

汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 03 月 03 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
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	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	60

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.....	60
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.....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 投资组合报告附注.....	60
§ 8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
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.....	62
§ 9 开放式基金份额变动.....	62
§ 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.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	63
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.....	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§ 12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富中证 A500 指数量化增强	
基金主代码	025711	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 03 月 03 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	627,080,665.90	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 A500 指数量化增强 A	汇添富中证 A500 指数量化增强 C
下属分级基金的交易代码	025711	025712
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	388,736,111.22	238,344,554.68

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 A500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.00%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；股票投资策略；港股通标的股票的投资策略；存托凭证的投资策略；债券投资策略；可转债及可交换债投资策略；资产支持证券投资策略；股指期货投资策略；国债期货投资策略；股票期权投资策略；融资投资策略及参与转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，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。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	任航
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200010	100031
法定代表人		鲁伟铭	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 03 月 03 日(基金合同生效日) – 2026 年 06 月 30 日)	
	汇添富中证 A500 指数量化增强 A	汇添富中证 A500 指数量化增强 C
本期已实现收益	34,550,219.52	16,345,161.95
本期利润	46,979,043.87	21,816,769.15
加权平均基金份额本期利润	0.0482	0.0531
本期加权平均净值利润率	4.78%	5.25%
本期基金份额净值增长率	4.73%	4.66%
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	18,372,351.53	11,108,314.83
期末可供分配基金份额利润	0.0473	0.0466

期末基金资产净值	407,108,462.75	249,452,869.51
期末基金份额净值	1.0473	1.0466
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	4.73%	4.66%

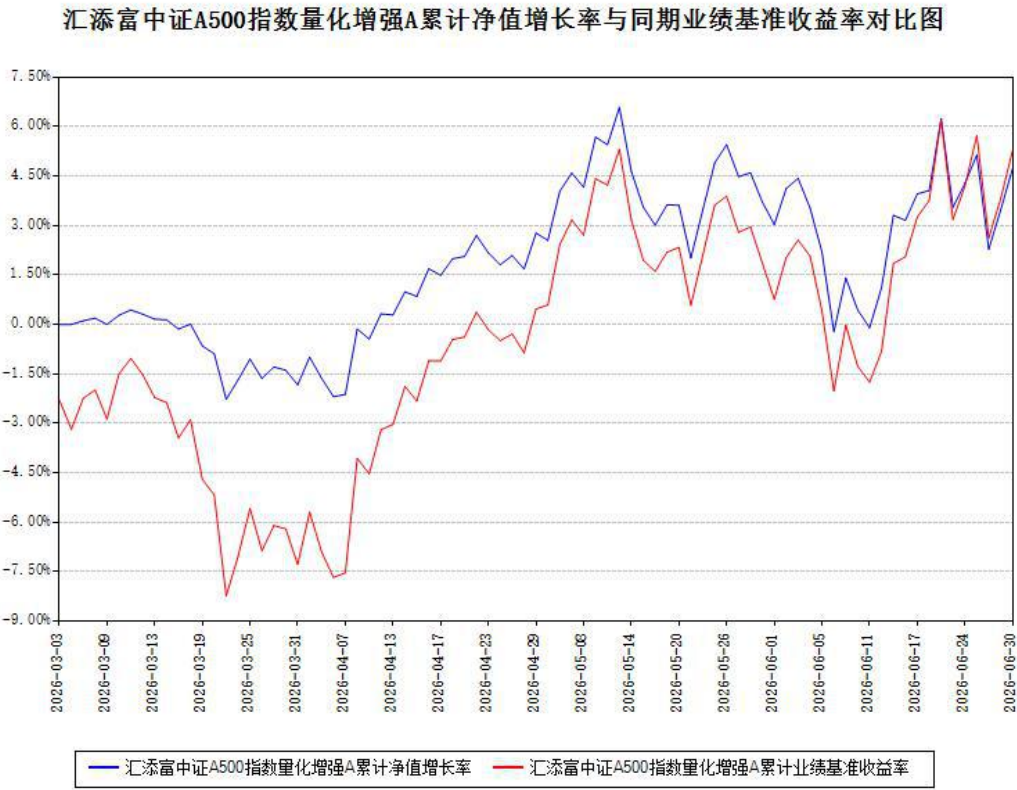
- 注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
- 4、本基金的《基金合同》生效日为 2026 年 03 月 03 日，至本报告期末未满半年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2026 年 06 月 30 日数据，特此说明。

