

汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	20
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.....	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	23
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	24
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	24
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.....	24
§ 5 托管人报告.....	25
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	25
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.....	25
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.....	25
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	25
6.1 资产负债表.....	25
6.2 利润表.....	27
6.3 净资产变动表.....	28
6.4 报表附注.....	29
§ 7 投资组合报告.....	57
7.1 期末基金资产组合情况.....	57
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	58
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	59
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	63
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.....	63

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.....	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§ 8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
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.....	65
§ 9 开放式基金份额变动.....	65
§ 10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	66
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.....	67
10.8 其他重大事件.....	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
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.....	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§ 12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金		
基金简称	汇添富添添乐双盈债券		
基金主代码	017592		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2023 年 02 月 01 日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额（份）	14,158,696,666.88		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富添添乐双盈债券 A	汇添富添添乐双盈债券 C	汇添富添添乐双盈债券 E
下属分级基金的交易代码	017592	017593	026845
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	10,101,495,700.64	3,753,155,864.34	304,045,101.90

注：本基金于 2026 年 02 月 11 日新增汇添富添添乐双盈债券 E 类份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略，通过债券等固定收益类资产的投资力争平稳收益，并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报，在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。本基金采取的投资策略主要包括资产配置策略、股票精选策略、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及国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债新综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*7%+恒生指数收益率（经汇率调整）*3%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的风险与收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	(010) 66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	(010) 66105798
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		鲁伟铭	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)		
	汇添富添乐双盈债券 A	汇添富添乐双盈债券 C	汇添富添乐双盈债券 E
本期已实现收益	206,885,564.92	85,014,514.61	4,109,213.91
本期利润	150,135,597.48	65,340,946.68	417,102.08
加权平均基金份额本期利润	0.0181	0.0165	0.0021
本期加权平均净值利润率	1.50%	1.38%	0.17%
本期基金份额净值增长率	1.69%	1.49%	0.51%

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	1,566,885,563.04	521,929,491.41	46,821,967.30
期末可供分配基金份额利润	0.1551	0.1391	0.1540
期末基金资产净值	12,243,180,972.46	4,487,467,647.44	368,031,518.97
期末基金份额净值	1.2120	1.1957	1.2105
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	21.20%	19.57%	0.51%

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

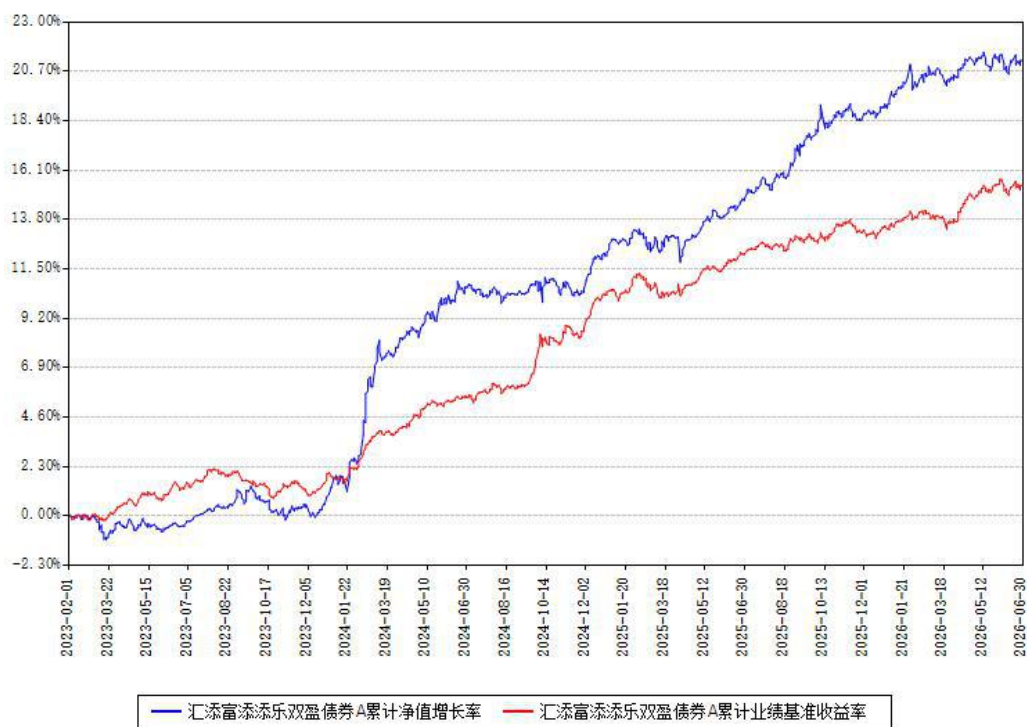
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富添添乐双盈债券 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.75%	0.16%	1.56%	0.12%	-0.81%	0.04%
过去六个月	1.69%	0.17%	1.85%	0.11%	-0.16%	0.06%
过去一年	5.68%	0.16%	2.90%	0.10%	2.78%	0.06%
过去三年	21.71%	0.18%	13.89%	0.11%	7.82%	0.07%
自基金合同生效起至今	21.20%	0.17%	15.42%	0.11%	5.78%	0.06%
汇添富添添乐双盈债券 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①－③	②－④

