

汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§ 5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	16
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.....	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§ 7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	58
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.....	58
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.....	58

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.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§ 8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
§ 9 开放式基金份额变动.....	60
§ 10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	61
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.....	61
10.8 其他重大事件.....	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§ 12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证 500 增强策略 ETF
场内简称	500 增
基金主代码	560950
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 07 月 19 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）	13,483,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 07 月 31 日

注：扩位证券简称：中证 500 增强 ETF 汇添富。

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，追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，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，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 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%，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；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
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。

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	《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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	2,254,773.41
本期利润	2,389,764.08
加权平均基金份额本期利润	0.1891
本期加权平均净值利润率	13.29%
本期基金份额净值增长率	12.11%
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	6,654,391.97
期末可供分配基金份额利润	0.4935
期末基金资产净值	20,137,391.97
期末基金份额净值	1.4935
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	49.35%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收

益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

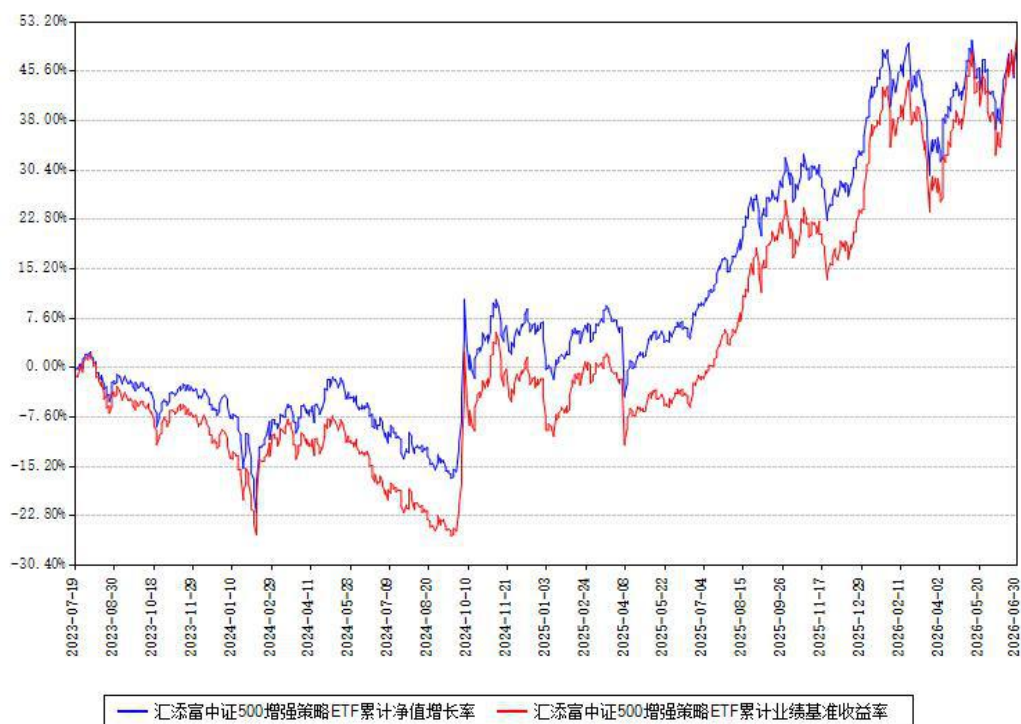
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个 月	12.25%	1.43%	18.56%	1.65%	-6.31%	-0.22%
过去六个 月	12.11%	1.46%	20.97%	1.66%	-8.86%	-0.20%
过去一年	36.52%	1.23%	52.68%	1.42%	-16.16%	-0.19%
自基金合 同生效起 至今	49.35%	1.33%	50.48%	1.50%	-1.13%	-0.17%

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500增强策略ETF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 07 月 19 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

金销售等业务资格。

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年 限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基 金经理	2023 年 07 月 19 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。

组合运作方面，本基金使用量化选股策略构建中证 500 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。上半年市场风格极致分化，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，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

本基金本报告期基金份额净值增长率为 12.11%，同期业绩比较基准收益率为 20.97%。

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 500 在风格和行业上的均衡配置，维持清晰和稳定的中盘风格。中证 500 指数汇集了中盘成长股中的优质标的，具备较高的成长弹性，是投资者布局中国经济结构转型升级、挖掘细分行业龙头潜力的重要工具。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：《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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

本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。因前述迷你基金情形，自 2025 年 12 月 24 日起，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

§ 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合规守信、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的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	479,263.36	472,672.34
结算备付金		36,390.31	98,181.87
存出保证金		6,954.94	21,637.17
交易性金融资产	6.4.7.2	19,691,431.25	20,140,675.01
其中：股票投资		19,687,431.09	20,133,696.96
基金投资		—	—
债券投资		4,000.16	6,978.05
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		13,646.26	18,710.78

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		20,227,686.12	20,751,877.17
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		68,320.08	93,967.32
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,555.74	12,589.58
应付托管费		1,569.47	1,573.70
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	6.4.7.7	7,848.86	17,549.83
负债合计		90,294.15	125,680.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	13,483,000.00	15,483,000.00
未分配利润	6.4.7.9	6,654,391.97	5,143,196.74
净资产合计		20,137,391.97	20,626,196.74
负债和净资产总计		20,227,686.12	20,751,877.17

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4935 元，基金份额总额 13,483,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日 至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		2,469,237.35	2,947,378.95
1.利息收入		829.38	3,093.44
其中：存款利息收入	6.4.7.10	829.38	3,093.44

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）		2,349,895.46	2,083,223.13
其中：股票投资收益	6.4.7.11	2,195,223.00	1,638,580.72
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,904.63	-
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	150,767.83	444,642.41
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	134,990.67	811,751.93
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	-16,478.16	49,310.45
减：二、营业总支出		79,473.27	257,282.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	70,553.15	177,897.70
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,819.12	22,237.23
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	101.00	57,147.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,389,764.08	2,690,096.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,389,764.08	2,690,096.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,389,764.08	2,690,096.35