3.2 基金净值表现

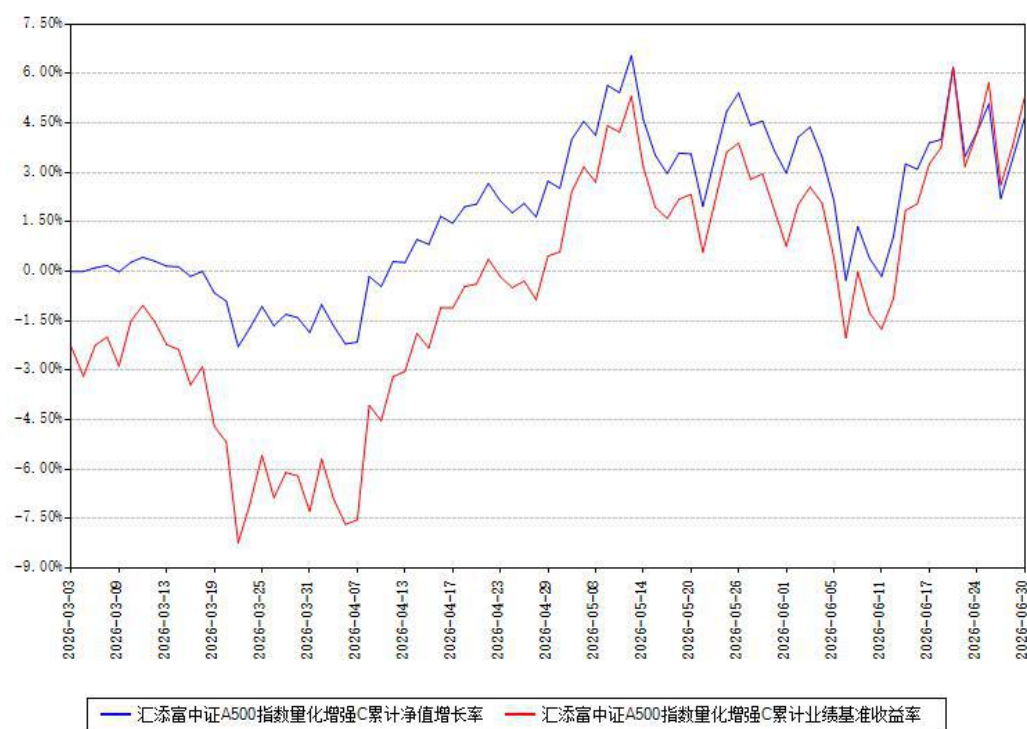
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 A500 指数量化增强 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.68%	1.10%	13.54%	1.34%	-6.86%	-0.24%
自基金合同生效起至今	4.73%	0.97%	5.28%	1.33%	-0.55%	-0.36%
汇添富中证 A500 指数量化增强 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.63%	1.10%	13.54%	1.34%	-6.91%	-0.24%
自基金合同生效起至今	4.66%	0.97%	5.28%	1.33%	-0.62%	-0.36%

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A500指数量化增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2026 年 03 月 03 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为自本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问、公募证券投资基金销售等业务资格。

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年 限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基 金经理	2026 年 03 月 03 日	—	16	国籍：中国。 学历：上海财 经大学经济 学硕士。从业 资格：证券投 资基金从业 资格。从业经 历：2010 年 7 月加入汇添 富基金管理 股份有限公司，现任指数 与量化投资 部基金经理。 2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日 任汇添富成 长多因子量 化策略股票 型证券投资 基金的基金 经理。2018

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

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

					基金经理。
--	--	--	--	--	-------

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

权益市场方面，报告期内 A 股震荡上行，交投活跃度维持高位，风格与结构分化显著。一季度初市场延续上年年末的活跃态势，成长动量风格涨幅较大，随后成交缩量、行情转为震荡，风格阶段性再均衡，红利、价值风格有所表现。二季度市场情绪再度走强，成长风格

显著领先，价值及红利风格偏弱，资金向科技成长类资产集中，呈现极致分化格局。风格与因子方面，一季度风格轮动加快，红利与小盘成长相对占优，大盘成长承压；二季度成长、动量、高 Beta 等因子显著占优，价值、质量、低波动、红利等逆向因子整体回撤，因子有效性随风格切换波动较大。

本基金于 2026 年 3 月成立。组合运作方面，本基金使用量化选股策略构建中证 A500 指数增强组合，保持了相对均衡的因子配置，控制了组合相对基准在风格、行业、个股上的偏离。成立以来市场风格极致分化，组合超配的低估值、高质量、低波动风格整体表现较差，同时对科技成长类股票的配置比例不足，在风格和选股上都形成拖累，开放申赎以来，净值收益率落后于业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 A500 指数量化增强 A 类份额净值增长率为 4.73%，同期业绩比较基准收益率为 5.28%。本报告期汇添富中证 A500 指数量化增强 C 类份额净值增长率为 4.66%，同期业绩比较基准收益率为 5.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

本基金将继续基于量化模型挑选个股，保持相对中证 A500 在风格和行业上的均衡配置。中证 A500 指数作为行业均衡型宽基指数，注重新质生产力领域，覆盖 A 股市场各行业龙头，兼具大盘稳健与成长弹性，具备较好的长期投资价值。未来将继续推进量化选股模型和风险

控制模型的迭代优化，提高对市场风格变化的应对能力，提升超额收益的稳定性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；同一类别内每一基金份额享有同等分配权；基金管理人可于每年五月和十一月最后一个工作日对基金相对业绩比较基准的超额收益率和/或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业绩比较基准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，本基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	45,121,602.57
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	614,318,694.77
其中：股票投资		614,285,693.25
基金投资		—

债券投资		33,001.52
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		300,142.49
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		659,740,439.83
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 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		2,374,914.84
应付管理人报酬		504,100.26
应付托管费		126,025.07
应付销售服务费		47,452.60
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	6.4.7.7	126,614.80
负债合计		3,179,107.57
净资产：		
实收基金	6.4.7.8	627,080,665.90
未分配利润	6.4.7.9	29,480,666.36
净资产合计		656,561,332.26
负债和净资产总计		659,740,439.83

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 627,080,665.90 份。本基金下属汇添富中证 A500 指数量化增强 A 基金份额净值 1.0473 元，基金份额总额 388,736,111.22 份；本基金下属汇添富中证 A500 指数量化增强 C 基金份额净值 1.0466 元，基金份额总额

238,344,554.68 份。

2、本基金合同于 2026 年 03 月 03 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2026 年 06 月 30 日数据，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 03 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 03 月 03 日（基金合 同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		73,601,306.19
1.利息收入		2,025,761.82
其中：存款利息收入	6.4.7.10	2,025,761.82
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）		52,831,414.52
其中：股票投资收益	6.4.7.11	45,707,630.35
基金投资收益	6.4.7.12	—
债券投资收益	6.4.7.13	1.52
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	7,123,782.65
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	17,900,431.55
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	843,698.30
减：二、营业总支出		4,805,493.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,583,219.40
其中：暂估管理人报酬		—
2. 托管费	6.4.10.2.2	895,804.88
3. 销售服务费		267,258.49
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		-
8. 其他费用	6.4.7.21	59,210.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,795,813.02
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,795,813.02
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		68,795,813.02