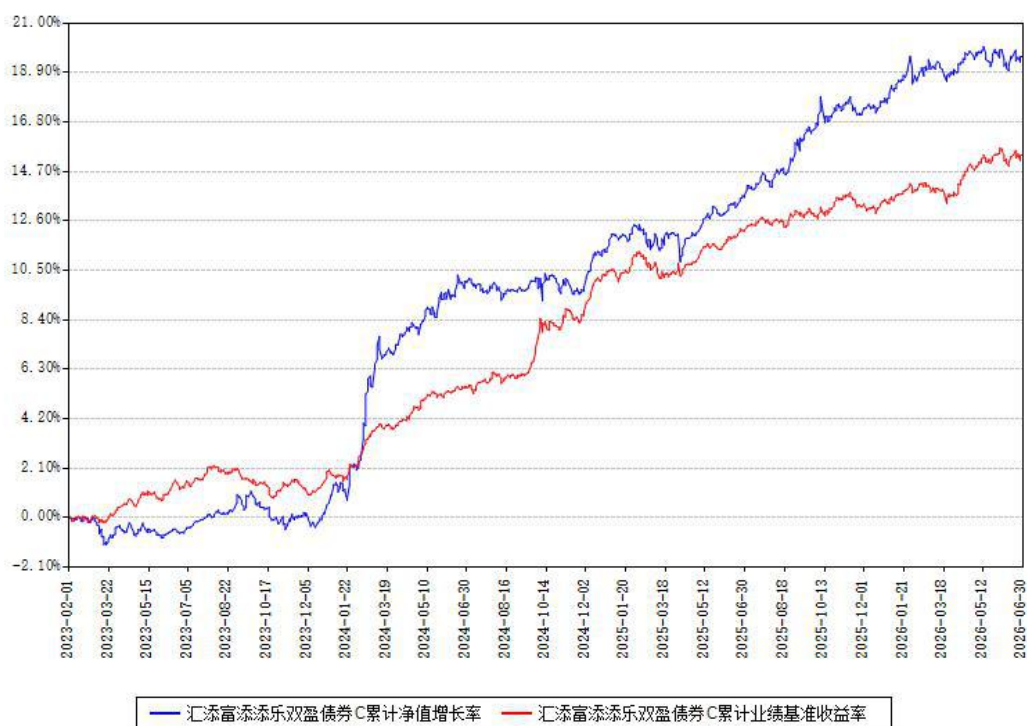
		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	0.66%	0.16%	1.56%	0.12%	-0.90%	0.04%
过去六个月	1.49%	0.17%	1.85%	0.11%	-0.36%	0.06%
过去一年	5.26%	0.16%	2.90%	0.10%	2.36%	0.06%
过去三年	20.27%	0.18%	13.89%	0.11%	6.38%	0.07%
自基金合同生效起至今	19.57%	0.17%	15.42%	0.11%	4.15%	0.06%
汇添富添乐双盈债券 E						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去三个月	0.71%	0.16%	1.56%	0.12%	-0.85%	0.04%
自基金合同生效起至今	0.51%	0.15%	1.09%	0.12%	-0.58%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

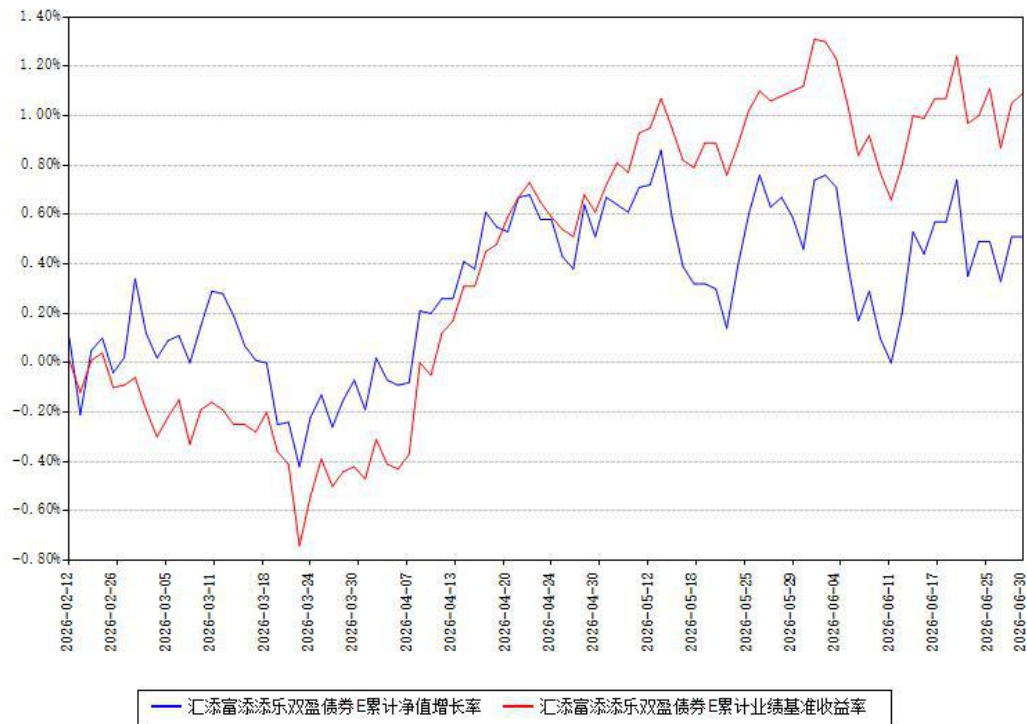
汇添富添添乐双盈债券A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富添添乐双盈债券C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富添乐双盈债券E累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023 年 02 月 01 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金于 2026 年 02 月 11 日新增 E 类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年 限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
蔡志文	本基金的基 金经理	2023 年 02 月 01 日	—	13	国籍：中国。 学历：上海财 经大学统计 学硕士。从业 资格：证券投 资基金从业 资格。从业经 历：2014 年 7 月加入汇添 富基金管理 股份有限公司任行业分 析师。2019 年 12 月 4 日 至今任汇添 富外延增长 主题股票型 证券投资基金的基金经 理。2022 年 3 月 1 日至今 任汇添富品 牌力一年持

					有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月 1 日至今任汇添富添乐双盈债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月 22 日至今任汇添富战略精选中小盘市值 3 年持有期混合型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 13 日至 2025 年 7 月 10 日任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 30 日至今任汇添富双颐债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 5 日至今任汇添富港股通红利回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月 11 日至今任汇添富价值驱动混合型证券投
--	--	--	--	--	--

					资基金的基金经理。
陈思行	本基金的基金经理	2024 年 05 月 09 日	—	15	国籍：中国。学历：复旦大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 7 月至 2012 年 9 月任方正证券投资经理；2012 年 10 月至 2016 年 7 月任光大证券高级投资经理；2016 年 9 月至 2019 年 4 月任银华基金投资经理；2019 年 5 月至 2021 年 12 月任平安养老投资经理；2021 年 12 月至 2022 年 7 月任国寿养老高级投资经理。2022 年 7 月加入汇添富基金。2022 年 8 月 23 日至 2024 年 3 月 29 日任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 8 月 23 日至 2024 年 6 月 13 日任汇

					添富鑫福债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 2 月 1 日至 2024 年 5 月 9 日任汇添富添乐双盈债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 8 月 29 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理助理。2023 年 11 月 24 日至 2025 年 8 月 26 日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助理。2024 年 4 月 9 日至 2025 年 8 月 26 日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助理。2022 年 11 月 3 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