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

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

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	15,483,000.00	5,143,196.74	20,626,196.74
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	15,483,000.00	5,143,196.74	20,626,196.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	1,511,195.23	-488,804.77
（一）、综合收益总额	-	2,389,764.08	2,389,764.08
（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）	-2,000,000.00	-878,568.85	-2,878,568.85
其中：1.基金申购款	14,000,000.00	5,749,423.93	19,749,423.93
2.基金赎回款	-16,000,000.00	-6,627,992.78	-22,627,992.78
（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	13,483,000.00	6,654,391.97	20,137,391.97
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	47,483,000.00	2,138,868.47	49,621,868.47
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	47,483,000.00	2,138,868.47	49,621,868.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	2,324,734.17	2,324,734.17
（一）、综合收益总额	-	2,690,096.35	2,690,096.35
（二）、本期基	-	-365,362.18	-365,362.18

金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	48,000,000.00	2,064,511.01	50,064,511.01
2.基金赎回款	-48,000,000.00	-2,429,873.19	-50,429,873.19
（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	47,483,000.00	4,463,602.64	51,946,602.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2022〕2598 号文《关于准予汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 7 月 19 日生效。首次设立基金募集规模为 961,483,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 60466941_B35 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的

具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券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。

6.4.7 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	479,263.36
等于：本金	479,214.50
加：应计利息	48.86
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	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	479,263.36

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	19,099,540.91	—	19,687,431.09	587,890.18

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,000.00	0.16	4,000.16	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	4,000.00	0.16	4,000.16	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		19,103,540.91	0.16	19,691,431.25	587,890.18

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,848.86
其中：交易所市场	7,848.86
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	-
应付信息披露费	-
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	7,848.86

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,483,000.00	15,483,000.00
本期申购	14,000,000.00	14,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-16,000,000.00	-16,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	13,483,000.00	13,483,000.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,918,953.98	-775,757.24	5,143,196.74

加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	5,918,953.98	-775,757.24	5,143,196.74
本期利润	2,254,773.41	134,990.67	2,389,764.08
本期基金份额交易产生的变动数	-588,999.21	-289,569.64	-878,568.85
其中：基金申购款	6,965,385.03	-1,215,961.10	5,749,423.93
基金赎回款	-7,554,384.24	926,391.46	-6,627,992.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,584,728.18	-930,336.21	6,654,391.97

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	686.93
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	117.93
其他	24.52
合计	829.38

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 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,959,877.14
股票投资收益——赎回差价收入	235,345.86
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,195,223.00

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	44,610,074.58
减：卖出股票成本总额	42,606,835.64
减：交易费用	43,361.80
买卖股票差价收入	1,959,877.14

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	22,627,992.78
减：现金支付赎回款总额	12,694,933.80
减：赎回股票成本总额	9,697,713.12
减：交易费用	—
赎回差价收入	235,345.86

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	0.27
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	3,904.36
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	3,904.63

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,905.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,000.00
减：应计利息总额	0.96
减：交易费用	0.32
买卖债券差价收入	3,904.36

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	150,767.83
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	150,767.83

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	134,990.67
——股票投资	137,967.87
——债券投资	-2,977.20
——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	134,990.67

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-16,478.16
其他	-
合计	-16,478.16

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	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	101.00
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	101.00

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人,基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 ("工商银行")	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 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	70,553.15	177,897.70
其中：应支付销售机构的客户维护费	19,451.61	28,223.81
应支付基金管理人的净管理费	51,101.54	149,673.89

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。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,819.12	22,237.23

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

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	479,263.36	686.93	1,130,134.37	2,063.19

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

本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分固定费用，如审计费等。

6.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期末未进行利润分配。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	30	3,000.00	3,000.14	
118071	华峰转债	2026年06月24日	17个交易日	新债流通受限	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.02	

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，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	479,263.36	-	-	-	-	-	479,263.36
结算备付金	36,390.31	-	-	-	-	-	36,390.31
存出保证金	6,954.94	-	-	-	-	-	6,954.94
交易性金融资产	-	-	4,000.16	-	-	19,687,431.09	19,691,431.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	13,646.26	13,646.26
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	522,608.61	-	4,000.16	-	-	19,701,077.35	20,227,686.12
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	-	-	-	-	-	68,320.08	68,320.08
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,555.74	12,555.74
应付托管费	-	-	-	-	-	1,569.47	1,569.47
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	-	-	-	-	-	7,848.86	7,848.86
负债总计	-	-	-	-	-	90,294.15	90,294.15
利率敏感度缺口	522,608.61	-	4,000.16	-	-	19,610.783.20	20,137.391.97
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	472,672.34	-	-	-	-	-	472,672.34
结算备付金	98,181.87	-	-	-	-	-	98,181.87
存出保证金	21,637.17	-	-	-	-	-	21,637.17
交易性金融资产	-	-	6,978.05	-	-	20,133,696.96	20,140,675.01
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	18,710.78	18,710.78
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	592,491.38	-	6,978.05	-	-	20,152,407.74	20,751,877.17
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	-	-	-	-	-	93,967.32	93,967.32
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,589.58	12,589.58
应付托管费	-	-	-	-	-	1,573.70	1,573.70
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	-	-	-	-	-	17,549.83	17,549.83
负债总计	-	-	-	-	-	125,680.43	125,680.43
利率敏感度缺口	592,491.38	-	6,978.05	-	-	20,026,727.31	20,626,196.74

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	19,687,431.09	97.77	20,133,696.96	97.61
交易性金融资产－基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产－债券投资	4,000.16	0.02	6,978.05	0.03
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	19,691,431.25	97.79	20,140,675.01	97.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险,即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上涨 5%	871,942.71	895,926.74
	中证 500 指数下跌 5%	-871,942.71	-895,926.74

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	19,687,431.09
第二层次	4,000.16
第三层次	—
合计	19,691,431.25

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	19,687,431.09	97.33
	其中：股票	19,687,431.09	97.33
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,000.16	0.02
	其中：债券	4,000.16	0.02
	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	515,653.67	2.55
8	其他各项资产	20,601.20	0.10
9	合计	20,227,686.12	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	95,392.00	0.47
B	采矿业	611,662.60	3.04
C	制造业	13,013,883.61	64.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	480,494.00	2.39
E	建筑业	15,686.00	0.08
F	批发和零售业	293,225.00	1.46
G	交通运输、仓储和邮政业	94,606.00	0.47
H	住宿和餐饮业	14,392.00	0.07

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,096,746.00	5.45
J	金融业	697,600.78	3.46
K	房地产业	19,468.00	0.10
L	租赁和商务服务业	29,895.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	143,132.00	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	44,284.40	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	39,783.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	25,165.00	0.12
S	综合	—	—
	合计	16,715,415.39	83.01

