年 5 月 6 日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告》）。

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

上半年，全球宏观环境复杂多变。国内经济保持韧性，延续总体平稳、向新向优的发展态势。政策方面，4 月份召开的中央政治局会议强调要用好用足宏观政策，保持政策的前瞻性，继续精准有效实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策。

权益市场整体表现良好，结构性行情分化较为突出。风格上来看，中小盘表现略优于大盘；成长风格显著优于价值、红利。行业主题方面，电子、通信等行业板块表现居前，而消费、传媒等行业仍有调整。

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

本报告期汇添富沪深 300 指数（LOF）A 类份额净值增长率为 7.82%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。本报告期汇添富沪深 300 指数（LOF）C 类份额净值增长率为 7.69%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济有望保持稳健增长。政策方面，央行召开二季度货币政策例会，会议研究了下一阶段货币政策主要思路，建议发挥增量政策和存量政策集成效应，增强政策前瞻性、灵活性、针对性，根据国内外经济金融形势和金融市场运行情况，把握好政策实施的力度、节奏和时机。权益市场交投活跃，流动性整体有望维持充裕，结构性行情分化仍可能延续。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

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，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的重大违规行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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：汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	20,170,881.25	25,721,325.98
结算备付金		6,839,580.30	5,854,937.69
存出保证金		1,603,798.86	1,571,061.53
交易性金融资产	6.4.7.2	302,958,493.84	352,043,043.78
其中：股票投资		302,958,493.84	352,043,043.78
基金投资		-	-

债券投资		—	—
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		—	360,988.72
应收股利		—	—
应收申购款		437,270.30	562,664.77
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		332,010,024.55	386,114,022.47
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		—	—
应付赎回款		1,098,552.64	928,287.27
应付管理人报酬		134,567.05	167,896.20
应付托管费		26,913.41	33,579.25
应付销售服务费		17,750.92	23,264.65
应付投资顾问费		—	—
应交税费		18,909.30	58,464.00
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.7	95,328.44	179,219.99
负债合计		1,392,021.76	1,390,711.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	195,143,011.99	244,827,526.19
未分配利润	6.4.7.9	135,474,990.80	139,895,784.92
净资产合计		330,618,002.79	384,723,311.11
负债和净资产总计		332,010,024.55	386,114,022.47

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 195,143,011.99 份。本基金下属汇添富沪深 300 指数（LOF）A 基金份额净值 1.7027 元，基金份额总额 142,610,522.53 份；本基金下属汇添富沪深 300 指数（LOF）C 基金份额净值 1.6712 元，基金份额总额 52,532,489.46 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）

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		27,299,331.19	6,503,779.18
1.利息收入		110,644.66	136,301.54
其中：存款利息收入	6.4.7.10	110,644.66	136,301.54
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）		16,178,303.52	-1,148,919.75
其中：股票投资收益	6.4.7.11	11,900,877.20	-6,614,956.29
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	10,221.85
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	1,169,978.82	-195,958.41
股利收益	6.4.7.17	3,107,447.50	5,651,773.10
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	10,974,170.99	7,469,876.57
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	36,212.02	46,520.82
减：二、营业总支出		1,235,738.32	1,700,147.18
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	860,944.00	1,209,489.36
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	172,188.79	241,897.86
3. 销售服务费		116,566.47	142,312.31
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		4,216.20	0.02
8. 其他费用	6.4.7.21	81,822.86	106,447.63
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		26,063,592.87	4,803,632.00

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,063,592.87	4,803,632.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		26,063,592.87	4,803,632.00

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）

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	244,827,526.19	139,895,784.92	384,723,311.11
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	244,827,526.19	139,895,784.92	384,723,311.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-49,684,514.20	-4,420,794.12	-54,105,308.32
（一）、综合收益总额	-	26,063,592.87	26,063,592.87
（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）	-49,684,514.20	-30,484,386.99	-80,168,901.19
其中：1.基金申购款	53,600,499.18	32,308,881.59	85,909,380.77
2.基金赎回款	-103,285,013.38	-62,793,268.58	-166,078,281.96
（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	195,143,011.99	135,474,990.80	330,618,002.79
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	389,613,306.78	124,608,133.47	514,221,440.25
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	389,613,306.78	124,608,133.47	514,221,440.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-65,833,430.95	-16,804,480.43	-82,637,911.38
（一）、综合收益总额	-	4,803,632.00	4,803,632.00
（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）	-65,833,430.95	-21,608,112.43	-87,441,543.38
其中：1.基金申购款	92,369,563.42	26,439,687.12	118,809,250.54
2.基金赎回款	-158,202,994.37	-48,047,799.55	-206,250,793.92
（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	323,779,875.83	107,803,653.04	431,583,528.87