					2022 年 11 月 25 日至 2025 年 6 月 30 日任汇添富稳健欣享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 22 日至今任汇添富添添乐双鑫债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 29 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 5 月 9 日至今任汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 10 月 29 日至 2026 年 2 月 24 日任汇添富弘悦回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 1 月 24 日至 2026 年 2 月 24 日任汇添富弘瑞回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025
--	--	--	--	--	--

					年 2 月 21 日至今任汇添富鑫享添利六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 15 日至 2026 年 5 月 29 日任汇添富弘达回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 15 日至 2026 年 5 月 29 日任汇添富弘盛回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月 13 日至今任汇添富双颐债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月 16 日至今任汇添富稳恒 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月 29 日至今任汇添富双盈回报一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

吕舒婷	本基金的基金经理助理	2026 年 01 月 16 日	—	10	国籍：中国。 学历：清华大学化学工程与技术硕士。 从业资格：证券投资基金从业资格。 从业经历：2017 年 7 月至 2019 年 10 月在兴业经济研究咨询股份有限公司工作，2019 年 11 月至 2022 年 6 月在泰康资产管理有限责任公司工作。2022 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2025 年 1 月 16 日至今任汇添富稳颐优选债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 1 月 16 日至今任汇添富双颐债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 1 月 16 日至今任汇添富稳健睿选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理。2026
-----	------------	------------------	---	----	---

					年 1 月 16 日至今任汇添富双盈回报一年持有期债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 1 月 16 日至今任汇添富添乐双鑫债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 1 月 16 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 1 月 16 日至今任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 1 月 16 日至今任汇添富稳恒 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 1 月 16 日至今任汇添富添乐双盈债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 1 月
--	--	--	--	--	--

					16 日至今任汇添富鑫享添利六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 1 月 20 日至今任汇添富增强回报债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 1 月 20 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 4 月 2 日至今任汇添富增益回报债券型证券投资基金的基金经理助理。2026 年 4 月 8 日至今任汇添富稳健欣享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
蔡志文	公募基金	7	27,938,193,428.44	2019年12月4日
	私募资产管理计划	1	555,991,820.20	2026年4月22日
	其他组合	—	—	
	合计	8	28,494,185,248.64	

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3日内、

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年中国经济呈现“K 型分化”特征。一季度稳中有进,工业生产、外贸及部分新动能领域表现较强,经济阶段性企稳;二季度延续结构性修复,但内生动能不足的问题更加突出,呈现外需强、生产韧性强、内需和融资需求偏弱的格局。结构上看,一季度全球制造业景气修复与抢出口效应支撑出口,企业端与政策性融资对社融形成支撑;二季度外贸继续超预期,半导体、汽车、船舶、电子产品等链条保持韧性,但消费、地产、民间投资及居民信贷扩张仍偏弱,居民和企业资产负债表修复偏慢。物价方面,受油价和能源化工链影响,CPI、PPI 阶段性回升并引发输入性通胀担忧,但核心需求并未明显改善。政策层面,财政政策保持稳增长定力,超长期特别国债继续支持重大战略、设备更新和消费品以旧换新;货币政策维持适度宽松,年初下调结构性工具利率,二季度通过公开市场操作、MLF 超量续作、利率走廊收窄及新增隔夜逆回购品种等方式稳定流动性预期。外部扰动方面,美伊冲

突、油价波动及美联储预期反复，成为影响通胀预期和风险偏好的关键变量。

债券市场方面，整体呈现低利率区间震荡走势，按驱动因素不同主要分为三个阶段。阶段一为年初至 2 月下旬，市场主线为权益风险偏好、机构赎回与配置需求的反复切换：年初受权益强势、基金赎回及供给扰动影响，10 年国债收益率一度上行至 1.90% 附近，随后在央行流动性呵护、货币宽松预期及机构配置力量推动下重新下行，春节前后 10Y 国债多次下破 1.80%。阶段二为 3 月至 4 月中旬，市场主线转向地缘冲突和输入性通胀预期：美伊冲突推升油价，叠加进出口、通胀及 1-2 月经济数据阶段性超预期，长端和超长端承压，30 年国债收益率一度上行至 2.40% 附近；但同业存款自律管理落地、资金面维持宽松，中短端表现较强，曲线明显陡峭化。阶段三为 4 月中旬至 6 月底，市场进入降波后的窄幅震荡：内需偏弱、金融数据结构不佳及央行净投放推动收益率震荡下行，10Y 国债一度逼近 1.70%，30Y 国债下探至 2.20% 附近；6 月后资金利率回升、央行地量操作、进出口数据偏强及季末止盈带来阶段性调整，但陆家嘴论坛及隔夜逆回购工具落地稳定了流动性预期。曲线形态上看，一季度长短端分化显著、曲线陡峭化，二季度随着长端补涨和资金面预期反复，期限利差总体在窄幅区间内震荡。品种上看，信用债受益于票息需求和资产荒延续，表现整体稳健，信用利差维持低位并进一步压缩。报告期内，债券方面，组合合理运用杠杆，根据市场波动积极调整久期，组合重点配置在中高等级信用债券，同时适度参与利率债券的交易。

权益市场方面，整体呈现宽幅震荡、极致结构性分化格局。一季度 A 股震荡上行，港股受海外流动性、资金流出压制表现偏弱；二季度受海外通胀反复、地缘风险扰动，全球市场出现阶段性回调，随后国内政策持续发力、AI 产业景气向上，A 股快速修复，港股则震荡磨底、反弹力度有限。回顾 2026 年上半年，A 股市场表现显著强于港股市场，上证指数上涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，恒生指数小幅收跌。市场结构性差异十分突出。分行业看，电子、通信、电力设备等科技成长行业表现居前，而房地产、部分消费、传统公用板块表现相对落后。报告期内，组合坚持均衡思路，在把握中国先进制造业出口主线的同时，继续保留低估值资源品与低波红利资产作为底仓，兼顾成长弹性与组合防御属性。我们继续看好以“铜铝金油煤”为代表的资源股，在全球经济逐步企稳复苏，美元货币持续超发贬值的背景下，供需格局紧张的资源品均有较大的价格上涨空间。报告期内，权益方面，组合维持了不到 10% 的权益仓位，试图通过行业比较和精选优质公司在权益上获得超越市场平均水平的收益率，同时保持整体较低的回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富添乐双盈债券 A 类份额净值增长率为 1.69%，同期业绩比较基准收益率为 1.85%。本报告期汇添富添乐双盈债券 C 类份额净值增长率为 1.49%，同期业绩比较基准收益率为 1.85%。本报告期内新增汇添富添乐双盈债券 E 类份额，自实际有资产之日起至报告期末的份额净值增长率为 0.51%，同期业绩比较基准收益率为 1.09%。