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	9,242.00	0.05
B	采矿业	97,231.00	0.48
C	制造业	2,149,206.70	10.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,634.00	0.19
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	112,353.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	80,852.00	0.40
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	217,925.00	1.08
J	金融业	77,857.00	0.39
K	房地产业	7,592.00	0.04
L	租赁和商务服务业	10,596.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	73,142.00	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	14,590.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	27,036.00	0.13
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	43,327.00	0.22
S	综合	13,432.00	0.07
	合计	2,972,015.70	14.76

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	001309	德明利	300	282,870.00	1.40
2	300604	长川科技	800	273,136.00	1.36
3	688347	华虹宏力半 导体	700	235,410.00	1.17
4	300223	北京君正	900	224,010.00	1.11
5	688002	睿创微纳	1,388	214,709.72	1.07
6	002008	大族激光	1,400	210,154.00	1.04
7	300857	协创数据	540	183,546.00	0.91
8	300475	香农芯创	600	180,000.00	0.89
9	002281	光迅科技	700	179,858.00	0.89
10	002273	水晶光电	4,800	170,304.00	0.85
11	300136	信维通信	1,400	166,950.00	0.83
12	688728	格科微有限 公司	7,933	166,910.32	0.83
13	300458	全志科技	3,880	153,104.80	0.76
14	002261	拓维信息	5,300	148,453.00	0.74
15	300623	捷捷微电	3,200	143,968.00	0.71
16	000021	深科技	2,200	141,394.00	0.70
17	600884	杉杉股份	10,400	140,920.00	0.70
18	002340	格林美	21,300	140,793.00	0.70
19	002414	高德红外	10,400	137,904.00	0.68
20	300054	鼎龙股份	1,300	137,761.00	0.68
21	000423	东阿阿胶	3,000	136,080.00	0.68
22	002402	和而泰	5,000	129,150.00	0.64
23	688361	中科飞测	300	129,000.00	0.64
24	300699	光威复材	4,500	128,925.00	0.64
25	688120	华海清科	400	128,872.00	0.64
26	002065	东华软件	17,800	127,092.00	0.63
27	300567	精测电子	400	127,040.00	0.63
28	603606	东方电缆	3,060	127,020.60	0.63
29	300373	扬杰科技	800	125,784.00	0.62
30	600499	科达制造	9,000	124,200.00	0.62
31	600711	盛屯矿业	11,300	123,961.00	0.62
32	300627	华测导航	4,300	122,120.00	0.61

33	002152	广电运通	12,400	116,312.00	0.58
34	600171	上海贝岭	3,600	114,984.00	0.57
35	600685	中船防务	4,500	114,480.00	0.57
36	300285	国瓷材料	1,100	113,498.00	0.56
37	300346	南大光电	1,200	111,180.00	0.55
38	601216	君正集团	24,900	111,054.00	0.55
39	000683	博源化工	19,200	110,592.00	0.55
40	600105	永鼎股份	1,600	107,968.00	0.54
41	000027	深圳能源	17,100	106,020.00	0.53
42	688200	华峰测控	200	105,020.00	0.52
43	002185	华天科技	4,700	104,857.00	0.52
44	688322	奥比中光	800	104,440.00	0.52
45	688469	芯联集成	9,827	104,264.47	0.52
46	002078	太阳纸业	8,300	103,667.00	0.51
47	300390	天华新能	1,100	102,861.00	0.51
48	603858	步长制药	7,000	102,200.00	0.51
49	001286	陕西能源	10,000	101,400.00	0.50
50	000513	丽珠集团	3,500	101,115.00	0.50
51	002444	巨星科技	3,200	99,520.00	0.49
52	002517	恺英网络	6,100	99,125.00	0.49
53	600132	重庆啤酒	2,400	99,120.00	0.49
54	600598	北大荒	8,800	95,392.00	0.47
55	001389	广合科技	400	94,900.00	0.47
56	000009	中国宝安	15,200	94,696.00	0.47
57	002850	科达利	500	94,650.00	0.47
58	300395	菲利华	700	93,611.00	0.46
59	688475	萤石网络	3,420	93,537.00	0.46
60	600562	国睿科技	4,400	93,368.00	0.46
61	600885	宏发股份	2,700	93,123.00	0.46
62	688385	复旦微电	1,282	91,393.78	0.45
63	000729	燕京啤酒	8,900	90,157.00	0.45
64	301536	星辰科技	700	90,097.00	0.45
65	600098	广州发展	15,200	89,832.00	0.45
66	002409	雅克科技	400	89,800.00	0.45
67	601608	中信重工	18,800	89,676.00	0.45
68	300919	中伟新材	2,000	87,500.00	0.43
69	600352	浙江龙盛	7,100	85,981.00	0.43
70	600312	平高电气	4,800	84,768.00	0.42
71	002851	麦格米特	500	83,590.00	0.42
72	300037	新宙邦	900	83,565.00	0.41
73	603298	杭叉集团	3,500	83,510.00	0.41
74	300548	长芯博创	300	83,400.00	0.41
75	600298	安琪酵母	2,300	83,260.00	0.41