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

汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）（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〔2017〕1332 号文《关于准予汇

添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）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 2017 年 9 月 6 日生效。首次设立基金募集规模为 512,823,476.78 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（2017）验字第 60466941_B31 号验资报告予以验证。本基金为上市契约型开放式，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，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务

总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

2. 增值税

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	20,170,881.25
等于：本金	20,167,041.07
加：应计利息	3,840.18
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	20,170,881.25

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		245,973,455.29	-	302,958,493.84	56,985,038.55
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		245,973,455.29	-	302,958,493.84	56,985,038.55

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	12,627,420.00	-	-	-

（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	12,627,420.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,627,420.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2612	IF2612	9	12,855,780.00	228,360.00
合计				228,360.00
减：可抵销期货暂收款				228,360.00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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	13,505.58
其中：交易所市场	13,505.58
银行间市场	—
应付利息	—
应付审计费	22,315.49
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	—
合计	95,328.44

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富沪深 300 指数（LOF）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	174,889,716.89	174,889,716.89
本期申购	30,501,913.58	30,501,913.58
本期赎回（以“-”号填列）	-62,781,107.94	-62,781,107.94
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	142,610,522.53	142,610,522.53
汇添富沪深 300 指数（LOF）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	69,937,809.30	69,937,809.30
本期申购	23,098,585.60	23,098,585.60
本期赎回（以“-”号填列）	-40,503,905.44	-40,503,905.44
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	52,532,489.46	52,532,489.46

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富沪深 300 指数（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	91,569,552.24	9,725,704.98	101,295,257.22
加：会计政策变更	—	—	—
本期期初	91,569,552.24	9,725,704.98	101,295,257.22
本期利润	11,105,446.09	8,309,123.63	19,414,569.72
本期基金份额交易产生的变动数	-17,871,820.70	-2,624,375.55	-20,496,196.25
其中：基金申购款	17,074,905.77	1,613,233.98	18,688,139.75
基金赎回款	-34,946,726.47	-4,237,609.53	-39,184,336.00
本期已分配利润	—	—	—
本期末	84,803,177.63	15,410,453.06	100,213,630.69
汇添富沪深 300 指数（LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,923,614.23	3,676,913.47	38,600,527.70
加：会计政策变更	—	—	—
本期期初	34,923,614.23	3,676,913.47	38,600,527.70
本期利润	3,983,975.79	2,665,047.36	6,649,023.15
本期基金份额交易产生的变动数	-9,112,531.53	-875,659.21	-9,988,190.74
其中：基金申购款	12,292,998.44	1,327,743.40	13,620,741.84
基金赎回款	-21,405,529.97	-2,203,402.61	-23,608,932.58

本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,795,058.49	5,466,301.62	35,261,360.11

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	78,831.11
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	31,134.97
其他	678.58
合计	110,644.66

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	99,397,885.89
减：卖出股票成本总额	87,416,918.09
减：交易费用	80,090.60
买卖股票差价收入	11,900,877.20

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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	1,169,978.82
外汇远期投资收益	—
外汇期货投资收益	—
国债期货投资收益	—

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	3,107,447.50
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	3,107,447.50

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	11,130,950.99
——股票投资	11,130,950.99
——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	-156,780.00
——权证投资	-
——期货投资	-156,780.00
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	10,974,170.99

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	36,212.02
替代损益	-
其他	-
合计	36,212.02

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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	-
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	-

合计	81,822.86
----	-----------

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,基金发起人
中国国际金融股份有限公司（"中金公司"）	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（%）
中金公司	54,608,156.70	43.13	92,745,223.52	62.21

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（%）
中金公司	-	-	77,225.16	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中金公司	9,606.59	43.14	6,114.17	45.27
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（%）
中金公司	16,314.09	62.21	6,622.24	50.34

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	860,944.00	1,209,489.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	260,343.15	394,534.68
应支付基金管理人的净管理费	600,600.85	814,954.68

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	172,188.79	241,897.86

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富沪深 300 指数 （LOF）A	汇添富沪深 300 指数 （LOF）C	合计
东方证券股份有限公司	-	1,234.32	1,234.32
汇添富基金管理股份有限公司	-	36,258.41	36,258.41
合计	-	37,492.73	37,492.73
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富沪深 300 指数 （LOF）A	汇添富沪深 300 指数 （LOF）C	合计
东方证券股份有限公司	-	1,381.39	1,381.39
汇添富基金管理股份有限公司	-	46,638.05	46,638.05
合计	-	48,019.44	48,019.44