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，宏观经济预计仍处于结构性弱修复通道，“K 型分化”特征或将延续，增长动能呈现外需韧性、财政托底、内需磨底的组合。节奏上，三季度初预期受出口边际回落、地产链条偏弱以及居民资产负债表修复缓慢影响，经济仍可能承压；三季度后段至四季度，若专项债、超长期特别国债等财政资金加快落地，基建和公共消费有望对冲地产拖累，经济动能或温和修复。物价方面，CPI 中枢预计维持温和，PPI 受能源价格、低基数和上游行业景气影响仍有波动，但在终端需求偏弱和传导不畅背景下，持续再通胀压力有限。政策组合预计仍以财政发力和货币配合为主：财政端关注增量政策和资金使用节奏，货币端在稳定银行负债成本、呵护流动性和完善短端利率框架之间保持平衡，资金面大概率维持均衡偏松而非过度宽松。外部来看，美伊局势、油价、美联储政策预期以及美国贸易政策仍可能阶段性扰动风险偏好和国内资产定价。

债券市场方面，下半年预计维持低利率窄幅震荡格局不变，但趋势性机会或弱于上半年，波段性和结构性机会重要性上升。节奏方面，7 月以后市场在隔夜逆回购利率落地和资金宽松预期重定价后，主线或重新回到经济基本面、财政政策节奏及政府债供给；若三季度末财政发力和经济数据阶段性改善，可能对债券市场形成一定压制，但在内需修复偏慢、融资需求不足和再通胀风险有限的背景下，收益率大幅上行空间或相对受限。曲线方面，短端受资金利率和央行操作影响更大，长端则在低利率位置面临供给、止盈、海外利率和政策预期扰动，预计期限利差维持区间震荡。信用债方面，中高等级利差已处于历史低位，进一步系统性压缩空间有限，信用债越来越呈现利率化特征，需更加重视流动性和估值波动。投资策略上，久期策略以区间操作为主，市场调整窗口可适度积极，总体优选高等级、高流动性的优质信用品种，适度参与利率债波段机会。

股票市场方面，下半年我们继续看好三大主线：其一，上游资源板块价值重估。当前实物资源消耗增速持续高于经济整体增速，上游资源稀缺性与配置价值持续凸显。组合重点配置黄金、铜、石油、煤炭等细分领域优质龙头企业，把握资源供需格局改善带来的投资机遇。其二，高端制造出海成长方向。国内制造业逐步摆脱内卷格局，凭借突出的质价比优势持续

提升全球市场份额。依托完善的产业链配套体系与工程师红利，电力设备、造船、汽车、通信设备、半导体设备等行业延续高增长态势，盈利质量持续优化，成为组合核心增长支柱。其三，传统行业格局优化红利。电解铝、银行、家电、化工、集运等传统细分行业历经持续供给侧出清，行业竞争格局趋于良性有序。头部企业凭借规模、技术、成本多重核心优势，持续巩固行业定价权，市场集中度稳步提升，行业整体抗风险能力与盈利稳定性显著增强。展望后市，我们对权益市场长期走势保持乐观。当前优质资产的核心价值持续凸显，市场短期波动不改中长期上行趋势，产业升级、资源价值重塑、内需稳步复苏的核心逻辑清晰明确，优质龙头企业具备充足的成长韧性与估值修复空间。

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 类和 E 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	42,590,849.22	3,068,621.39
结算备付金		72,560,880.50	39,773,388.15
存出保证金		543,134.32	231,502.25
交易性金融资产	6.4.7.2	16,735,573,982.07	13,153,704,210.68
其中：股票投资		1,410,913,402.93	1,361,119,620.44
基金投资		-	-

债券投资		15,324,660,579.14	11,792,584,590.24
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	490,047,308.22	240,064,208.22
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		47,397,554.70	160,082,155.96
应收股利		2,251,149.58	—
应收申购款		109,985,902.19	217,486,027.01
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		17,500,950,760.80	13,814,410,113.66
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		212,710,964.41	434,422,697.93
应付清算款		65,198,047.09	136,557,123.20
应付赎回款		111,019,056.58	184,916,629.67
应付管理人报酬		7,202,369.62	5,619,184.99
应付托管费		2,880,947.83	2,247,674.00
应付销售服务费		1,644,879.43	1,695,176.86
应付投资顾问费		—	—
应交税费		270,166.94	195,606.23
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.7	1,344,190.03	828,757.60
负债合计		402,270,621.93	766,482,850.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	14,158,696,666.88	10,991,644,290.71
未分配利润	6.4.7.9	2,939,983,471.99	2,056,282,972.47
净资产合计		17,098,680,138.87	13,047,927,263.18
负债和净资产总计		17,500,950,760.80	13,814,410,113.66

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 14,158,696,666.88 份。本基金下属汇添富添乐双盈债券 A 基金份额净值 1.2120 元，基金份额总额 10,101,495,700.64 份；本基金下属汇添富添乐双盈债券 C 基金份额净值 1.1957 元，基金份额总额 3,753,155,864.34 份；

本基金下属汇添富添添乐双盈债券 E 基金份额净值 1.2105 元, 基金份额总额 304,045,101.90 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日 至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		278,358,893.41	131,640,134.81
1.利息收入		5,864,379.14	750,004.84
其中：存款利息收入	6.4.7.10	362,360.12	322,666.49
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,502,019.02	427,338.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		351,991,005.27	104,994,569.34
其中：股票投资收益	6.4.7.11	191,019,732.96	7,791,708.46
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	143,593,255.98	85,704,608.35
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	-	-1,242,584.80
股利收益	6.4.7.17	17,378,016.33	12,740,837.33
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	-80,115,647.20	25,599,728.34
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	619,156.20	295,832.29
减：二、营业总支出		62,465,247.17	33,127,935.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	36,868,280.73	14,850,599.72
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	14,747,312.24	5,940,239.90
3. 销售服务费		9,558,523.17	5,411,358.30
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		988,928.96	6,683,072.19
其中：卖出回购金融资产支出		988,928.96	6,683,072.19
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		139,252.42	92,488.28

8. 其他费用	6.4.7.21	162,949.65	150,177.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		215,893,646.24	98,512,199.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		215,893,646.24	98,512,199.25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		215,893,646.24	98,512,199.25