注：本基金合同于 2026 年 03 月 03 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2,114,675,141.49	-	2,114,675,141.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,487,594,475.59	29,480,666.36	-1,458,113,809.23
（一）、综合收益总额	-	68,795,813.02	68,795,813.02
（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）	-1,487,594,475.59	-39,315,146.66	-1,526,909,622.25
其中：1.基金申购款	170,929,668.01	2,651,522.46	173,581,190.47
2.基金赎回款	-1,658,524,143.60	-41,966,669.12	-1,700,490,812.72
（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	627,080,665.90	29,480,666.36	656,561,332.26

注：本基金合同于 2026 年 03 月 03 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

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

汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2025〕2044 号文《关于准予汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。本基金募集期间为 2026 年 2 月 2 日起至 2026 年 2 月 27 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 2,113,873,916.32 元，在募集期间产生的利息为人民币 801,225.17 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,114,675,141.49 元，折合 2,114,675,141.49 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（2026）验字第 70015647_B08 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于 2026 年 3 月 3 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时

计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,采用公允价值进行后续计量,所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产,采用实际利率法确认利息收入,其终止确认、修改或减值产生的利得或损失,均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础,对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项,本基金运用简化计量方法,按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产,本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加,如果信用风险自初始确认后未显著增加,处于第一阶段,本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础,通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险,以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括:通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值,以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时,该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,

且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大

事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8)其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、基金管理人可于每年五月和十一月最后一个工作日对基金相对业绩比较基准的超额收益率和/或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；

5、当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准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，本基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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	4,642,516.15
等于：本金	4,640,929.29
加：应计利息	1,586.86
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	40,479,086.42
等于：本金	40,478,192.01
加：应计利息	894.41
减：坏账准备	-
合计	45,121,602.57

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		596,385,261.70	-	614,285,693.25	17,900,431.55
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	33,000.00	1.52	33,001.52	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	33,000.00	1.52	33,001.52	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		596,418,261.70	1.52	614,318,694.77	17,900,431.55

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

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	7,137.90
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	31,579.20
应付信息披露费	27,631.20
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	60,266.50
合计	126,614.80

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 A500 指数量化增强 A		
项目	本期 2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,530,503,737.88	1,530,503,737.88
本期申购	35,868,353.27	35,868,353.27
本期赎回（以“-”号填列）	-1,177,635,979.93	-1,177,635,979.93
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	388,736,111.22	388,736,111.22
汇添富中证 A500 指数量化增强 C		
项目	本期 2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	584,171,403.61	584,171,403.61
本期申购	135,061,314.74	135,061,314.74
本期赎回（以“-”号填列）	-480,888,163.67	-480,888,163.67
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	238,344,554.68	238,344,554.68

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

2、本基金合同于 2026 年 03 月 03 日生效，募集期间净认购人民币金额为 2,113,873,916.32 元，基金合同生效日的人民币基金份额总额为 2,114,675,141.49 份，其中认购资金利息折合 801,225.17 份人民币基金份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 A500 指数量化增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	34,550,219.52	12,428,824.35	46,979,043.87
本期基金份额交易产生的变动数	-12,602,795.78	-16,003,896.56	-28,606,692.34
其中：基金申购款	1,068,237.43	-263,804.39	804,433.04

基金赎回款	-13,671,033.21	-15,740,092.17	-29,411,125.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,947,423.74	-3,575,072.21	18,372,351.53
汇添富中证 A500 指数量化增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	16,345,161.95	5,471,607.20	21,816,769.15
本期基金份额交易产生的变动数	-3,046,071.66	-7,662,382.66	-10,708,454.32
其中：基金申购款	5,257,296.45	-3,410,207.03	1,847,089.42
基金赎回款	-8,303,368.11	-4,252,175.63	-12,555,543.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,299,090.29	-2,190,775.46	11,108,314.83

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	2,017,943.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,483.98
结算备付金利息收入	-
其他	333.94
合计	2,025,761.82

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 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,184,786,603.48
减：卖出股票成本总额	1,137,786,022.10
减：交易费用	1,292,951.03
买卖股票差价收入	45,707,630.35

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 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1.52
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	1.52

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

	月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,123,782.65
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	7,123,782.65

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 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	17,900,431.55
——股票投资	17,900,431.55
——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	17,900,431.55

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	843,698.30
替代损益	—
其他	—
合计	843,698.30

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 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	31,579.20

信息披露费	27,631.20
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	59,210.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人,基金销售机构,基金注册登记机构
中国农业银行股份有限公司（"农业银行"）	基金托管人,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

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,583,219.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,750,483.21
应支付基金管理人的净管理费	1,832,736.19

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足造成

自动支付无法进行，基金管理人应另行出具划款指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	895,804.88

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足造成自动支付无法进行，基金管理人应另行出具划款指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 A500 指 数量化增强 A	汇添富中证 A500 指 数量化增强 C	合计
中国农业银行股份有限公司	—	223,166.68	223,166.68
合计	—	223,166.68	223,166.68

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 0.20%。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。对于确认为基金财产支付的销售服务费，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金管理人应确保支付当日账户余额充足，如因资金余额不足造成自动支付无法进行，基金管理人应另行出具划款指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

其中，对于投资者通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额所计提的销售服务费或者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）以后继续计提的 C 类基金份额销售服务费，将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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末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：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 03 月 03 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	4,642,516.15	2,017,943.90

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：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	3,847	38,931.64	106,677.31	
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	