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

注：本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额，本报告期及上年度可比期间均未有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

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，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 56,144.00 股，占本基金净值比例为 0.16%。持有基金托管人中金公司发行的股票 12,500.00 股，占本基金净值比例为 0.14%。（于上期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 100,344.00 股，占本基金净值比例为 0.23%。持有基金托管人中金公司发行的股票 22,400.00 股，占本基金净值比例为 0.18%。）

6.4.11 利润分配情况

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	2,171	1,434,022.76	1,909,459.63	

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	20,170,881.25	-	-	-	-	-	20,170,881.25
结算备付金	6,839,580.30	-	-	-	-	-	6,839,580.30
存出保证金	61,105.26	-	-	-	-	1,542,693.60	1,603,798.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	302,958,493.84	302,958,493.84
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	48,711.75	-	-	-	-	388,558.55	437,270.30
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	27,120,278.56	-	-	-	-	304,889,745.99	332,010,024.55
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,098,552.64	1,098,552.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	134,567.05	134,567.05
应付托管费	-	-	-	-	-	26,913.41	26,913.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,750.92	17,750.92
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	18,909.30	18,909.30
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	95,328.44	95,328.44
负债总计	-	-	-	-	-	1,392,021.76	1,392,021.76
利率敏感度缺口	27,120,278.56	-	-	-	-	303,497,724.23	330,618,002.79
上年度末	1 个月以	1-3 个月	3 个月-1	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日	内		年				
资产							
货币资金	25,721,325.98	-	-	-	-	-	25,721,325.98
结算备付金	5,854,937.69	-	-	-	-	-	5,854,937.69
存出保证金	82,864.73	-	-	-	-	1,488,196.80	1,571,061.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	352,043,043.78	352,043,043.78
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	360,988.72	360,988.72
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	24,294.00	-	-	-	-	538,370.77	562,664.77
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	31,683,422.40	-	-	-	-	354,430,600.07	386,114,022.47
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	-	-	-	-	-	928,287.27	928,287.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	167,896.20	167,896.20
应付托管	-	-	-	-	-	33,579.25	33,579.25

费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	23,264.65	23,264.65
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	58,464.00	58,464.00
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	179,219.99	179,219.99
负债总计	-	-	-	-	-	1,390,711.36	1,390,711.36
利率敏感度缺口	31,683,422.40	-	-	-	-	353,039,888.71	384,723,311.11

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	302,958,493.84	91.63	352,043,043.78	91.51

交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	302,958,493.84	91.63	352,043,043.78	91.51

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%	15,694,327.72	18,342,572.06
	沪深 300 指数下跌 5%	-15,694,327.72	-18,342,572.06

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	301,049,034.21
第二层次	1,909,459.63
第三层次	—
合计	302,958,493.84

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	302,958,493.84	91.25
	其中：股票	302,958,493.84	91.25
2	基金投资	—	—

3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	27,010,461.55	8.14
8	其他各项资产	2,041,069.16	0.61
9	合计	332,010,024.55	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,725,696.03	0.52
B	采矿业	12,678,951.75	3.83
C	制造业	194,320,425.79	58.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,527,788.00	2.28
E	建筑业	3,455,587.31	1.05
F	批发和零售业	450,393.40	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	7,339,614.56	2.22
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,129,588.68	4.88
J	金融业	53,068,769.82	16.05
K	房地产业	990,164.00	0.30
L	租赁和商务服务业	1,385,664.49	0.42
M	科学研究和技术服务业	3,299,639.51	1.00
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	413,206.50	0.12
R	文化、体育和娱乐业	173,004.00	0.05
S	综合	—	—
	合计	302,958,493.84	91.63