76	000400	许继电气	3,800	82,460.00	0.41
77	603659	璞泰来	2,800	81,004.00	0.40
78	002138	顺络电子	1,100	80,410.00	0.40
79	002410	广联达	9,800	79,968.00	0.40
80	301526	国际复材	1,700	79,339.00	0.39
81	600988	赤峰黄金	3,000	78,960.00	0.39
82	002299	圣农发展	5,200	78,832.00	0.39
83	688702	盛科通信	200	77,998.00	0.39
84	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.38
85	300620	光库科技	200	75,640.00	0.38
86	300759	康龙化成	2,600	75,218.00	0.37
87	603160	汇顶科技	1,200	74,052.00	0.37
88	300666	江丰电子	200	73,720.00	0.37
89	002812	恩捷股份	1,100	73,601.00	0.37
90	000937	冀中能源	18,420	73,311.60	0.36
91	000831	中国稀土	1,300	72,137.00	0.36
92	000737	北方铜业	5,400	71,388.00	0.35
93	600601	方正科技	5,100	70,584.00	0.35
94	688777	中控技术	600	70,500.00	0.35
95	603699	纽威股份	1,400	70,420.00	0.35
96	600801	华新建材	4,500	70,200.00	0.35
97	300432	富临精工	3,400	68,306.00	0.34
98	300012	华测检测	4,900	67,914.00	0.34
99	688676	海南金盘智能科技	800	67,712.00	0.34
100	002436	兴森科技	1,300	66,235.00	0.33
101	601555	东吴证券	8,300	65,736.00	0.33
102	688220	翱捷科技	500	62,160.00	0.31
103	603816	顾家家居	2,700	60,372.00	0.30
104	600369	西南证券	14,700	59,094.00	0.29
105	002487	大金重工	1,000	57,970.00	0.29
106	002773	康弘药业	2,800	57,260.00	0.28
107	000739	普洛药业	3,400	56,644.00	0.28
108	002195	岩山科技	8,600	56,244.00	0.28
109	002126	银轮股份	1,100	54,780.00	0.27
110	688578	艾力斯医药科技	500	54,600.00	0.27
111	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.27
112	603308	应流股份	900	54,360.00	0.27
113	300339	润和软件	1,400	53,914.00	0.27
114	002500	山西证券	10,300	53,148.00	0.26
115	603256	宏和科技	200	53,066.00	0.26
116	603737	三棵树	2,200	53,020.00	0.26

117	002064	华峰化学	5,500	52,195.00	0.26
118	688582	芯动联科	800	52,000.00	0.26
119	601233	桐昆股份	2,400	51,960.00	0.26
120	603129	春风动力	200	51,160.00	0.25
121	688235	百济神州	200	50,922.00	0.25
122	300115	长盈精密	1,800	50,292.00	0.25
123	688122	西部超导	800	50,248.00	0.25
124	603233	大参林	3,300	49,599.00	0.25
125	300454	深信服	500	48,100.00	0.24
126	300073	当升科技	1,000	48,040.00	0.24
127	688387	中信科移动	2,401	47,635.84	0.24
128	002738	中矿资源	800	47,192.00	0.23
129	002155	湖南黄金	1,900	45,353.00	0.23
130	601198	东兴证券	3,300	44,847.00	0.22
131	600498	烽火通信	600	44,160.00	0.22
132	002683	广东宏大	1,500	43,935.00	0.22
133	600862	中航高科	2,400	43,272.00	0.21
134	600348	华阳股份	5,600	42,840.00	0.21
135	600483	福能股份	4,200	42,798.00	0.21
136	000987	越秀资本	5,400	42,228.00	0.21
137	002130	沃尔核材	2,200	41,712.00	0.21
138	000878	云南铜业	2,600	41,288.00	0.21
139	000893	亚钾国际	1,000	40,890.00	0.20
140	600109	国金证券	4,601	40,396.78	0.20
141	600602	云赛智联	2,500	40,200.00	0.20
142	605358	立昂微	500	38,800.00	0.19
143	600143	金发科技	2,500	38,625.00	0.19
144	000155	川能动力	3,200	38,336.00	0.19
145	002335	科华数据	900	38,205.00	0.19
146	301358	湖南裕能	500	37,935.00	0.19
147	300142	沃森生物	2,900	37,671.00	0.19
148	600763	通策医疗	1,100	37,268.00	0.19
149	300496	中科创达	600	37,074.00	0.18
150	300748	金力永磁	1,200	37,020.00	0.18
151	600699	均胜电子	1,700	36,737.00	0.18
152	688617	惠泰医疗	200	36,312.00	0.18
153	601799	星宇股份	400	36,248.00	0.18
154	301200	大族数控	100	36,065.00	0.18
155	603444	吉比特	100	35,842.00	0.18
156	600392	盛和资源	1,200	35,724.00	0.18
157	688266	泽璟制药	300	34,998.00	0.17
158	000728	国元证券	4,600	34,454.00	0.17
159	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.17

160	000786	北新建材	1,800	32,562.00	0.16
161	600295	鄂尔多斯	3,000	32,160.00	0.16
162	688213	思特威电子科技	300	32,121.00	0.16
163	603345	安井食品	400	32,076.00	0.16
164	688188	上海柏楚电子科技	300	32,010.00	0.16
165	000519	中兵红箭	1,500	31,605.00	0.16
166	601228	广州港	11,100	31,302.00	0.16
167	002673	西部证券	4,700	30,503.00	0.15
168	603379	三美股份	400	30,356.00	0.15
169	601099	太平洋	9,000	30,330.00	0.15
170	002797	第一创业	4,600	30,222.00	0.15
171	600378	昊华科技	400	30,152.00	0.15
172	000623	吉林敖东	1,700	30,141.00	0.15
173	002085	万丰奥威	2,700	29,943.00	0.15
174	601179	中国西电	2,000	29,840.00	0.15
175	002624	完美世界	2,400	29,808.00	0.15
176	600642	申能股份	3,400	29,682.00	0.15
177	300487	蓝晓科技	500	29,425.00	0.15
178	600901	江苏金租	5,000	28,750.00	0.14
179	002756	永兴材料	500	28,320.00	0.14
180	002223	鱼跃医疗	1,100	28,226.00	0.14
181	601958	金钼股份	1,000	28,110.00	0.14
182	600595	中孚实业	5,000	28,100.00	0.14
183	002430	杭氧股份	900	27,864.00	0.14
184	000983	山西焦煤	4,800	27,840.00	0.14
185	000750	国海证券	7,500	27,600.00	0.14
186	300058	蓝色光标	2,000	27,520.00	0.14
187	002271	东方雨虹	2,300	27,301.00	0.14
188	603766	隆鑫通用	2,200	26,246.00	0.13
189	600765	中航重机	2,000	25,840.00	0.13
190	601699	潞安环能	1,800	25,704.00	0.13
191	600497	驰宏锌锗	2,100	25,431.00	0.13
192	000830	鲁西化工	2,100	25,200.00	0.13
193	603728	鸣志电器	400	24,368.00	0.12
194	601108	财通证券	2,800	24,220.00	0.12
195	300474	景嘉微	400	24,192.00	0.12
196	002939	长城证券	2,900	24,186.00	0.12
197	300679	电连技术	400	23,996.00	0.12
198	603605	珀莱雅	400	23,968.00	0.12
199	600985	淮北矿业	1,700	23,885.00	0.12
200	603979	金诚信	400	23,612.00	0.12