688797	臻宝科技	2026年06月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	
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	330	33,000.00	33,001.52	

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	4,000	1,775,466.50	3,518,120.00	

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	45,121,602.57	-	-	-	-	-	45,121,602.57
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-

交易性金融资产	-	-	33,001.52	-	-	614,285,693.25	614,318,694.77
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	-	-	-	-	-	300,142.49	300,142.49
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	45,121,602.57	-	33,001.52	-	-	614,585,835.74	659,740,439.83
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	-	-	-	-	-	2,374,914.84	2,374,914.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	504,100.26	504,100.26
应付托管费	-	-	-	-	-	126,025.07	126,025.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	47,452.60	47,452.60
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	-	-	-	-	-	126,614.8	126,614.8

						0	0
负债总计	-	-	-	-	-	3,179,107.57	3,179,107.57
利率敏感度缺口	45,121,602.57	-	33,001.52	-	-	611,406,728.17	656,561,332.26

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	614,285,693.25	93.56
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产－债券投资	33,001.52	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	614,318,694.77	93.57

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
	中证 A500 上涨 5%	21,027,710.98
	中证 A500 下跌 5%	-21,027,710.98

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	610,548,374.85
第二层次	3,551,121.52
第三层次	219,198.40
合计	614,318,694.77

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	614,285,693.25	93.11
	其中：股票	614,285,693.25	93.11
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	33,001.52	0.01
	其中：债券	33,001.52	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	45,121,602.57	6.84
8	其他各项资产	300,142.49	0.05
9	合计	659,740,439.83	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	888,746.00	0.14
B	采矿业	30,978,581.75	4.72
C	制造业	363,955,503.76	55.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,058,146.00	1.84
E	建筑业	1,868,906.00	0.28
F	批发和零售业	3,135,560.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	7,256,230.00	1.11
H	住宿和餐饮业	137,592.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,555,562.60	4.81
J	金融业	50,597,881.20	7.71
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	2,685,164.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	7,097,417.57	1.08
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	186,340.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	8,715.00	0.00
S	综合	—	—
	合计	512,410,345.88	78.04

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	598,368.00	0.09
B	采矿业	1,313,166.00	0.20
C	制造业	79,249,848.37	12.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,558,632.00	0.39
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	1,614,753.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,676,462.00	0.26
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,974,686.00	1.37
J	金融业	2,265,594.00	0.35
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	519,176.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	2,770,763.00	0.42
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	333,899.00	0.05
S	综合	—	—
	合计	101,875,347.37	15.52

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	22,205	28,200,350.00	4.30
2	300750	宁德时代	53,700	21,104,637.00	3.21
3	600519	贵州茅台	11,800	13,988,782.00	2.13
4	300502	新易盛	22,580	13,706,060.00	2.09
5	601318	中国平安	235,800	11,257,092.00	1.71
6	688256	寒武纪科技	6,324	10,090,258.20	1.54
7	603986	兆易创新	12,000	9,780,000.00	1.49
8	601899	紫金矿业	376,200	9,457,668.00	1.44
9	002371	北方华创	9,900	8,757,144.00	1.33
10	000333	美的集团	112,500	8,497,125.00	1.29
11	002475	立讯精密	118,300	8,328,320.00	1.27
12	600036	招商银行	229,000	8,129,500.00	1.24
13	601166	兴业银行	420,700	6,966,792.00	1.06
14	688041	海光信息	18,780	6,954,234.00	1.06
15	688012	中微半导体设备	14,301	6,700,018.50	1.02
16	688981	中芯国际	40,414	6,418,551.48	0.98

17	600900	长江电力	227,200	6,013,984.00	0.92
18	688008	澜起科技	18,206	5,642,039.40	0.86
19	603259	药明康德	44,507	5,541,566.57	0.84
20	600030	中信证券	191,400	5,498,922.00	0.84
21	002384	东山精密	19,800	5,194,530.00	0.79
22	600276	恒瑞医药	96,240	5,008,329.60	0.76
23	688498	源杰科技	2,500	4,715,000.00	0.72
24	300274	阳光电源	28,800	4,579,776.00	0.70
25	300476	胜宏科技	12,700	4,399,661.00	0.67
26	600183	生益科技	24,600	4,265,640.00	0.65
27	002415	海康威视	123,300	4,216,860.00	0.64
28	000725	京东方 A	477,000	4,140,360.00	0.63
29	002463	沪电股份	24,395	3,727,556.00	0.57
30	601398	工商银行	519,500	3,672,865.00	0.56
31	600031	三一重工	212,400	3,670,272.00	0.56
32	300408	三环集团	21,700	3,621,730.00	0.55
33	000792	盐湖股份	119,300	3,601,667.00	0.55
34	002916	深南电路	7,700	3,525,830.00	0.54
35	688072	拓荆科技	4,000	3,518,120.00	0.54
36	600309	万华化学	51,200	3,502,592.00	0.53
37	600406	国电南瑞	151,120	3,453,092.00	0.53
38	600111	北方稀土	70,400	3,382,720.00	0.52
39	600150	中国船舶	98,500	3,328,315.00	0.51
40	601088	中国神华	82,100	3,205,184.00	0.49
41	600887	伊利股份	133,200	3,191,472.00	0.49
42	603993	洛阳钼业	181,300	3,181,815.00	0.48
43	000338	潍柴动力	114,800	3,128,300.00	0.48
44	000651	格力电器	81,600	3,060,000.00	0.47
45	601728	中国电信	587,300	3,048,087.00	0.46
46	688002	睿创微纳	19,655	3,040,431.95	0.46
47	600660	福耀玻璃	60,002	3,026,500.88	0.46
48	300059	东方财富	144,300	2,940,834.00	0.45
49	603799	华友钴业	60,600	2,924,556.00	0.45
50	601211	国泰海通	160,496	2,921,027.20	0.44
51	600489	中金黄金	152,775	2,757,588.75	0.42
52	002273	水晶光电	77,500	2,749,700.00	0.42
53	601727	上海电气	381,300	2,669,100.00	0.41
54	600487	亨通光电	23,900	2,613,226.00	0.40
55	000538	云南白药	54,930	2,602,034.10	0.40
56	000425	徐工机械	316,200	2,558,058.00	0.39
57	000807	云铝股份	114,600	2,537,244.00	0.39
58	688347	华虹宏力半 导体	7,500	2,522,250.00	0.38