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

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	11,980	15,214,600.00	4.60
2	300750	宁德时代	28,320	11,130,043.20	3.37
3	300502	新易盛	14,948	9,073,436.00	2.74
4	600519	贵州茅台	6,700	7,942,783.00	2.40
5	603986	兆易创新	7,188	5,858,220.00	1.77
6	601318	中国平安	114,200	5,451,908.00	1.65
7	688256	寒武纪科技	3,284	5,239,786.20	1.58
8	600036	招商银行	132,600	4,707,300.00	1.42
9	601899	紫金矿业	176,600	4,439,724.00	1.34
10	002371	北方华创	4,635	4,099,935.60	1.24
11	000333	美的集团	52,100	3,935,113.00	1.19
12	002475	立讯精密	54,590	3,843,136.00	1.16
13	688008	澜起科技	12,364	3,831,603.60	1.16
14	688012	中微半导体 设备	8,020	3,757,370.00	1.14
15	688041	海光信息	9,997	3,701,889.10	1.12
16	002384	东山精密	13,700	3,594,195.00	1.09
17	600900	长江电力	131,100	3,470,217.00	1.05
18	688981	中芯国际	21,334	3,388,265.88	1.02
19	000725	京东方 A	389,600	3,381,728.00	1.02
20	603259	药明康德	26,501	3,299,639.51	1.00
21	601138	工业富联	42,500	3,066,375.00	0.93
22	600030	中信证券	104,590	3,004,870.70	0.91
23	601166	兴业银行	181,400	3,003,984.00	0.91
24	300059	东方财富	135,609	2,763,711.42	0.84
25	600183	生益科技	15,600	2,705,040.00	0.82
26	600276	恒瑞医药	47,840	2,489,593.60	0.75
27	300274	阳光电源	15,520	2,467,990.40	0.75

28	601398	工商银行	346,800	2,451,876.00	0.74
29	300408	三环集团	14,400	2,403,360.00	0.73
30	002594	比亚迪	29,106	2,319,748.20	0.70
31	300476	胜宏科技	6,500	2,251,795.00	0.68
32	601211	国泰海通	121,118	2,204,347.60	0.67
33	002463	沪电股份	14,400	2,200,320.00	0.67
34	300394	天孚通信	6,976	2,111,495.68	0.64
35	000988	华工科技	10,800	1,993,788.00	0.60
36	688072	拓荆科技	2,171	1,909,459.63	0.58
37	301308	江波龙	2,700	1,900,260.00	0.57
38	600176	中国巨石	25,775	1,878,482.00	0.57
39	601288	农业银行	307,870	1,868,770.90	0.57
40	601328	交通银行	285,800	1,837,694.00	0.56
41	000651	格力电器	48,000	1,800,000.00	0.54
42	600522	中天科技	29,300	1,777,924.00	0.54
43	600919	江苏银行	157,260	1,695,262.80	0.51
44	603019	中科曙光	15,620	1,674,932.60	0.51
45	603993	洛阳钼业	93,600	1,642,680.00	0.50
46	688521	芯原微电子	4,412	1,637,469.68	0.50
47	600150	中国船舶	48,453	1,637,226.87	0.50
48	600887	伊利股份	67,734	1,622,906.64	0.49
49	600584	长电科技	15,400	1,594,670.00	0.48
50	000338	潍柴动力	57,600	1,569,600.00	0.47
51	000858	五 粮 液	20,747	1,535,278.00	0.46
52	601816	京沪高铁	314,500	1,424,685.00	0.43
53	600309	万华化学	20,127	1,376,888.07	0.42
54	300124	汇川技术	20,300	1,346,499.00	0.41
55	002415	海康威视	39,300	1,344,060.00	0.41
56	002916	深南电路	2,916	1,335,236.40	0.40
57	600111	北方稀土	27,100	1,302,155.00	0.39
58	000100	TCL 科技	222,760	1,296,463.20	0.39
59	601688	华泰证券	62,600	1,290,812.00	0.39
60	000063	中兴通讯	34,501	1,248,591.19	0.38
61	600000	浦发银行	142,800	1,229,508.00	0.37
62	600089	特变电工	54,090	1,217,025.00	0.37
63	601857	中国石油	138,700	1,203,916.00	0.36
64	002028	思源电气	6,700	1,159,100.00	0.35
65	601088	中国神华	29,401	1,147,815.04	0.35
66	300433	蓝思科技	21,350	1,145,641.00	0.35
67	600031	三一重工	63,500	1,097,280.00	0.33
68	300014	亿纬锂能	16,300	1,059,989.00	0.32
69	002142	宁波银行	35,351	1,049,571.19	0.32
70	002050	三花智控	23,924	1,048,588.92	0.32