201	603658	安图生物	800	23,216.00	0.12
202	000733	振华科技	400	22,656.00	0.11
203	688615	合合信息	200	22,620.00	0.11
204	002603	以岭药业	1,500	22,500.00	0.11
205	000062	深圳华强	700	22,274.00	0.11
206	601717	中创智领	1,600	22,256.00	0.11
207	000738	航发控制	1,200	21,948.00	0.11
208	000921	海信家电	800	21,856.00	0.11
209	688778	厦钨新能源	400	21,760.00	0.11
210	600166	福田汽车	7,400	21,534.00	0.11
211	600435	北方导航	1,900	21,280.00	0.11
212	603338	浙江鼎力	500	21,250.00	0.11
213	601000	唐山港	5,120	21,248.00	0.11
214	603568	伟明环保	1,380	21,224.40	0.11
215	002472	双环传动	500	20,755.00	0.10
216	002262	恩华药业	1,100	20,625.00	0.10
217	603486	科沃斯	400	20,300.00	0.10
218	600486	扬农化工	400	20,280.00	0.10
219	600282	南钢股份	4,400	20,196.00	0.10
220	600583	海油工程	4,000	20,120.00	0.10
221	002407	多氟多	400	20,092.00	0.10
222	603939	益丰药房	1,100	19,778.00	0.10
223	600536	中国软件	700	19,684.00	0.10
224	600546	山煤国际	1,800	19,674.00	0.10
225	000951	中国重汽	1,000	19,510.00	0.10
226	000783	长江证券	2,000	19,500.00	0.10
227	600663	陆家嘴	3,100	19,468.00	0.10
228	603920	世运电路	400	19,216.00	0.10
229	600141	兴发集团	400	18,788.00	0.09
230	300002	神州泰岳	2,400	18,744.00	0.09
231	600535	天士力	1,400	18,522.00	0.09
232	601880	辽港股份	13,300	18,354.00	0.09
233	688819	天能电池集团股份	819	18,181.80	0.09
234	003022	联泓新科	700	18,130.00	0.09
235	600380	健康元	1,900	17,898.00	0.09
236	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.09
237	000598	兴蓉环境	2,700	17,334.00	0.09
238	000960	锡业股份	400	17,076.00	0.08
239	600879	航天电子	800	17,032.00	0.08
240	603341	龙旗科技	400	16,996.00	0.08
241	300017	网宿科技	1,300	16,913.00	0.08
242	300144	宋城演艺	2,900	16,849.00	0.08

243	600316	洪都航空	600	16,764.00	0.08
244	000959	首钢股份	4,640	16,286.40	0.08
245	600967	内蒙一机	1,500	16,275.00	0.08
246	600131	国网信通	1,100	16,060.00	0.08
247	688772	珠海冠宇电 池	800	15,704.00	0.08
248	600970	中材国际	2,200	15,686.00	0.08
249	300207	欣旺达	800	15,192.00	0.08
250	300001	特锐德	400	15,132.00	0.08
251	600995	南网储能	1,200	14,760.00	0.07
252	002583	海能达	1,900	14,611.00	0.07
253	603899	晨光股份	700	14,441.00	0.07
254	600754	锦江酒店	800	14,392.00	0.07
255	600100	同方股份	2,100	14,385.00	0.07
256	002831	裕同科技	400	14,224.00	0.07
257	002841	视源股份	400	13,812.00	0.07
258	601139	深圳燃气	2,400	13,584.00	0.07
259	002007	华兰生物	1,100	13,409.00	0.07
260	600566	济川药业	600	13,314.00	0.07
261	603000	人民网	900	13,311.00	0.07
262	002508	老板电器	900	13,158.00	0.07
263	688331	荣昌生物	100	13,026.00	0.06
264	600062	华润双鹤	800	12,832.00	0.06
265	300957	贝泰妮	400	12,604.00	0.06
266	600398	海澜之家	2,400	12,552.00	0.06
267	000932	华菱钢铁	3,600	12,492.00	0.06
268	301606	绿联科技	200	12,204.00	0.06
269	300718	长盛轴承	200	12,194.00	0.06
270	002056	横店东磁	400	12,192.00	0.06
271	600021	上海电力	800	12,056.00	0.06
272	001203	大中矿业	400	11,980.00	0.06
273	300140	节能环保	2,400	11,928.00	0.06
274	002032	苏 泊 尔	300	11,880.00	0.06
275	600390	五矿资本	2,500	11,400.00	0.06
276	300888	稳健医疗	400	11,196.00	0.06
277	600060	海信视像	400	11,148.00	0.06
278	002266	浙富控股	2,200	11,132.00	0.06
279	601808	中海油服	1,000	10,810.00	0.05
280	601866	中远海发	4,700	10,387.00	0.05
281	688099	晶晨半导体	100	10,290.00	0.05
282	688563	航空材料股 份	200	10,246.00	0.05
283	601696	中银证券	800	10,120.00	0.05

284	600038	中直股份	400	10,116.00	0.05
285	603596	伯特利	400	9,936.00	0.05
286	300024	机器人	500	9,665.00	0.05
287	300735	光弘科技	400	9,096.00	0.05
288	600764	中国海防	500	8,715.00	0.04
289	001696	宗申动力	400	8,324.00	0.04
290	600968	海油发展	2,400	7,992.00	0.04
291	603225	新凤鸣	400	7,860.00	0.04
292	603529	爱玛科技	400	7,804.00	0.04
293	002423	中粮资本	900	7,407.00	0.04
294	000887	中鼎股份	400	7,156.00	0.04
295	002568	百润股份	400	6,768.00	0.03
296	603119	浙江荣泰股份	100	6,634.00	0.03
297	000997	新大陆	400	6,520.00	0.03
298	601865	福莱特	600	6,306.00	0.03
299	600737	中粮糖业	500	6,165.00	0.03
300	000060	中金岭南	800	6,056.00	0.03
301	300003	乐普医疗	500	5,925.00	0.03
302	600909	华安证券	500	5,555.00	0.03
303	000709	河钢股份	2,800	5,432.00	0.03
304	688425	铁建重工	1,344	5,402.88	0.03
305	002739	儒意电影	500	4,800.00	0.02
306	002461	珠江啤酒	600	4,542.00	0.02
307	002670	国盛证券	400	4,400.00	0.02
308	600637	东方明珠	500	4,155.00	0.02
309	601298	青岛港	500	4,025.00	0.02
310	600873	梅花生物	500	3,675.00	0.02
311	002312	川发龙蟒	400	3,668.00	0.02
312	600004	白云机场	500	3,630.00	0.02
313	601666	平煤股份	500	3,575.00	0.02
314	600032	浙江新能	500	3,525.00	0.02
315	601928	凤凰传媒	400	3,516.00	0.02
316	601577	长沙银行	400	3,484.00	0.02
317	600578	京能电力	500	3,225.00	0.02
318	002120	韵达股份	500	3,180.00	0.02
319	600177	雅戈尔	400	3,012.00	0.01
320	600808	马钢股份	1,200	3,000.00	0.01
321	600906	财达证券	400	2,984.00	0.01
322	601991	大唐发电	400	2,832.00	0.01
323	002608	江苏国信	400	2,760.00	0.01
324	000825	太钢不锈	800	2,728.00	0.01
325	000898	鞍钢股份	1,400	2,618.00	0.01