59	601360	三六零	279,900	2,432,331.00	0.37
60	600795	国电电力	518,400	2,420,928.00	0.37
61	002532	天山铝业	222,100	2,383,133.00	0.36
62	600176	中国巨石	32,600	2,375,888.00	0.36
63	601328	交通银行	368,400	2,368,812.00	0.36
64	300394	天孚通信	7,800	2,360,904.00	0.36
65	002340	格林美	352,324	2,328,861.64	0.35
66	601877	正泰电器	92,800	2,326,496.00	0.35
67	600050	中国联通	575,500	2,302,000.00	0.35
68	300458	全志科技	58,100	2,292,626.00	0.35
69	600460	士兰微	41,800	2,284,788.00	0.35
70	600089	特变电工	100,900	2,270,250.00	0.35
71	002414	高德红外	170,700	2,263,482.00	0.34
72	300014	亿纬锂能	34,700	2,256,541.00	0.34
73	300699	光威复材	78,614	2,252,291.10	0.34
74	300604	长川科技	6,500	2,219,230.00	0.34
75	002594	比亚迪	27,600	2,199,720.00	0.34
76	000423	东阿阿胶	48,000	2,177,280.00	0.33
77	000063	中兴通讯	60,100	2,175,019.00	0.33
78	002027	分众传媒	442,900	2,143,636.00	0.33
79	600690	海尔智家	104,600	2,134,886.00	0.33
80	300124	汇川技术	31,900	2,115,927.00	0.32
81	002065	东华软件	295,000	2,106,300.00	0.32
82	601600	中国铝业	246,100	2,022,942.00	0.31
83	300223	北京君正	8,100	2,016,090.00	0.31
84	601601	中国太保	69,500	1,982,140.00	0.30
85	601857	中国石油	226,600	1,966,888.00	0.30
86	601018	宁波港	618,000	1,946,700.00	0.30
87	601766	中国中车	356,800	1,855,360.00	0.28
88	000001	平安银行	182,100	1,830,105.00	0.28
89	300475	香农芯创	6,100	1,830,000.00	0.28
90	002600	领益智造	104,400	1,810,296.00	0.28
91	002602	世纪华通	122,900	1,732,890.00	0.26
92	002156	通富微电	22,800	1,729,836.00	0.26
93	603659	璞泰来	59,500	1,721,335.00	0.26
94	600886	国投电力	127,500	1,697,025.00	0.26
95	601668	中国建筑	388,100	1,684,354.00	0.26
96	688525	佰维存储	3,400	1,682,082.00	0.26
97	601816	京沪高铁	362,600	1,642,578.00	0.25
98	300857	协创数据	4,800	1,631,520.00	0.25
99	002493	荣盛石化	151,200	1,625,400.00	0.25
100	600741	华域汽车	102,300	1,587,696.00	0.24
101	601225	陕西煤业	78,000	1,587,300.00	0.24

102	000683	博源化工	271,500	1,563,840.00	0.24
103	002049	紫光国微	17,600	1,562,000.00	0.24
104	000988	华工科技	8,400	1,550,724.00	0.24
105	600941	中国移动	18,000	1,550,340.00	0.24
106	301308	江波龙	2,200	1,548,360.00	0.24
107	603606	东方电缆	36,740	1,525,077.40	0.23
108	601100	恒立液压	13,900	1,495,084.00	0.23
109	300054	鼎龙股份	14,100	1,494,177.00	0.23
110	603501	豪威集团	15,700	1,489,145.00	0.23
111	000975	山金国际	87,200	1,482,400.00	0.23
112	002241	歌尔股份	65,100	1,466,703.00	0.22
113	600028	中国石化	320,300	1,428,538.00	0.22
114	002352	顺丰控股	45,100	1,409,826.00	0.21
115	002028	思源电气	8,100	1,401,300.00	0.21
116	600547	山东黄金	57,800	1,334,602.00	0.20
117	601216	君正集团	297,100	1,325,066.00	0.20
118	002008	大族激光	8,800	1,320,968.00	0.20
119	600711	盛屯矿业	120,400	1,320,788.00	0.20
120	600019	宝钢股份	241,200	1,309,716.00	0.20
121	002236	大华股份	79,300	1,307,657.00	0.20
122	600372	中航机载	119,800	1,299,830.00	0.20
123	688396	华润微电子	12,600	1,229,130.00	0.19
124	600885	宏发股份	35,600	1,227,844.00	0.19
125	600938	中国海油	44,800	1,216,320.00	0.19
126	600522	中天科技	19,800	1,201,464.00	0.18
127	002938	鹏鼎控股	11,200	1,180,256.00	0.18
128	600499	科达制造	84,500	1,166,100.00	0.18
129	688120	华海清科	3,600	1,159,848.00	0.18
130	603288	海天味业	34,500	1,144,020.00	0.17
131	000408	藏格矿业	16,200	1,122,984.00	0.17
132	002202	金风科技	46,500	1,111,350.00	0.17
133	601628	中国人寿	31,000	1,095,850.00	0.17
134	002444	巨星科技	33,600	1,044,960.00	0.16
135	688521	芯原微电子	2,800	1,039,192.00	0.16
136	300012	华测检测	70,300	974,358.00	0.15
137	002078	太阳纸业	76,700	957,983.00	0.15
138	600988	赤峰黄金	35,700	939,624.00	0.14
139	603019	中科曙光	8,700	932,901.00	0.14
140	600584	长电科技	8,800	911,240.00	0.14
141	002517	恺英网络	55,200	897,000.00	0.14
142	002714	牧原股份	25,400	888,746.00	0.14
143	002353	杰瑞股份	5,800	884,500.00	0.13
144	300395	菲利华	6,600	882,618.00	0.13