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,991,644,290.71	2,056,282,972.47	13,047,927,263.18
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	10,991,644,290.71	2,056,282,972.47	13,047,927,263.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,167,052,376.17	883,700,499.52	4,050,752,875.69
（一）、综合收益总额	-	215,893,646.24	215,893,646.24
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	3,167,052,376.17	667,806,853.28	3,834,859,229.45
其中：1.基金申购款	18,106,393,897.83	3,670,726,464.31	21,777,120,362.14
2.基金赎回款	-14,939,341,521.66	-3,002,919,611.03	-17,942,261,132.69
（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	14,158,696,666.88	2,939,983,471.99	17,098,680,138.87

资产			
项目	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,537,194,114.49	314,254,530.36	2,851,448,644.85
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2,537,194,114.49	314,254,530.36	2,851,448,644.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,285,388,889.19	374,011,332.40	2,659,400,221.59
（一）、综合收益总额	-	98,512,199.25	98,512,199.25
（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）	2,285,388,889.19	275,499,133.15	2,560,888,022.34
其中：1.基金申购款	10,734,803,230.71	1,374,562,427.62	12,109,365,658.33
2.基金赎回款	-8,449,414,341.52	-1,099,063,294.47	-9,548,477,635.99
（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	4,822,583,003.68	688,265,862.76	5,510,848,866.44

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

汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2022〕2787 号文《关于准予汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 2 月 1 日生效。首次设立基金募集规模为 777,649,047.25 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 60466941_B10 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自 2026 年 2 月 11 日起，本基金增设 E 类基金份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

2. 增值税

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基

金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

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

5.个人所得税

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

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

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

6.境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
----	-------------------------

活期存款	42,590,849.22
等于：本金	42,583,650.45
加：应计利息	7,198.77
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	42,590,849.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,327,337,884.25	—	1,410,913,402.93	83,575,518.68
贵金属投资—金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	3,767,680,265.72	36,785,437.22	3,805,068,334.82	602,631.88
	银行间市场	11,416,591,290.22	97,142,244.32	11,519,592,244.32	5,858,709.78
	其他	—	—	—	—
	合计	15,184,271,555.94	133,927,681.54	15,324,660,579.14	6,461,341.66
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		16,511,609,440.19	133,927,681.54	16,735,573,982.07	90,036,860.34

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	490,047,308.22	—
银行间市场	—	—
合计	490,047,308.22	—

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	2,543.04
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	1,233,168.04
其中：交易所市场	1,193,378.04
银行间市场	39,790.00
应付利息	—
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	—
应付账户维护费	9,300.00
应付汇划费	—
应付上市费	—

应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	1,344,190.03

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富添添乐双盈债券 A		
项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,206,644,252.56	7,206,644,252.56
本期申购	12,325,460,551.51	12,325,460,551.51
本期赎回（以“-”号填列）	-9,430,609,103.43	-9,430,609,103.43
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	10,101,495,700.64	10,101,495,700.64
汇添富添添乐双盈债券 C		
项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,785,000,038.15	3,785,000,038.15
本期申购	5,340,871,367.41	5,340,871,367.41
本期赎回（以“-”号填列）	-5,372,715,541.22	-5,372,715,541.22
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	3,753,155,864.34	3,753,155,864.34
汇添富添添乐双盈债券 E		
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	-	-
本期申购	440,061,978.91	440,061,978.91
本期赎回（以“-”号填列）	-136,016,877.01	-136,016,877.01
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	304,045,101.90	304,045,101.90

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

汇添富添添乐双盈债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	944,978,449.73	437,366,086.31	1,382,344,536.04
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	944,978,449.73	437,366,086.31	1,382,344,536.04
本期利润	206,885,564.92	-56,749,967.44	150,135,597.48
本期基金份额交易产生的变动数	415,021,548.39	194,183,589.91	609,205,138.30
其中：基金申购款	1,741,235,539.16	815,584,596.73	2,556,820,135.89
基金赎回款	-1,326,213,990.77	-621,401,006.82	-1,947,614,997.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,566,885,563.04	574,799,708.78	2,141,685,271.82
汇添富添添乐双盈债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	445,630,976.15	228,307,460.28	673,938,436.43
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	445,630,976.15	228,307,460.28	673,938,436.43
本期利润	85,014,514.61	-19,673,567.93	65,340,946.68
本期基金份额交易产生的变动数	-8,715,999.35	3,748,399.34	-4,967,600.01
其中：基金申购款	666,552,012.75	355,163,077.95	1,021,715,090.70
基金赎回款	-675,268,012.10	-351,414,678.61	-1,026,682,690.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	521,929,491.41	212,382,291.69	734,311,783.10
汇添富添添乐双盈债券 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,109,213.91	-3,692,111.83	417,102.08
本期基金份额交易产生的变动数	42,712,753.39	20,856,561.60	63,569,314.99
其中：基金申购款	62,672,762.60	29,518,475.12	92,191,237.72

基金赎回款	-19,960,009.21	-8,661,913.52	-28,621,922.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,821,967.30	17,164,449.77	63,986,417.07

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	171,057.29
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	183,782.29
其他	7,520.54
合计	362,360.12

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	2,127,362,229.73
减：卖出股票成本总额	1,932,555,231.89
减：交易费用	3,787,264.88
买卖股票差价收入	191,019,732.96

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	160,569,675.12
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	-16,976,419.14
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	143,593,255.98
----	----------------

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,267,378,637.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,256,898,688.83
减：应计利息总额	27,407,802.55
减：交易费用	48,565.00
买卖债券差价收入	-16,976,419.14

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	17,378,016.33
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	17,378,016.33

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	-80,115,647.20
——股票投资	-122,422,259.22
——债券投资	42,306,612.02
——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	-80,115,647.20

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	619,156.20
替代损益	—
其他	—
合计	619,156.20

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	27,900.00
银行费用	19,665.28
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	16,205.42
合计	162,949.65

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
中国工商银行股份有限公司("工商银行")	基金托管人,基金销售机构
东方证券股份有限公司("东方证券")	基金管理人的股东,基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	1,192,588,108.93	71.41

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	161,116,143.63	85.22	2,275,813,677.59	90.37

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	40,020,109,000.00	50.54

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

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

		的比例（%）	额	总额的比例（%）
东方证券	569,274.03	71.82	61,058.47	23.58

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	36,868,280.73	14,850,599.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,936,374.86	5,863,827.61
应支付基金管理人的净管理费	21,931,905.87	8,986,772.11

