

汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	21
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	22
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	22
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.....	22
§ 5 托管人报告.....	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	23
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.....	23
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	23
6.1 资产负债表.....	23
6.2 利润表.....	24
6.3 净资产变动表.....	26
6.4 报表附注.....	27
§ 7 投资组合报告.....	53
7.1 期末基金资产组合情况.....	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
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.....	74
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.....	74
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.....	74
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.....	74

7.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	74
§ 8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
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	76
§ 9 开放式基金份额变动	76
§ 10 重大事件揭示	77
10.1 基金份额持有人大会决议	77
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	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	77
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	77
10.8 其他重大事件	79
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	80
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	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§ 12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录	80
12.2 存放地点	80
12.3 查阅方式	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富中证 A500 指数增强	
基金主代码	023298	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 03 月 27 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	国信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	2,667,044,442.66	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 A500 指数增强 A	汇添富中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023298	023299
报告期末下属分级基金的份 额总额(份)	1,637,311,932.71	1,029,732,509.95

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	国信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	薛璐
	联系电话	021-28932888	0755-22940163
	电子邮箱	service@99fund.com	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	0755-61897778
传真		021-28932998	0755-22940165
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼
邮政编码		200010	518000
法定代表人		鲁伟铭	张纳沙

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)	
	汇添富中证 A500 指数增强 A	汇添富中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	190,120,533.86	113,215,328.86
本期利润	227,932,627.99	166,893,128.35
加权平均基金份额本期利润	0.2045	0.2394
本期加权平均净值利润率	13.71%	16.21%
本期基金份额净值增长率	17.35%	17.12%

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	646,118,660.94	398,574,737.18
期末可供分配基金份额利润	0.3946	0.3871
期末基金资产净值	2,605,587,362.78	1,630,404,534.32
期末基金份额净值	1.5914	1.5833
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	59.14%	58.33%

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

汇添富中证 A500 指数增强 A						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	14.79%	1.34%	13.54%	1.34%	1.25%	0.00%
过去六个月	17.35%	1.26%	11.34%	1.22%	6.01%	0.04%
过去一年	47.30%	1.10%	34.41%	1.09%	12.89%	0.01%
自基金合 同生效起 至今	59.14%	1.02%	34.21%	1.09%	24.93%	-0.07%
汇添富中证 A500 指数增强 C						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	14.67%	1.34%	13.54%	1.34%	1.13%	0.00%
过去六个	17.12%	1.25%	11.34%	1.22%	5.78%	0.03%

月						
过去一年	46.70%	1.10%	34.41%	1.09%	12.29%	0.01%
自基金合同生效起至今	58.33%	1.02%	34.21%	1.09%	24.12%	-0.07%

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

汇添富中证A500指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证A500指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2025 年 03 月 27 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		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2025 年 03 月 27 日	—	20	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助

					理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

					2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。 2015 年 2 月 16 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。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年
--	--	--	--	--	--

					1 月 21 日至 今任汇添富 中证精准医 疗主题指数 型发起式证 券投资基金 （LOF）的基 金经理。 2016 年 7 月 28 日至今任 中证上海国 企交易型开 放式指数证 券投资基金 的基金经 理。2016 年 12 月 22 日 至今任汇添 富中证互联 网医疗主题 指数型发起 式证券投资 基金（LOF） 的基金经 理。2017 年 8 月 10 日至 2025 年 10 月 30 日任汇 添富中证 500 指数型 发起式证券 投资基金 （LOF）的基 金经理。 2018 年 3 月 23 日至 2024 年 4 月 26 日 任汇添富沪 深 300 指数 增强型证券 投资基金的 基金经理。 2019 年 7 月 26 日至 2022
--	--	--	--	--	---

					年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开
--	--	--	--	--	---

					放式指数证 券投资基金 的基金经 理。2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 日任汇添 富 MSCI 中国 A50 互联互 通交易型开 放式指数证 券投资基金 联接基金的 基金经理。 2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日 任汇添富中 证智能汽车 主题交易型 开放式指数 证券投资基金 的基金经 理。2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日任汇添 富中证沪港 深张江自主 创新 50 交易 型开放式指 数证券投资 基金的基金 经理。2023 年 4 月 25 日 至 2024 年 4 月 26 日任汇 添富中证 500 指数增 强型证券投 资基金的基 金经理。 2023 年 6 月 6 日至 2025
--	--	--	--	--	---

					年 11 月 10 日任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。 2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 22 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳丰回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 10 日至 2024 年 12 月 11 日任汇添富中证 A500 指数型证券投资基金的基金经理。2024
--	--	--	--	--	---

					年 12 月 12 日至 2026 年 5 月 26 日任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 3 月 27 日至今任汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月 31 日至 2026 年 5 月 26 日任汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。 2026 年 3 月 31 日至今任汇添富中证港股通综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月 26 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