145	600875	东方电气	30,300	871,731.00	0.13
146	000858	五 粮 液	11,700	865,800.00	0.13
147	601985	中国核电	95,300	860,559.00	0.13
148	000157	中联重科	120,100	837,097.00	0.13
149	300037	新宙邦	9,000	835,650.00	0.13
150	600018	上港集团	176,300	832,136.00	0.13
151	000963	华东医药	29,400	826,728.00	0.13
152	600418	江淮汽车	31,400	811,062.00	0.12
153	600585	海螺水泥	46,600	789,870.00	0.12
154	003816	中国广核	199,000	778,090.00	0.12
155	600570	恒生电子	35,600	754,364.00	0.11
156	600580	卧龙电驱	22,200	734,820.00	0.11
157	600066	宇通客车	27,100	726,551.00	0.11
158	000933	神火股份	33,800	716,560.00	0.11
159	600482	中国动力	21,200	695,360.00	0.11
160	000301	东方盛虹	60,000	687,000.00	0.10
161	600096	云天化	22,500	684,000.00	0.10
162	300115	长盈精密	23,700	662,178.00	0.10
163	002281	光迅科技	2,500	642,350.00	0.10
164	601058	赛轮轮胎	53,500	616,855.00	0.09
165	600196	复星医药	27,300	613,431.00	0.09
166	600352	浙江龙盛	50,500	611,555.00	0.09
167	000938	紫光股份	20,700	597,402.00	0.09
168	300759	康龙化成	20,100	581,493.00	0.09
169	688617	惠泰医疗	3,200	580,992.00	0.09
170	300390	天华新能	6,200	579,762.00	0.09
171	002555	三七互娱	30,420	574,025.40	0.09
172	002155	湖南黄金	23,800	568,106.00	0.09
173	300033	同花顺	2,320	559,120.00	0.09
174	600426	华鲁恒升	22,900	547,768.00	0.08
175	688578	艾力斯医药 科技	5,000	546,000.00	0.08
176	600415	小商品城	53,300	541,528.00	0.08
177	601012	隆基绿能	41,000	537,920.00	0.08
178	002128	电投能源	23,000	531,760.00	0.08
179	300919	中伟新材	12,100	529,375.00	0.08
180	600029	南方航空	100,700	521,626.00	0.08
181	688777	中控技术	4,400	517,000.00	0.08
182	601988	中国银行	90,000	514,800.00	0.08
183	688235	百济神州	2,011	512,020.71	0.08
184	603129	春风动力	2,000	511,600.00	0.08
185	002130	沃尔核材	25,700	487,272.00	0.07
186	300432	富临精工	23,600	474,124.00	0.07

187	300073	当升科技	9,700	465,988.00	0.07
188	002460	赣锋锂业	6,800	444,720.00	0.07
189	688676	海南金盘智能科技	5,100	431,664.00	0.07
190	002001	新 和 成	14,900	423,458.00	0.06
191	300748	金力永磁	13,400	413,390.00	0.06
192	000786	北新建材	22,000	397,980.00	0.06
193	001965	招商公路	41,400	379,224.00	0.06
194	600160	巨化股份	7,100	376,371.00	0.06
195	688188	上海柏楚电子科技	3,500	373,450.00	0.06
196	600893	航发动力	9,700	371,898.00	0.06
197	600312	平高电气	20,900	369,094.00	0.06
198	300442	润泽科技	4,300	357,201.00	0.05
199	000999	华润三九	15,800	355,342.00	0.05
200	002294	信立泰	11,100	353,979.00	0.05
201	002851	麦格米特	2,100	351,078.00	0.05
202	002064	华峰化学	36,900	350,181.00	0.05
203	600862	中航高科	19,100	344,373.00	0.05
204	600000	浦发银行	38,800	334,068.00	0.05
205	000400	许继电气	15,300	332,010.00	0.05
206	002410	广联达	40,200	328,032.00	0.05
207	601658	邮储银行	65,000	320,450.00	0.05
208	000100	TCL 科技	53,400	310,788.00	0.05
209	300136	信维通信	2,500	298,125.00	0.05
210	600085	同仁堂	12,600	291,186.00	0.04
211	601880	辽港股份	209,200	288,696.00	0.04
212	600803	新奥股份	18,200	287,560.00	0.04
213	603816	顾家家居	12,600	281,736.00	0.04
214	300972	万辰集团	1,600	277,456.00	0.04
215	300346	南大光电	2,700	250,155.00	0.04
216	600989	宝丰能源	11,700	237,861.00	0.04
217	300661	圣邦股份	1,600	229,568.00	0.03
218	601319	中国人保	30,400	205,504.00	0.03
219	300760	迈瑞医疗	1,500	203,745.00	0.03
220	603939	益丰药房	11,200	201,376.00	0.03
221	300573	兴齐眼药	4,625	188,515.00	0.03
222	600763	通策医疗	5,500	186,340.00	0.03
223	600039	四川路桥	23,600	184,552.00	0.03
224	601000	唐山港	40,300	167,245.00	0.03
225	600346	恒力石化	8,400	148,764.00	0.02
226	600258	首旅酒店	12,600	137,592.00	0.02
227	300450	先导智能	3,100	126,232.00	0.02