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026年01月01日至2026 年06月30日	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	14,747,312.24	5,940,239.90

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。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			
	汇添富添添乐双盈债券 A	汇添富添添乐双盈债券 C	汇添富添添乐双盈债券 E	合计
中国工商银行股份有限公司	-	5,022,375.65	-	5,022,375.65
汇添富基金管理股份有限公司	-	225,165.72	51.65	225,217.37
东方证券股份有限公司	-	109,695.23	-	109,695.23
合计	-	5,357,236.60	51.65	5,357,288.25
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			
	汇添富添添乐双盈债券 A	汇添富添添乐双盈债券 C	汇添富添添乐双盈债券 E	合计
中国工商银行股份有限公司	-	3,652,938.57	-	3,652,938.57
汇添富基金管理股份有限公司	-	209,413.28	-	209,413.28
东方证券股份有限公司	-	9,179.14	-	9,179.14
合计	-	3,871,530.99	-	3,871,530.99

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 0.40%，E

类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。

在通常情况下,C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

在通常情况下,E 类基金份额的销售服务费按前一日 E 类基金资产净值的 0.20%年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为 E 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 E 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	42,590,849.22	171,057.29	25,225,650.55	149,784.17

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

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	3,900	390,000.00	390,017.95	
524868	26 陕投 Y2	2026年06月26日	6个交易日	新债流通受限	100.00	100.02	300,000	30,000,000.00	30,006,049.31	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 212,710,964.41 元，于 2026 年 07 月 02 日,2026 年 07 月 03 日,2026 年 07 月 06 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制

流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	60,722,678.35	90,457,192.32
A-1 以下	—	—
未评级	—	203,365,903.65
合计	60,722,678.35	293,823,095.97

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、超短期融资券、中央票据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	49,961,884.62	—
合计	49,961,884.62	—

注：本表列示期限在一年以内的同业存单。短期信用评级 A-1 所填列的为主体评级 AAA 的同业存单，短期信用评级 A-1 以下所填列的为主体评级 AAA 以下的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	9,281,884,005.15	6,862,479,487.94
AAA 以下	21,688,270.00	10,946,317.81
未评级	5,910,403,741.02	4,625,335,688.52
合计	15,213,976,016.17	11,498,761,494.27

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	42,590,849.22	-	-	-	-	-	42,590,849.22
结算备付金	72,560,880.50	-	-	-	-	-	72,560,880.50
存出保证金	543,134.32	-	-	-	-	-	543,134.32
交易性金融资产	163,179,364.08	697,224,492.61	3,370,580,337.87	9,058,226,567.03	2,035,449,817.55	1,410,913,402.93	16,735,573,982.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-

买入返售 金融资产	490,047,3 08.22	-	-	-	-	-	490,047,3 08.22
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算 款	-	-	-	-	-	47,397,55 4.70	47,397,55 4.70
应收股利	-	-	-	-	-	2,251,149 .58	2,251,149 .58
应收申购 款	-	-	-	-	-	109,985,9 02.19	109,985,9 02.19
递延所得 税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	768,921,5 36.34	697,224,4 92.61	3,370,580 ,337.87	9,058,226 ,567.03	2,035,449 ,817.55	1,570,548 ,009.40	17,500,95 0,760.80
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	212,710,9 64.41	-	-	-	-	-	212,710,9 64.41
应付清算 款	-	-	-	-	-	65,198,04 7.09	65,198,04 7.09
应付赎回 款	-	-	-	-	-	111,019,0 56.58	111,019,0 56.58
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	7,202,369 .62	7,202,369 .62
应付托管 费	-	-	-	-	-	2,880,947 .83	2,880,947 .83
应付销售 服务费	-	-	-	-	-	1,644,879 .43	1,644,879 .43
应付投资 顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	270,166.9 4	270,166.9 4
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得 税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,344,190 .03	1,344,190 .03
负债总计	212,710,9	-	-	-	-	189,559,6	402,270,6

	64.41					57.52	21.93
利率敏感 度缺口	556,210,5 71.93	697,224,4 92.61	3,370,580 ,337.87	9,058,226 ,567.03	2,035,449 ,817.55	1,380,988 ,351.88	17,098,68 0,138.87
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,068,621 .39	-	-	-	-	-	3,068,621 .39
结算备付 金	39,773,38 8.15	-	-	-	-	-	39,773,38 8.15
存出保证 金	231,502.2 5	-	-	-	-	-	231,502.2 5
交易性金 融资产	6,335,095 .69	180,545,7 07.40	2,182,547 ,629.87	7,758,523 ,104.56	1,664,633 ,052.72	1,361,119 ,620.44	13,153,70 4,210.68
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售 金融资产	240,064,2 08.22	-	-	-	-	-	240,064,2 08.22
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算 款	-	-	-	-	-	160,082,1 55.96	160,082,1 55.96
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购 款	-	-	-	-	-	217,486,0 27.01	217,486,0 27.01
递延所得 税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	289,472,8 15.70	180,545,7 07.40	2,182,547 ,629.87	7,758,523 ,104.56	1,664,633 ,052.72	1,738,687 ,803.41	13,814,41 0,113.66
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	434,422,6 97.93	-	-	-	-	-	434,422,6 97.93
应付清算 款	-	-	-	-	-	136,557,1 23.20	136,557,1 23.20
应付赎回	-	-	-	-	-	184,916,6	184,916,6

款						29.67	29.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,619,184.99	5,619,184.99
应付托管费	-	-	-	-	-	2,247,674.00	2,247,674.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,695,176.86	1,695,176.86
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	195,606.23	195,606.23
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	828,757.60	828,757.60
负债总计	434,422,697.93	-	-	-	-	332,060,152.55	766,482,850.48
利率敏感度缺口	-144,949,882.23	180,545,707.40	2,182,547,629.87	7,758,523,104.56	1,664,633,052.72	1,406,627,650.86	13,047,927,263.18

表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况; 2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点,且除利率之外的其他市场变量保持不变; 3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动; 4.银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息,假定利率变动仅影响该类资产的未来收益,而对其本身的公允价值无重大影响;定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定,不受利率变化影响; 5.该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个	115,517,822.31	80,413,183.94

	基点		
	基准利率增加 25 个基点	-112,948,517.08	-79,128,891.11

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	176,990,383.07	-	176,990,383.07
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	-	2,251,149.58	-	2,251,149.58
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	179,241,532.65	-	179,241,532.65
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-