326	002044	美年健康	500	2,515.00	0.01
327	601598	中国外运	500	2,480.00	0.01
328	002131	利欧股份	500	2,375.00	0.01
329	600863	华能蒙电	500	2,350.00	0.01
330	600998	九州通	500	2,345.00	0.01
331	600517	国网英大	500	2,340.00	0.01
332	600704	物产中大	400	1,888.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	002017	东信和平	5,200	76,076.00	0.38
2	300414	中光防雷	6,700	73,834.00	0.37
3	002090	金智科技	8,300	73,372.00	0.36
4	300127	银河磁体	2,500	69,875.00	0.35
5	601018	宁波港	22,100	69,615.00	0.35
6	601727	上海电气	9,800	68,600.00	0.34
7	002353	杰瑞股份	400	61,000.00	0.30
8	301289	国缆检测	1,100	51,711.00	0.26
9	002338	奥普光电	900	51,480.00	0.26
10	600506	统一股份	3,500	48,615.00	0.24
11	600725	云维股份	15,000	46,350.00	0.23
12	600487	亨通光电	400	43,736.00	0.22
13	301019	宁波色母	2,400	42,792.00	0.21
14	002349	精华制药	6,800	42,228.00	0.21
15	002938	鹏鼎控股	400	42,152.00	0.21
16	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.20
17	000657	中钨高新	400	38,288.00	0.19
18	300493	润欣科技	2,500	37,275.00	0.19
19	002080	中材科技	400	36,000.00	0.18
20	300722	新余国科	1,600	35,680.00	0.18
21	600031	三一重工	2,000	34,560.00	0.17
22	600549	厦门钨业	400	34,080.00	0.17
23	688432	有研硅	828	33,095.16	0.16
24	600640	国脉文化	3,400	32,878.00	0.16
25	600118	中国卫星	400	32,820.00	0.16
26	300613	富瀚微	400	32,032.00	0.16

27	002837	英维克	400	31,824.00	0.16
28	002156	通富微电	400	30,348.00	0.15
29	002004	华邦健康	7,600	29,868.00	0.15
30	300847	中船汉光	2,300	29,762.00	0.15
31	603228	景旺电子	400	28,964.00	0.14
32	002077	大港股份	1,500	28,935.00	0.14
33	688584	上海合晶硅材料	800	28,760.00	0.14
34	002651	利君股份	3,900	28,509.00	0.14
35	002454	松芝股份	5,940	28,393.20	0.14
36	002475	立讯精密	400	28,160.00	0.14
37	600061	国投资本	4,100	26,855.00	0.13
38	688100	威胜信息	850	26,001.50	0.13
39	600367	红星发展	400	25,172.00	0.13
40	600455	博通股份	1,100	24,156.00	0.12
41	301025	读客文化	3,100	24,056.00	0.12
42	002576	通达动力	1,700	24,055.00	0.12
43	601318	中国平安	500	23,870.00	0.12
44	002595	豪迈科技	480	22,368.00	0.11
45	002516	旷达科技	3,900	21,762.00	0.11
46	600489	中金黄金	1,200	21,660.00	0.11
47	300433	蓝思科技	400	21,464.00	0.11
48	600526	菲达环保	5,200	21,372.00	0.11
49	688128	中国电器研究院	876	20,796.24	0.10
50	605005	合兴股份	1,300	20,553.00	0.10
51	301339	通行宝	2,000	20,460.00	0.10
52	300701	森霸传感	2,000	19,140.00	0.10
53	301059	金三江	1,700	18,853.00	0.09
54	600795	国电电力	3,800	17,746.00	0.09
55	605118	力鼎光电	500	17,445.00	0.09
56	601218	吉鑫科技	4,000	17,200.00	0.09
57	001229	魅视科技	460	16,707.20	0.08
58	301386	未来电器	800	16,488.00	0.08
59	300450	先导智能	400	16,288.00	0.08
60	002942	新农股份	1,100	15,763.00	0.08
61	601360	三六零	1,800	15,642.00	0.08
62	300987	川网传媒	1,200	14,760.00	0.07
63	001337	四川黄金	400	14,664.00	0.07
64	000795	英洛华	1,600	13,840.00	0.07
65	002415	海康威视	400	13,680.00	0.07
66	600673	东阳光	400	13,432.00	0.07
67	301156	美农生物	1,220	13,261.40	0.07