71	601601	中国太保	36,700	1,046,684.00	0.32
72	000001	平安银行	104,100	1,046,205.00	0.32
73	000792	盐湖股份	34,000	1,026,460.00	0.31
74	002714	牧原股份	29,257	1,023,702.43	0.31
75	600549	厦门钨业	11,900	1,013,880.00	0.31
76	002353	杰瑞股份	6,600	1,006,500.00	0.30
77	600406	国电南瑞	43,063	983,989.55	0.30
78	601668	中国建筑	221,120	959,660.80	0.29
79	000657	中钨高新	9,800	938,056.00	0.28
80	601229	上海银行	106,500	924,420.00	0.28
81	601919	中远海控	67,250	891,735.00	0.27
82	002602	世纪华通	63,100	889,710.00	0.27
83	300760	迈瑞医疗	6,500	882,895.00	0.27
84	601988	中国银行	153,409	877,499.48	0.27
85	601939	建设银行	90,790	874,307.70	0.26
86	600660	福耀玻璃	17,201	867,618.44	0.26
87	601728	中国电信	166,400	863,616.00	0.26
88	603501	豪威集团	9,050	858,392.50	0.26
89	600016	民生银行	266,420	857,872.40	0.26
90	601012	隆基绿能	64,962	852,301.44	0.26
91	601225	陕西煤业	41,500	844,525.00	0.26
92	002230	科大讯飞	20,600	841,304.00	0.25
93	600999	招商证券	39,790	839,569.00	0.25
94	600941	中国移动	9,700	835,461.00	0.25
95	600690	海尔智家	40,201	820,502.41	0.25
96	002352	顺丰控股	25,700	803,382.00	0.24
97	601985	中国核电	88,200	796,446.00	0.24
98	002460	赣锋锂业	12,071	789,443.40	0.24
99	002709	天赐材料	15,300	786,879.00	0.24
100	600926	杭州银行	54,300	784,635.00	0.24
101	603799	华友钴业	16,240	783,742.40	0.24
102	002938	鹏鼎控股	7,400	779,812.00	0.24
103	601169	北京银行	158,500	776,650.00	0.23
104	000977	浪潮信息	11,000	770,000.00	0.23
105	600160	巨化股份	14,500	768,645.00	0.23
106	300033	同花顺	3,180	766,380.00	0.23
107	000776	广发证券	31,600	739,440.00	0.22
108	300442	润泽科技	8,800	731,016.00	0.22
109	000425	徐工机械	88,000	711,920.00	0.22
110	000938	紫光股份	24,533	708,022.38	0.21
111	688126	上海硅产业集团	17,691	705,693.99	0.21
112	002202	金风科技	29,500	705,050.00	0.21

113	300498	温氏股份	56,980	701,993.60	0.21
114	601600	中国铝业	84,900	697,878.00	0.21
115	600028	中国石化	156,203	696,665.38	0.21
116	600938	中国海油	25,600	695,040.00	0.21
117	600460	士兰微	12,500	683,250.00	0.21
118	002466	天齐锂业	11,100	680,652.00	0.21
119	002600	领益智造	39,100	677,994.00	0.21
120	601766	中国中车	130,300	677,560.00	0.20
121	300661	圣邦股份	4,691	673,064.68	0.20
122	600050	中国联通	167,500	670,000.00	0.20
123	601009	南京银行	66,200	654,718.00	0.20
124	002837	英维克	8,200	652,392.00	0.20
125	688082	盛美上海半 导体	1,500	648,000.00	0.20
126	002049	紫光国微	7,280	646,100.00	0.20
127	601628	中国人寿	17,838	630,573.30	0.19
128	002179	中航光电	13,599	628,273.80	0.19
129	601100	恒立液压	5,792	622,987.52	0.19
130	000568	泸州老窖	7,901	612,485.52	0.19
131	601872	招商轮船	34,600	607,922.00	0.18
132	002241	歌尔股份	26,601	599,320.53	0.18
133	603288	海天味业	17,884	593,033.44	0.18
134	601006	大秦铁路	128,000	590,080.00	0.18
135	601658	邮储银行	118,300	583,219.00	0.18
136	000408	藏格矿业	8,400	582,288.00	0.18
137	605117	德业股份	5,464	580,167.52	0.18
138	601818	光大银行	199,300	575,977.00	0.17
139	600809	山西汾酒	5,220	570,911.40	0.17
140	600905	三峡能源	153,200	568,372.00	0.17
141	601888	中国中免	10,499	563,901.29	0.17
142	600489	中金黄金	31,100	561,355.00	0.17
143	002625	光启技术	18,500	560,920.00	0.17
144	688111	金山办公	2,578	549,242.90	0.17
145	688396	华润微电子	5,621	548,328.55	0.17
146	600893	航发动力	14,300	548,262.00	0.17
147	000630	铜陵有色	86,200	548,232.00	0.17
148	600010	宝钢股份	241,900	539,437.00	0.16
149	601127	赛力斯	8,800	539,000.00	0.16
150	601336	新华保险	8,900	530,974.00	0.16
151	600958	东方证券	56,144	529,999.36	0.16
152	688271	联影医疗	5,225	528,926.75	0.16
153	601689	拓普集团	9,355	527,809.10	0.16
154	002027	分众传媒	108,280	524,075.20	0.16