228	000831	中国稀土	2,200	122,078.00	0.02
229	300433	蓝思科技	2,100	112,686.00	0.02
230	600115	中国东航	17,900	68,199.00	0.01
231	688271	联影医疗	500	50,615.00	0.01
232	300144	宋城演艺	1,500	8,715.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	688728	格科微有限公司	93,700	1,971,448.00	0.30
2	002338	奥普光电	29,200	1,670,240.00	0.25
3	002077	大港股份	84,200	1,624,218.00	0.25
4	300623	捷捷微电	36,000	1,619,640.00	0.25
5	300493	润欣科技	108,300	1,614,753.00	0.25
6	688522	纳睿雷达科技	79,960	1,600,799.20	0.24
7	300563	神宇股份	56,100	1,592,679.00	0.24
8	605118	力鼎光电	45,600	1,590,984.00	0.24
9	688475	萤石网络	57,700	1,578,095.00	0.24
10	300127	银河磁体	56,100	1,567,995.00	0.24
11	688128	中国电器研究院	66,000	1,566,840.00	0.24
12	000795	英洛华	179,400	1,551,810.00	0.24
13	002017	东信和平	104,800	1,533,224.00	0.23
14	300847	中船汉光	118,350	1,531,449.00	0.23
15	600845	宝信软件	92,000	1,529,960.00	0.23
16	300722	新余国科	68,600	1,529,780.00	0.23
17	002090	金智科技	173,000	1,529,320.00	0.23
18	600685	中船防务	59,800	1,521,312.00	0.23
19	301289	国缆检测	32,300	1,518,423.00	0.23
20	603025	大豪科技	111,100	1,515,404.00	0.23
21	002651	利君股份	205,200	1,500,012.00	0.23
22	600884	杉杉股份	110,700	1,499,985.00	0.23
23	002152	广电运通	159,900	1,499,862.00	0.23
24	603858	步长制药	102,500	1,496,500.00	0.23
25	300678	中科信息	66,800	1,496,320.00	0.23

26	002516	旷达科技	265,000	1,478,700.00	0.23
27	600132	重庆啤酒	35,800	1,478,540.00	0.23
28	000895	双汇发展	65,900	1,476,160.00	0.22
29	000650	仁和药业	289,300	1,472,537.00	0.22
30	002349	精华制药	236,600	1,469,286.00	0.22
31	002454	松芝股份	306,700	1,466,026.00	0.22
32	601326	秦港股份	461,900	1,459,604.00	0.22
33	002953	日丰股份	167,200	1,457,984.00	0.22
34	301339	通行宝	142,400	1,456,752.00	0.22
35	002239	奥特佳	584,800	1,444,456.00	0.22
36	600526	菲达环保	346,500	1,424,115.00	0.22
37	000027	深圳能源	229,200	1,421,040.00	0.22
38	002593	日上集团	354,800	1,415,652.00	0.22
39	688100	威胜信息	46,024	1,407,874.16	0.21
40	605005	合兴股份	88,100	1,392,861.00	0.21
41	002690	美亚光电	96,600	1,384,278.00	0.21
42	688110	东芯股份	6,600	1,344,420.00	0.20
43	600267	海正药业	131,200	1,326,432.00	0.20
44	688230	芯导科技	16,800	1,324,008.00	0.20
45	603235	天新药业	55,200	1,228,200.00	0.19
46	603268	松发股份	8,800	1,225,664.00	0.19
47	002004	华邦健康	294,700	1,158,171.00	0.18
48	600210	紫江企业	186,500	1,156,300.00	0.18
49	600558	大西洋	230,200	1,137,188.00	0.17
50	300098	高新兴	243,000	1,115,370.00	0.17
51	000045	深纺织 A	98,500	1,038,190.00	0.16
52	300628	亿联网络	30,500	1,031,510.00	0.16
53	300613	富瀚微	12,500	1,001,000.00	0.15
54	600061	国投资本	152,300	997,565.00	0.15
55	601898	中煤能源	79,800	971,964.00	0.15
56	601218	吉鑫科技	222,100	955,030.00	0.15
57	600640	国脉文化	93,500	904,145.00	0.14
58	301202	朗威股份	27,100	903,243.00	0.14
59	300299	富春股份	182,900	896,210.00	0.14
60	002287	奇正藏药	47,100	887,364.00	0.14
61	603053	成都燃气	99,200	829,312.00	0.13
62	000009	中国宝安	131,900	821,737.00	0.13
63	600171	上海贝岭	24,300	776,142.00	0.12
64	603107	上海汽配	68,200	774,070.00	0.12
65	301048	金鹰重工	82,300	708,603.00	0.11
66	002275	桂林三金	57,300	698,487.00	0.11
67	301508	中机认检	29,000	671,060.00	0.10
68	605277	新亚电子	35,020	667,481.20	0.10