68	600580	卧龙电驱	400	13,240.00	0.07
69	000426	兴业银锡	400	13,184.00	0.07
70	601231	环旭电子	400	12,960.00	0.06
71	002294	信立泰	400	12,756.00	0.06
72	301138	华研精机	400	12,400.00	0.06
73	600096	云天化	400	12,160.00	0.06
74	300319	麦捷科技	400	11,852.00	0.06
75	600030	中信证券	400	11,492.00	0.06
76	002985	北摩高科	400	11,080.00	0.06
77	002558	巨人网络	400	11,024.00	0.05
78	601898	中煤能源	900	10,962.00	0.05
79	601168	西部矿业	400	10,856.00	0.05
80	300696	爱乐达	400	10,412.00	0.05
81	002933	新兴装备	400	10,340.00	0.05
82	601899	紫金矿业	400	10,056.00	0.05
83	300299	富春股份	2,000	9,800.00	0.05
84	002202	金风科技	400	9,560.00	0.05
85	002817	黄山胶囊	1,600	9,376.00	0.05
86	301508	中机认检	400	9,256.00	0.05
87	002128	电投能源	400	9,248.00	0.05
88	600406	国电南瑞	400	9,140.00	0.05
89	000895	双汇发展	400	8,960.00	0.04
89	300678	中科信息	400	8,960.00	0.04
91	000807	云铝股份	400	8,856.00	0.04
92	001218	丽臣实业	400	8,824.00	0.04
93	003039	顺控发展	800	8,808.00	0.04
94	002935	天奥电子	400	8,776.00	0.04
95	301020	密封科技	400	8,736.00	0.04
96	002600	领益智造	500	8,670.00	0.04
97	000933	神火股份	400	8,480.00	0.04
98	000045	深纺织 A	800	8,432.00	0.04
99	002782	可立克	400	8,420.00	0.04
100	603987	康德莱	1,200	8,280.00	0.04
101	300172	中电环保	2,000	8,260.00	0.04
102	000676	智度股份	1,600	8,176.00	0.04
103	600267	海正药业	800	8,088.00	0.04
104	301223	中荣股份	500	8,060.00	0.04
105	002107	沃华医药	1,400	7,966.00	0.04
106	001319	铭科精技	400	7,840.00	0.04
107	603050	科林电气	400	7,824.00	0.04
108	600250	南京商旅	1,000	7,710.00	0.04
109	600007	中国国贸	400	7,592.00	0.04
110	002287	奇正藏药	400	7,536.00	0.04

111	300447	全信股份	500	7,465.00	0.04
112	600479	千金药业	800	7,440.00	0.04
113	301185	鸥玛软件	500	7,430.00	0.04
114	600933	爱柯迪	500	7,390.00	0.04
115	002912	中新赛克	400	7,376.00	0.04
116	003006	百亚股份	500	7,255.00	0.04
117	001216	华瓷股份	500	7,055.00	0.04
118	002602	世纪华通	500	7,050.00	0.04
119	003025	思进智能	500	7,040.00	0.03
120	601326	秦港股份	2,200	6,952.00	0.03
121	603888	新华网	400	6,812.00	0.03
122	300550	和仁科技	500	6,665.00	0.03
123	601166	兴业银行	400	6,624.00	0.03
124	000920	沃顿科技	400	6,584.00	0.03
125	300962	中金辐照	500	6,250.00	0.03
126	301167	建研设计	500	6,195.00	0.03
127	300529	健帆生物	400	6,160.00	0.03
128	300922	天秦装备	400	6,060.00	0.03
129	601965	中国汽研	500	5,980.00	0.03
130	600558	大西洋	1,200	5,928.00	0.03
131	600550	保变电气	500	5,865.00	0.03
132	603036	如通股份	400	5,784.00	0.03
133	002690	美亚光电	400	5,732.00	0.03
134	600354	敦煌种业	1,200	5,712.00	0.03
135	300303	聚飞光电	500	5,530.00	0.03
136	603999	读者传媒	1,100	5,500.00	0.03
137	002125	湘潭电化	400	5,464.00	0.03
138	300512	中亚股份	800	5,456.00	0.03
138	603025	大豪科技	400	5,456.00	0.03
140	300407	凯发电气	500	5,400.00	0.03
141	600288	大恒科技	400	5,320.00	0.03
142	002209	达意隆	500	5,190.00	0.03
143	603927	中科软	400	5,084.00	0.03
144	300018	中元股份	400	4,940.00	0.02
145	002275	桂林三金	400	4,876.00	0.02
146	603803	瑞斯康达	400	4,696.00	0.02
147	300259	新天科技	700	4,641.00	0.02
148	300079	数码视讯	1,100	4,620.00	0.02
149	603739	蔚蓝生物	400	4,612.00	0.02
150	300047	天源迪科	500	4,440.00	0.02
151	605577	龙版传媒	500	4,405.00	0.02
152	601061	中信金属	400	4,308.00	0.02
153	002532	天山铝业	400	4,292.00	0.02

154	603167	渤海轮渡	500	4,285.00	0.02
155	003040	楚天龙	400	4,248.00	0.02
156	601890	亚星锚链	500	4,085.00	0.02
157	605066	天正电气	600	4,074.00	0.02
158	000425	徐工机械	500	4,045.00	0.02
159	600739	辽宁成大	400	4,044.00	0.02
160	600099	林海股份	500	3,990.00	0.02
161	002331	皖通科技	500	3,695.00	0.02
162	600191	华资实业	400	3,640.00	0.02
163	000798	中水渔业	500	3,530.00	0.02
164	000166	申万宏源	800	3,520.00	0.02
165	002661	克明食品	500	3,465.00	0.02
166	601918	新集能源	400	3,436.00	0.02
167	002905	金逸影视	500	3,375.00	0.02
168	600373	中文传媒	500	3,315.00	0.02
168	601086	国芳集团	500	3,315.00	0.02
170	002958	青农商行	1,200	3,288.00	0.02
170	601600	中国铝业	400	3,288.00	0.02
172	002372	伟星新材	400	3,276.00	0.02
173	300264	佳创视讯	400	3,252.00	0.02
174	000571	新大洲 A	500	3,165.00	0.02
175	300099	尤洛卡	500	3,160.00	0.02
176	300022	吉峰科技	400	3,108.00	0.02
177	000679	大连友谊	500	3,085.00	0.02
178	000017	深中华 A	500	3,060.00	0.02
179	000670	盈方微	400	3,036.00	0.02
180	002607	中公教育	1,600	2,880.00	0.01
181	002376	新北洋	500	2,875.00	0.01
182	000856	冀东装备	400	2,860.00	0.01
182	002279	久其软件	500	2,860.00	0.01
184	300464	星徽股份	400	2,852.00	0.01
185	603707	健友股份	400	2,828.00	0.01
186	000958	电投产融	500	2,820.00	0.01
187	600019	宝钢股份	500	2,715.00	0.01
188	601921	浙版传媒	400	2,676.00	0.01
189	002999	天禾股份	500	2,660.00	0.01
190	300187	永清环保	500	2,525.00	0.01
191	002483	润邦股份	500	2,470.00	0.01
192	603326	我乐家居	400	2,464.00	0.01
193	002027	分众传媒	500	2,420.00	0.01
194	600050	中国联通	600	2,400.00	0.01
195	000633	合金投资	500	2,380.00	0.01
195	601568	北元化工	700	2,380.00	0.01