155	600118	中国卫星	6,300	516,915.00	0.16
156	600019	宝钢股份	93,200	506,076.00	0.15
157	600760	中航沈飞	12,116	497,967.60	0.15
158	000807	云铝股份	22,300	493,722.00	0.15
159	688183	生益电子	3,656	484,054.40	0.15
160	601838	成都银行	27,300	483,210.00	0.15
161	600104	上汽集团	49,300	481,168.00	0.15
162	600362	江西铜业	11,102	480,716.60	0.15
163	300450	先导智能	11,800	480,496.00	0.15
164	600989	宝丰能源	23,500	477,755.00	0.14
165	601727	上海电气	67,400	471,800.00	0.14
166	002001	新 和 成	16,540	470,066.80	0.14
167	600875	东方电气	16,300	468,951.00	0.14
168	601825	沪农商行	62,000	464,380.00	0.14
169	002422	科伦药业	11,900	458,388.00	0.14
170	601390	中国中铁	109,900	458,283.00	0.14
171	603296	华勤技术	6,100	453,047.00	0.14
172	601995	中金公司	12,500	451,875.00	0.14
173	000538	云南白药	9,531	451,483.47	0.14
174	600547	山东黄金	19,422	448,453.98	0.14
175	601377	兴业证券	74,040	447,201.60	0.14
176	600795	国电电力	95,700	446,919.00	0.14
177	600585	海螺水泥	25,701	435,631.95	0.13
178	600015	华夏银行	68,100	435,159.00	0.13
179	601669	中国电建	92,500	434,750.00	0.13
180	603893	瑞芯微	2,300	433,228.00	0.13
181	601916	浙商银行	161,600	425,008.00	0.13
182	000166	申万宏源	96,400	424,160.00	0.13
183	300316	晶盛机电	7,000	422,800.00	0.13
184	002648	卫星化学	17,980	422,350.20	0.13
185	300015	爱尔眼科	50,025	413,206.50	0.12
186	601698	中国卫通	13,500	408,375.00	0.12
187	601066	中信建投	13,900	404,073.00	0.12
188	600346	恒力石化	22,660	401,308.60	0.12
189	601868	中国能建	149,500	399,165.00	0.12
190	600482	中国动力	12,100	396,880.00	0.12
191	601998	中信银行	56,900	394,317.00	0.12
192	002311	海大集团	8,800	392,568.00	0.12
193	002558	巨人网络	14,200	391,352.00	0.12
194	300418	昆仑万维	9,600	387,456.00	0.12
195	600066	宇通客车	14,300	383,383.00	0.12
196	000625	长安汽车	53,148	381,071.16	0.12
197	600426	华鲁恒升	15,800	377,936.00	0.11

198	600221	海航控股	275,800	372,330.00	0.11
199	000157	中联重科	53,300	371,501.00	0.11
200	002532	天山铝业	34,600	371,258.00	0.11
201	688036	传音控股	6,117	360,597.15	0.11
202	300803	指南针	3,900	357,513.00	0.11
203	600011	华能国际	47,100	357,489.00	0.11
204	600048	保利发展	77,000	356,510.00	0.11
205	605499	东鹏饮料	2,868	353,997.24	0.11
206	600438	通威股份	28,900	349,979.00	0.11
207	600436	片仔癀	3,200	349,696.00	0.11
208	002236	大华股份	21,100	347,939.00	0.11
209	601077	渝农商行	56,900	347,659.00	0.11
210	600115	中国东航	91,100	347,091.00	0.10
211	002493	荣盛石化	32,200	346,150.00	0.10
212	600570	恒生电子	16,237	344,062.03	0.10
213	600886	国投电力	25,700	342,067.00	0.10
214	600188	兖矿能源	19,055	338,607.35	0.10
215	688047	龙芯中科	2,147	332,076.49	0.10
216	002736	国信证券	33,000	329,670.00	0.10
217	003816	中国广核	84,100	328,831.00	0.10
218	601360	三六零	37,600	326,744.00	0.10
219	000301	东方盛虹	28,400	325,180.00	0.10
220	601058	赛轮轮胎	28,200	325,146.00	0.10
221	600026	中远海能	17,900	321,126.00	0.10
222	002074	国轩高科	11,600	319,116.00	0.10
223	601901	方正证券	43,900	316,080.00	0.10
224	600196	复星医药	13,701	307,861.47	0.09
225	600009	上海机场	13,300	307,230.00	0.09
226	000768	中航西飞	15,000	307,200.00	0.09
227	601111	中国国航	50,102	303,117.10	0.09
228	000975	山金国际	17,800	302,600.00	0.09
229	601788	光大证券	20,900	301,587.00	0.09
230	600029	南方航空	57,697	298,870.46	0.09
231	600415	小商品城	29,300	297,688.00	0.09
232	601456	国联民生	33,600	297,024.00	0.09
233	600674	川投能源	20,900	296,153.00	0.09
234	601881	中国银河	23,401	294,150.57	0.09
235	600219	南山铝业	73,700	294,063.00	0.09
236	601186	中国铁建	49,400	293,930.00	0.09
237	601877	正泰电器	11,500	288,305.00	0.09
238	600233	圆通速递	18,300	288,225.00	0.09
239	601117	中国化学	39,100	287,385.00	0.09
240	301236	软通动力	6,700	284,415.00	0.09