应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	179,241,532.65	-	179,241,532.65
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	428,656,329.24	-	428,656,329.24
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	428,656,329.24	-	428,656,329.24
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	428,656,329.24	-	428,656,329.24

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1.除汇率以外的其他市场变量保持不变,且未考虑基金管理人为降低 汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	8,962,076.63	21,432,816.46
	港币相对人民币贬值 5%	-8,962,076.63	-21,432,816.46

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产－股票投资	1,410,913,402.93	8.25	1,361,119,620.44	10.43
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	15,324,660,579.14	89.62	11,792,584,590.24	90.38
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	16,735,573,982.07	97.88	13,153,704,210.68	100.81

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%	-	78,158,815.78
	沪深 300 指数下跌 5%	-	-78,158,815.78

注:于本报告期末,本基金持有的交易性权益投资、可转换债券及可交换债券公允价值占基金资产净值的比例小于 10%,因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日
第一层次	1,410,913,402.93
第二层次	15,324,660,579.14
第三层次	—
合计	16,735,573,982.07

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	1,410,913,402.93	8.06
	其中：股票	1,410,913,402.93	8.06
2	基金投资	—	—

3	固定收益投资	15,324,660,579.14	87.56
	其中：债券	15,324,660,579.14	87.56
	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	490,047,308.22	2.80
	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	115,151,729.72	0.66
8	其他各项资产	160,177,740.79	0.92
9	合计	17,500,950,760.80	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 176,990,383.07 元，占期末净值比例为 1.04%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	314,033,484.00	1.84
C	制造业	856,813,752.90	5.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	6,207,067.40	0.04
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,535,826.50	0.07
J	金融业	45,332,889.06	0.27
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,233,923,019.86	7.22

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	83,903,041.74	0.49
15 原材料	53,836,090.29	0.31
20 工业	—	—
25 可选消费	—	—
30 日常消费	—	—
35 医疗保健	—	—
40 金融	—	—
45 信息技术	39,251,251.04	0.23
50 电信服务	—	—
55 公用事业	—	—
60 房地产	—	—
合计	176,990,383.07	1.04

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601899	紫金矿业	9,583,700	240,934,218.00	1.41
2	002371	北方华创	168,720	149,242,963.20	0.87
3	300750	宁德时代	347,760	136,673,157.60	0.80
4	00883	中国海洋石油	4,754,000	83,903,041.74	0.49
5	603268	松发股份	504,000	70,197,120.00	0.41
6	000333	美的集团	742,700	56,096,131.00	0.33
7	000651	格力电器	1,330,900	49,908,750.00	0.29
8	600176	中国巨石	630,100	45,921,688.00	0.27
9	601225	陕西煤业	2,249,160	45,770,406.00	0.27
10	002142	宁波银行	1,526,874	45,332,889.00	0.27

				6	
11	300604	长川科技	127,600	43,565,192.0 0	0.25
12	300502	新易盛	68,460	41,555,220.0 0	0.24
13	300308	中际旭创	31,200	39,624,000.0 0	0.23
14	00981	中芯国际	505,500	39,251,251.0 4	0.23
15	603986	兆易创新	48,100	39,201,500.0 0	0.23
16	01818	招金矿业	2,358,000	33,567,390.3 5	0.20
17	688012	中微半导体 设备	69,672	32,641,332.0 0	0.19
18	002475	立讯精密	390,900	27,519,360.0 0	0.16
19	603993	洛阳钼业	1,557,200	27,328,860.0 0	0.16
20	02099	中国黄金国 际	190,500	20,268,699.9 4	0.12
21	600096	云天化	582,734	17,715,113.6 0	0.10
22	000636	风华高科	239,900	17,330,376.0 0	0.10
23	600309	万华化学	243,850	16,681,778.5 0	0.10
24	002916	深南电路	35,100	16,072,290.0 0	0.09
25	300677	英科医疗	377,200	14,774,924.0 0	0.09
26	000338	潍柴动力	460,500	12,548,625.0 0	0.07
27	000100	TCL 科技	2,011,200	11,705,184.0 0	0.07
28	688256	寒武纪科技	7,230	11,535,826.5 0	0.07
29	600989	宝丰能源	471,200	9,579,496.00	0.06
30	600105	永鼎股份	122,400	8,259,552.00	0.05
31	603871	嘉友国际	607,940	6,207,067.40	0.04

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	601899	紫金矿业	151,641,062.10	1.16
2	300308	中际旭创	143,352,165.00	1.10
3	002371	北方华创	132,823,609.74	1.02
4	00700	腾讯控股	121,757,459.98	0.93
5	600176	中国巨石	99,803,923.27	0.76
6	300502	新易盛	95,627,187.40	0.73
7	603268	松发股份	80,793,261.00	0.62
8	300750	宁德时代	72,631,502.00	0.56
9	601225	陕西煤业	66,988,149.62	0.51
10	000338	潍柴动力	65,587,728.76	0.50
11	300604	长川科技	58,111,082.00	0.45
12	000333	美的集团	57,569,391.19	0.44
13	600309	万华化学	51,934,282.44	0.40
14	00981	中芯国际	49,513,918.17	0.38
15	002475	立讯精密	48,855,596.02	0.37
16	002142	宁波银行	46,142,781.07	0.35
17	603993	洛阳钼业	44,094,952.00	0.34
18	002463	沪电股份	37,137,455.02	0.28
19	000651	格力电器	34,141,882.00	0.26
20	002353	杰瑞股份	30,359,233.00	0.23

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	00700	腾讯控股	193,555,934.95	1.48
2	300308	中际旭创	163,311,896.00	1.25
3	601899	紫金矿业	115,950,502.39	0.89
4	300502	新易盛	101,902,806.96	0.78
5	600309	万华化学	91,775,598.50	0.70
6	000333	美的集团	88,080,268.00	0.68
7	00883	中国海洋石油	86,762,609.98	0.66
8	002353	杰瑞股份	84,560,662.42	0.65
9	00175	吉利汽车	80,013,711.30	0.61

10	600176	中国巨石	77,166,977.93	0.59
11	01378	中国宏桥	68,072,990.63	0.52
12	000338	潍柴动力	60,286,751.00	0.46
13	600160	巨化股份	56,868,427.58	0.44
14	002371	北方华创	52,705,103.00	0.40
15	603993	洛阳钼业	51,383,050.26	0.39
16	002463	沪电股份	42,839,828.32	0.33
17	300750	宁德时代	40,087,262.00	0.31
18	603268	松发股份	38,982,355.00	0.30
19	601898	中煤能源	28,654,637.00	0.22
19	01898	中煤能源	6,805,392.44	0.05
20	300604	长川科技	31,273,550.20	0.24