197	002540	亚太科技	500	2,335.00	0.01
198	000715	中兴商业	500	2,320.00	0.01
199	600959	江苏有线	800	2,312.00	0.01
200	002404	嘉欣丝绸	400	2,288.00	0.01
201	002616	长青集团	500	2,235.00	0.01
202	000563	陕国投 A	800	2,208.00	0.01
203	300247	融捷健康	600	2,202.00	0.01
204	300292	吴通控股	400	2,168.00	0.01
205	300664	鹏鹞环保	500	2,120.00	0.01
206	002666	德联集团	500	1,975.00	0.01
207	002385	大北农	700	1,932.00	0.01
208	000889	中嘉博创	500	1,685.00	0.01
209	002228	合兴包装	500	1,470.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300136	信维通信	314,929.00	1.53
2	002273	水晶光电	309,144.00	1.50
3	002517	恺英网络	294,764.00	1.43
4	002281	光迅科技	292,964.00	1.42
5	000933	神火股份	285,365.00	1.38
6	002294	信立泰	281,617.00	1.37
7	300458	全志科技	267,839.00	1.30
8	300627	华测导航	265,782.00	1.29
9	002414	高德红外	257,392.00	1.25
10	300223	北京君正	252,155.00	1.22
11	002195	岩山科技	251,129.00	1.22
12	002156	通富微电	249,641.00	1.21
13	688361	中科飞测	248,028.00	1.20
14	300699	光威复材	246,799.00	1.20
15	002532	天山铝业	240,534.00	1.17
16	300604	长川科技	239,481.00	1.16
17	002008	大族激光	237,703.00	1.15
18	000021	深科技	237,045.00	1.15
19	688235	百济神州	236,612.00	1.15
20	002261	拓维信息	233,908.00	1.13

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	002156	通富微电	523,031.00	2.54
2	000933	神火股份	465,072.00	2.25
3	002532	天山铝业	415,339.00	2.01
4	000021	深科技	392,096.00	1.90
5	002056	横店东磁	376,297.00	1.82
6	002273	水晶光电	372,183.00	1.80
7	300054	鼎龙股份	364,266.00	1.77
8	000783	长江证券	338,931.00	1.64
9	600487	亨通光电	332,887.00	1.61
10	300373	扬杰科技	330,553.00	1.60
11	002138	顺络电子	323,398.00	1.57
12	300017	网宿科技	315,529.00	1.53
13	300012	华测检测	302,776.00	1.47
14	300623	捷捷微电	302,105.28	1.46
15	000060	中金岭南	301,605.00	1.46
16	002185	华天科技	295,642.00	1.43
17	601168	西部矿业	295,280.00	1.43
18	300627	华测导航	291,953.20	1.42
19	300001	特锐德	287,003.00	1.39
20	002202	金风科技	285,338.00	1.38

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	43,107,944.46
卖出股票收入（成交）总额	44,610,074.58

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）	4,000.16	0.02
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	4,000.16	0.02

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	30	3,000.14	0.01
2	118071	华峰转债	10	1,000.02	0.00

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	6,954.94
2	应收清算款	13,646.26
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	20,601.20

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

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 (%)
661	20,397.88	6,191,000.00	45.92	7,292,000.00	54.08

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 07 月 19 日）基金份额总额	961,483,000.00
本报告期期初基金份额总额	15,483,000.00
本报告期基金总申购份额	14,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	16,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	13,483,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
银河证券	5	43,392,560.34	49.47	7,632.66	49.47	
华泰证券	2	18,840,451.42	21.48	3,314.11	21.48	
国泰海通	4	12,055,504	13.74	2,121.03	13.75	

		.67				
国信证券	2	3,875,370.20	4.42	681.81	4.42	
广发证券	1	2,891,001.56	3.30	508.54	3.30	
方正证券	1	1,847,809.00	2.11	325.06	2.11	
光大证券	1	1,802,734.91	2.06	316.65	2.05	
兴业证券	1	1,652,766.94	1.88	290.59	1.88	
招商证券	4	976,804.00	1.11	171.88	1.11	
国投证券	2	383,016.00	0.44	67.39	0.44	
长江证券	1	—	—	—	—	
东方证券	4	—	—	—	—	
东吴证券	2	—	—	—	—	
东兴证券	1	—	—	—	—	
高盛中国	1	—	—	—	—	
国都证券	1	—	—	—	—	
国金证券	2	—	—	—	—	
华鑫证券	3	—	—	—	—	
上海证券	1	—	—	—	—	
申万宏源 证券	1	—	—	—	—	
西南证券	1	—	—	—	—	
中金财富	1	—	—	—	—	
中金公司	2	—	—	—	—	
中泰证券	1	—	—	—	—	
中信建投 证券	1	—	—	—	—	
中信证券	1	—	—	—	—	
中银国际	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	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额的 比例 (%)		购成交 总额的 比例 (%)		交总额的 比例 (%)		交总额的 比例 (%)
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券	7,905.6 4	100.00	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中 国	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-	-	-

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:

本基金本报告期内退租 1 家证券公司的 2 个交易单元:国新证券(上交所单元,深交所单元)。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关	中国证监会基金电子	2026 年 01 月 12 日

	于旗下部分基金增加世纪证券为申购赎回代理券商的公告	披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金公司为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 02 月 26 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 04 月 22 日
7	2025 年度汇添富基金管理股份有限公司以股东身份(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
8	汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 06 月 06 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)

		间					
机构	1	2026 年 2 月 11 日至 2026 年 2 月 11 日,2026 年 5 月 26 日至 2026 年 5 月 28 日,2026 年 6 月 5 日至 2026 年 6 月 7 日,2026 年 6 月 9 日至 2026 年 6 月 14 日,2026 年 6 月 29 日至 2026 年 6 月 30 日	726,390.00	19,495,400.00	17,243,300.00	2,978,490.00	22.09
	2	2026 年 1 月 6 日至 2026 年 1 月 7 日	1,877,810.00	17,167,800.00	17,924,000.00	1,121,610.00	8.32
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日