241	600372	中航机载	26,000	282,100.00	0.09
242	601878	浙商证券	29,300	278,350.00	0.08
243	301269	华大九天	2,300	274,666.00	0.08
244	000963	华东医药	9,445	265,593.40	0.08
245	688506	百利天恒药 业	900	264,627.00	0.08
246	600741	华域汽车	16,900	262,288.00	0.08
247	002920	德赛西威	3,200	260,800.00	0.08
248	000895	双汇发展	11,200	250,880.00	0.08
249	001979	招商蛇口	38,600	248,198.00	0.08
250	002304	洋河股份	6,503	248,089.45	0.08
251	300866	安克创新	2,300	240,350.00	0.07
252	601898	中煤能源	19,500	237,510.00	0.07
253	601021	春秋航空	5,200	237,016.00	0.07
254	601319	中国人保	34,200	231,192.00	0.07
255	600023	浙能电力	43,100	226,706.00	0.07
256	600039	四川路桥	27,840	217,708.80	0.07
257	601800	中国交建	38,101	217,556.71	0.07
258	000002	万 科 A	73,200	216,672.00	0.07
259	688223	晶科能源	44,236	210,121.00	0.06
260	601633	长城汽车	13,400	202,206.00	0.06
261	600588	用友网络	21,902	201,060.36	0.06
262	001965	招商公路	21,800	199,688.00	0.06
263	600600	青岛啤酒	3,800	198,474.00	0.06
264	603369	今世缘	8,100	192,051.00	0.06
265	600027	华电国际	42,500	189,125.00	0.06
266	601618	中国中冶	76,700	187,148.00	0.06
267	302132	中航成飞	3,200	186,624.00	0.06
268	601607	上海医药	12,000	184,800.00	0.06
269	603260	合盛硅业	3,800	183,388.00	0.06
270	300628	亿联网络	5,420	183,304.40	0.06
271	600918	中泰证券	34,100	181,412.00	0.05
272	000617	中油资本	27,100	178,589.00	0.05
273	600061	国投资本	27,196	178,133.80	0.05
274	600025	华能水电	20,000	177,800.00	0.05
275	300832	新产业	4,200	176,400.00	0.05
276	300251	光线传媒	15,600	173,004.00	0.05
277	600930	华电新能源 集团	35,900	171,243.00	0.05
278	688472	阿特斯阳光 电力	15,732	170,220.24	0.05
279	600515	海南机场	61,600	168,784.00	0.05
280	600085	同仁堂	7,302	168,749.22	0.05

281	601059	信达证券	10,400	168,376.00	0.05
282	000999	华润三九	7,034	158,194.66	0.05
283	600803	新奥股份	9,900	156,420.00	0.05
284	600018	上港集团	32,700	154,344.00	0.05
285	600845	宝信软件	9,172	152,530.36	0.05
286	300122	智飞生物	12,800	149,632.00	0.05
287	300999	金龙鱼	6,400	148,864.00	0.05
288	000596	古井贡酒	1,800	143,640.00	0.04
289	300896	爱美客	1,580	137,776.00	0.04
290	000708	中信特钢	10,800	136,296.00	0.04
291	688009	中国通号	27,417	130,504.92	0.04
292	601018	宁波港	41,300	130,095.00	0.04
293	688303	大全能源	6,898	120,232.14	0.04
294	001280	中国铀业	1,800	120,060.00	0.04
295	601238	广汽集团	23,500	119,380.00	0.04
296	300413	芒果超媒	8,020	117,332.60	0.04
297	301165	锐捷网络	1,400	112,630.00	0.03
298	603392	万泰生物	4,064	109,606.08	0.03
299	601136	首创证券	5,800	80,910.00	0.02
300	001391	国货航	15,400	62,678.00	0.02