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	2,104,771,273.60
卖出股票收入（成交）总额	2,127,362,229.73

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,642,774,202.04	9.61
2	央行票据	—	—
3	金融债券	8,757,940,979.09	51.22
	其中：政策性金融债	2,450,582,978.54	14.33
4	企业债券	3,431,939,190.81	20.07
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	1,335,587,053.74	7.81
7	可转债（可交换债）	390,017.95	0.00
8	同业存单	49,961,884.62	0.29
9	地方政府债	106,067,250.89	0.62
10	其他	—	—
11	合计	15,324,660,579.14	89.62

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	220208	22 国开 08	9,700,000	983,779,315.07	5.75
2	250011	25 付息国债 11	3,650,000	365,539,862.77	2.14
3	092280086	22 农行永续债 02	2,400,000	250,841,845.48	1.47
4	242400004	24 邮储永续债 01	1,900,000	196,855,720.55	1.15
5	230026	23 付息国债 26	1,800,000	194,595,211.96	1.14

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,国家开发银行、中国农业银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、中国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	543,134.32
2	应收清算款	47,397,554.70
3	应收股利	2,251,149.58
4	应收利息	—
5	应收申购款	109,985,902.19
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	160,177,740.79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富添乐双盈债券 A	52,140	193,737.93	3,273,478,079.98	32.41	6,828,017,620.66	67.59
汇添富添乐双盈债券 C	41,058	91,411.07	430,181,765.59	11.46	3,322,974,098.75	88.54
汇添富添乐双盈债券 E	1,084	280,484.41	0.00	0.00	304,045,101.90	100.00
合计	94,282	150,173.91	3,703,659,845.57	26.16	10,455,036,821.31	73.84

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	汇添富添添乐双盈债券 A	3,145,689.22	0.03
	汇添富添添乐双盈债券 C	1,113,141.29	0.03
	汇添富添添乐双盈债券 E	1,102,727.09	0.36
	合计	5,361,557.60	0.04

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	汇添富添添乐双盈债券 A	0
	汇添富添添乐双盈债券 C	0
	汇添富添添乐双盈债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富添添乐双盈债券 A	0~10
	汇添富添添乐双盈债券 C	0
	汇添富添添乐双盈债券 E	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富添添乐双盈债券 A	汇添富添添乐双盈债券 C	汇添富添添乐双盈债券 E
基金合同生效日（2023 年 02 月 01 日）基金份额总额	736,444,701.51	41,204,345.74	—
本报告期期初基金份额总额	7,206,644,252.56	3,785,000,038.15	—
本报告期基金总申购份额	12,325,460,551.51	5,340,871,367.41	440,061,978.91
减：本报告期基金总赎回份额	9,430,609,103.43	5,372,715,541.22	136,016,877.01
本报告期基金拆分变	—	—	—

动份额			
本报告期期末基金份额总额	10,101,495,700.64	3,753,155,864.34	304,045,101.90

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国海证券	2	2,299,411,980.31	54.33	1,032,626.65	54.82	
国联民生	2	544,927,990.53	12.88	240,305.15	12.76	
瑞银证券	2	486,570,400.21	11.50	217,226.34	11.53	
财通证券	2	172,596,072.61	4.08	80,432.77	4.27	
长城证券	2	172,469,425.12	4.08	75,622.33	4.01	
摩根大通证券	2	142,477,899.50	3.37	62,105.49	3.30	
中金公司	2	93,642,182.65	2.21	32,522.22	1.73	
国信证券	2	64,893,626.43	1.53	29,914.30	1.59	
兴业证券	3	56,465,815.00	1.33	24,612.74	1.31	
华泰证券	2	56,296,108.52	1.33	26,355.83	1.40	
中泰证券	1	34,705,640.80	0.82	15,128.48	0.80	
广发证券	1	31,966,059.28	0.76	13,934.34	0.74	
东北证券	2	31,848,163.07	0.75	13,882.69	0.74	
申万宏源证券	3	29,910,307.30	0.71	13,038.24	0.69	
东吴证券	1	8,551,869.	0.20	3,727.14	0.20	

		00				
中信证券	4	5,399,963.00	0.13	2,353.92	0.12	
东方证券	6	—	—	—	—	
长江证券	1	—	—	—	—	
东兴证券	1	—	—	—	—	
国泰海通	6	—	—	—	—	
恒泰证券	2	—	—	—	—	
华安证券	1	—	—	—	—	
平安证券	3	—	—	—	—	
信达证券	1	—	—	—	—	
银河证券	1	—	—	—	—	
中金财富	2	—	—	—	—	
中信建投 证券	1	—	—	—	—	

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
国海证券	—	—	12,774,343,000.00	32.35	—	—	—	—
国联民生	26,934,014.24	14.25	7,022,124,000.00	17.78	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	6,036,035,000.00	15.28	—	—	—	—
财通证券	998,400.00	0.53	1,509,776,000.00	3.82	—	—	—	—
长城证券	—	—	1,072,000,000.00	2.71	—	—	—	—

			00					
摩根大通证券	-	-	1,033,676,000.00	2.62	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	2,299,666,000.00	5.82	-	-	-	-
兴业证券	-	-	1,048,109,000.00	2.65	-	-	-	-
华泰证券	-	-	524,743,000.00	1.33	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	2,747,177,000.00	6.96	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	60,000,000.00	0.15	-	-	-	-
东吴证券	-	-	1,268,024,000.00	3.21	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	161,116,143.63	85.22	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	2,098,142,000.00	5.31	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 22 日
2	关于汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金 E 类份额开放日常申购、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,证券时报	2026 年 02 月 10 日

3	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富添乐双盈债券型证券投资基金增设基金份额并修改法律文件的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,证券时报	2026 年 02 月 10 日
4	汇添富添乐双盈债券型证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2026 年 02 月 10 日
5	汇添富添乐双盈债券型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2026 年 02 月 10 日
6	汇添富添乐双盈债券型证券投资基金更新招募说明书(2026 年 2 月 11 日更新)	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2026 年 02 月 11 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2026 年 02 月 13 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2026 年 02 月 13 日
9	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
10	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
11	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 04 月 22 日
12	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
13	汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 06 月 06 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

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添添乐双盈债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日