69	600506	统一股份	47,700	662,553.00	0.10
70	600598	北大荒	55,200	598,368.00	0.09
71	300627	华测导航	20,800	590,720.00	0.09
72	301215	中汽股份	112,000	581,280.00	0.09
73	300978	东箭科技	67,700	549,047.00	0.08
74	000676	智度股份	101,600	519,176.00	0.08
75	603111	康尼机电	89,200	504,872.00	0.08
76	301536	星宸科技	3,600	463,356.00	0.07
77	300822	贝仕达克	39,600	463,320.00	0.07
78	300079	数码视讯	109,600	460,320.00	0.07
79	600288	大恒科技	34,101	453,543.30	0.07
80	600919	江苏银行	41,400	446,292.00	0.07
81	000049	德赛电池	17,900	418,323.00	0.06
82	603160	汇顶科技	6,381	393,771.51	0.06
83	603638	艾迪精密	15,800	370,510.00	0.06
84	603508	思维列控	16,400	350,304.00	0.05
85	603132	金徽股份	21,900	341,202.00	0.05
86	605577	龙版传媒	37,900	333,899.00	0.05
87	001399	惠科股份	9,617	326,975.91	0.05
88	003039	顺控发展	28,000	308,280.00	0.05
89	603298	杭叉集团	10,500	250,530.00	0.04
90	002401	中远海科	20,800	241,488.00	0.04
91	600351	亚宝药业	41,200	236,900.00	0.04
92	300034	钢研高纳	13,600	233,104.00	0.04
93	300134	大富科技	26,500	226,575.00	0.03
94	601608	中信重工	47,400	226,098.00	0.03
95	600993	马应龙	10,200	220,524.00	0.03
96	601228	广州港	76,900	216,858.00	0.03
97	002255	海陆重工	21,500	211,130.00	0.03
98	600801	华新建材	13,400	209,040.00	0.03
99	603927	中科软	15,900	202,089.00	0.03
100	600211	西藏药业	5,400	201,906.00	0.03
101	300341	麦克奥迪	12,500	165,625.00	0.03
102	301277	新天地	18,800	164,500.00	0.03
103	603928	兴业股份	10,920	161,616.00	0.02
104	000682	东方电子	10,400	131,352.00	0.02
105	000513	丽珠集团	4,500	130,005.00	0.02
106	000708	中信特钢	9,600	121,152.00	0.02
107	600562	国睿科技	5,400	114,588.00	0.02
108	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
109	300690	双一科技	2,500	55,850.00	0.01
110	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产 净值比例（%）
1	300750	宁德时代	53,335,604.20	8.12
2	600519	贵州茅台	42,743,869.22	6.51
3	300308	中际旭创	33,923,995.00	5.17
4	601318	中国平安	33,842,735.00	5.15
5	601899	紫金矿业	32,073,824.00	4.89
6	600036	招商银行	23,514,255.00	3.58
7	000333	美的集团	22,116,972.00	3.37
8	300502	新易盛	19,662,089.00	2.99
9	601166	兴业银行	19,460,657.00	2.96
10	002475	立讯精密	16,915,011.00	2.58
11	600030	中信证券	16,087,879.00	2.45
12	600900	长江电力	15,886,300.00	2.42
13	603259	药明康德	14,643,380.58	2.23
14	002371	北方华创	13,507,927.00	2.06
15	600309	万华化学	12,768,726.00	1.94
16	600887	伊利股份	12,530,897.00	1.91
17	601088	中国神华	12,237,259.00	1.86
18	688041	海光信息	12,143,911.42	1.85
19	603993	洛阳钼业	12,124,208.00	1.85
20	600276	恒瑞医药	11,917,065.20	1.82

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末基金资产净值 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	占期末基金资产 净值比例（%）
1	300750	宁德时代	35,484,160.40	5.40
2	300308	中际旭创	30,915,808.00	4.71
3	600519	贵州茅台	24,418,793.50	3.72
4	601318	中国平安	18,413,380.00	2.80
5	601899	紫金矿业	17,293,761.91	2.63
6	300502	新易盛	17,228,742.00	2.62
7	002475	立讯精密	15,009,026.00	2.29

8	000333	美的集团	14,258,422.32	2.17
9	600036	招商银行	14,164,325.70	2.16
10	600030	中信证券	11,789,840.40	1.80
11	603259	药明康德	11,395,056.00	1.74
12	601166	兴业银行	11,219,638.00	1.71
13	000725	京东方 A	10,814,713.00	1.65
14	002371	北方华创	10,171,007.50	1.55
15	688012	中微半导体设备	9,888,695.55	1.51
16	600900	长江电力	9,693,593.60	1.48
17	688041	海光信息	9,565,503.72	1.46
18	600887	伊利股份	9,302,089.32	1.42
19	600584	长电科技	8,855,814.00	1.35
20	603993	洛阳钼业	8,463,985.42	1.29

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,734,171,283.80
卖出股票收入（成交）总额	1,184,786,603.48

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）	33,001.52	0.01
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	33,001.52	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	330	33,001.52	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

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—

4	应收利息	-
5	应收申购款	300,142.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	300,142.49

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:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富中证 A500 指数量化增强 A	4,682	83,027.79	11,951,482.74	3.07	376,784,628.48	96.93
汇添富中证 A500 指数量化增强 C	14,946	15,947.05	5,450,947.39	2.29	232,893,607.29	97.71
合计	19,628	31,948.27	17,402,430.13	2.78	609,678,235.77	97.22

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	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	汇添富中证 A500 指数量化增强 A	0
	汇添富中证 A500 指数量化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 A500 指数量化增强 A	0
	汇添富中证 A500 指数量化增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 A500 指数量化增强 A	汇添富中证 A500 指数量化增强 C
基金合同生效日（2026 年 03 月 03 日）基金份额总额	1,530,503,737.88	584,171,403.61
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	35,868,353.27	135,061,314.74
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,177,635,979.93	480,888,163.67
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	388,736,111.22	238,344,554.68

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	

中金财富	3	2,918,729, 702.64	100.00	513,415.15	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 (%)
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-

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	汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金发行文件	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 01 月 26 日
2	关于汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金线上直销系统认购费率执行标准的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 02 月 02 日
3	汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 03 月 04 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	关于汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 04 月 14 日
6	2025 年度汇添富基金管理股份有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026 年 04 月 30 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 06 月 06 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,上证报	2026 年 06 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日