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	000988	华工科技	1,730,393.00	0.45
2	301308	江波龙	1,459,221.00	0.38
3	688072	拓荆科技	1,434,022.76	0.37
4	688521	芯原微电子	1,057,233.88	0.27
5	002353	杰瑞股份	1,022,708.00	0.27
6	002602	世纪华通	912,649.00	0.24
7	600549	厦门钨业	834,923.00	0.22
8	000657	中钨高新	818,366.00	0.21
9	002202	金风科技	637,410.00	0.17

10	002837	英维克	583,832.90	0.15
11	300450	先导智能	505,995.00	0.13
12	601727	上海电气	505,160.00	0.13
13	600118	中国卫星	487,591.00	0.13
14	688183	生益电子	475,739.50	0.12
15	002532	天山铝业	474,103.00	0.12
16	300750	宁德时代	453,902.00	0.12
17	600221	海航控股	434,126.00	0.11
18	600183	生益科技	427,395.00	0.11
19	600036	招商银行	384,741.00	0.10
20	002558	巨人网络	353,074.00	0.09

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	3,860,558.00	1.00
2	300308	中际旭创	3,125,745.00	0.81
3	600519	贵州茅台	2,906,290.00	0.76
4	601318	中国平安	2,381,140.00	0.62
5	601899	紫金矿业	2,095,760.00	0.54
6	600036	招商银行	1,957,725.00	0.51
7	300502	新易盛	1,751,159.00	0.46
8	000333	美的集团	1,502,476.00	0.39
9	688256	寒武纪科技	1,432,353.98	0.37
10	601166	兴业银行	1,289,351.00	0.34
11	600900	长江电力	1,235,029.00	0.32
12	002475	立讯精密	1,129,403.00	0.29
13	600030	中信证券	981,172.00	0.26
14	300059	东方财富	980,261.00	0.25
15	002594	比亚迪	957,886.00	0.25
16	601088	中国神华	953,922.00	0.25
17	601138	工业富联	929,488.00	0.24
18	600276	恒瑞医药	925,907.20	0.24
19	603259	药明康德	913,483.00	0.24
20	601398	工商银行	883,630.00	0.23

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	27,201,417.16
卖出股票收入（成交）总额	99,397,885.89

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,603,798.86
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	437,270.30
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,041,069.16

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富沪深 300 指数（LOF）A	16,436	8,676.72	295,421.00	0.21	142,315,101.53	99.79
汇添富沪	6,447	8,148.36	754.00	0.00	52,531,735	100.00

深 300 指数（LOF）C					.46	
合计	22,883	8,527.86	296,175.00	0.15	194,846,836.99	99.85

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富沪深 300 指数（LOF）A	506,678.77	0.36
	汇添富沪深 300 指数（LOF）C	776.73	0.00
	合计	507,455.50	0.26

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,002,700.27 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 09 月 06 日起 3 年。截至本报告期期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富沪深 300 指数（LOF）	汇添富沪深 300 指数（LOF）
----	-------------------	-------------------

	A	C
基金合同生效日（2017 年 09 月 06 日）基金份额总额	215,858,430.00	296,965,046.78
本报告期期初基金份额总额	174,889,716.89	69,937,809.30
本报告期基金总申购份额	30,501,913.58	23,098,585.60
减：本报告期基金总赎回份 额	62,781,107.94	40,503,905.44
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	142,610,522.53	52,532,489.46

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，经基金托管人中国国际金融股份有限公司研究决定，聘任刘晴川同志为本公司资产托管部负责人，严格同志不再担任资产托管部负责人职务，公司另有任用。

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重大诉讼。

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，基金托管人没有受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员没有受到调查或处罚。

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（%）	
中信证券	2	71,991,146.35	56.87	12,663.14	56.86	
中金公司	2	54,608,156.70	43.13	9,606.59	43.14	

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（%）
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公	-	-	-	-	-	-	-	-

司								
---	--	--	--	--	--	--	--	--

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司,租用其交易单元。
- (2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限,需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。
- (6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估,根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商,与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 22 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,	2026 年 04 月 22 日

		深交所,上交所,上证报	
5	2025 年度汇添富基金管理股份有限公司以股东身份(通过公募基金持股)参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026 年 04 月 30 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告	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 06 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 06 月 06 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,上证报	2026 年 06 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）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