					2026 年 5 月 26 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
王星星	本基金的基金经理	2025 年 03 月 27 日	-	11	国籍：中国。学历：中国人民大学金融工程硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历： 2015 年 8 月至 2023 年 2 月任东方证券股份有限公司证券研究所研究员、高级研究员、高级分析师、业务总监（研究）。2023 年 2 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。 2023 年 6 月 29 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 11 月 7 日至今

					任汇添富国 证 2000 指数 增强型证券 投资基金的 基金经理。 2025 年 3 月 27 日至今任 汇添富中证 A500 指数增 强型证券投 资基金的基 金经理。 2025 年 9 月 30 日至今任 汇添富沪深 300 指数量 化增强型证 券投资基金 的基金经 理。2025 年 11 月 10 日 至今任汇添 富量化选股 混合型证券 投资基金的 基金经理。 2026 年 6 月 23 日至今任 汇添富上证 科创板综合 价格指数增 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，科技股强势，成长风格相对占优，中证 A500 指数整体震荡上行，产品在报告期内运作平稳，跑赢基准指数。

本基金采用量化指数增强的方式运作，在控制组合相对基准跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。具体操作上，我们采用多因子模型和 AI 量化选股相结合的方式评价个股，在严控组合和基准之间风格和行业偏离的条件下，超配评价较高的个股、低配评价较低的个股以实现超额收益。报告期内个股偏离相对较低，组合持仓相对分散，以降低组合对个股的依赖，提升组合超额稳定性，同时对风险事件实时监控，及时剔除风险个股，降低组合尾部风险。投资管理过程中我们尽量避免对组合持仓的直接干预，将投资观点和思想转化为规则化的量化投资策略，审慎地调整量化策略去间接调整组合持仓，以保证投资管理的可复制性，同时避免情绪波动对组合投资的负面影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 A500 指数增强 A 类份额净值增长率为 17.35%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。本报告期汇添富中证 A500 指数增强 C 类份额净值增长率为 17.12%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，上半年经济运行总体平稳，新旧动能转换持续推进，新经济领域保持较好活力，传统领域则面临一定调整压力。展望下半年，宏观政策预计延续积极取向，内需修复和产业升级仍是重要支撑，但外部环境存在不确定性，经济复苏节奏可能温和曲折。整体看，经济有望保持基本稳定，不同部门之间的结构性差异或逐步趋于收敛。

证券市场方面，上半年市场呈现明显的结构性特征，各板块表现差异较大。展望下半年，随着上市公司基本面逐步验证，市场关注点可能从估值预期转向业绩兑现，风格轮动或趋于均衡。在流动性合理充裕的环境下，整体机会与局部风险并存，指数层面可能维持震荡格局，但行业和个股之间的表现差异有望收窄。

行业走势方面，科技成长领域仍具备长期发展逻辑，但需精选有实质进展的方向；传统消费和制造板块在政策支持及自身修复作用下，也可能迎来边际改善。能源、资源等领域同样存在阶段性机会。总体看，行业配置应更注重均衡，既不过度集中于单一赛道，也不忽视

低估值板块的修复潜力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	248,978,867.58	76,366,368.53
结算备付金		2,579,020.92	3,020,852.76
存出保证金		5,586,969.60	1,322,841.60
交易性金融资产	6.4.7.2	3,954,538,787.12	1,243,499,379.97
其中：股票投资		3,954,538,787.12	1,243,499,379.97
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		48,671,154.97	30,670,969.88
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,260,354,800.19	1,354,880,412.74
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		20,508,672.34	10,701,505.14
应付管理人报酬		2,583,707.57	824,206.09
应付托管费		645,926.91	206,051.53
应付销售服务费		457,310.30	177,929.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		77,919.38	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	89,366.59	130,000.00
负债合计		24,362,903.09	12,039,692.75
净资产:			
实收基金	6.4.7.8	2,667,044,442.66	991,507,408.92
未分配利润	6.4.7.9	1,568,947,454.44	351,333,311.07
净资产合计		4,235,991,897.10	1,342,840,719.99
负债和净资产总计		4,260,354,800.19	1,354,880,412.74

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,667,044,442.66 份。本基金下属汇添富中证 A500 指数增强 A 基金份额净值 1.5914 元，基金份额总额 1,637,311,932.71 份；本基金下属汇添富中证 A500 指数增强 C 基金份额净值 1.5833 元，基金份额总额 1,029,732,509.95 份。

2、本基金合同于 2025 年 03 月 27 日生效，上年度实际报告期间为 2025 年 03 月 27 日至 2025 年 12 月 31 日，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金

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 03 月 27 日 (基金合同生效 日)至 2025 年 06
-----	-----	---	---

			月 30 日
一、营业总收入		410,191,682.95	19,070,804.16
1. 利息收入		245,869.63	291,862.52
其中：存款利息收入	6.4.7.10	245,869.63	65,724.80
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		-	226,137.72
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		317,919,362.81	13,624,165.64
其中：股票投资收益	6.4.7.11	289,804,644.80	11,789,431.66
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	2,315,955.38	-
股利收益	6.4.7.17	25,798,762.63	1,834,733.98
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	91,489,893.62	5,153,808.12
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	536,556.89	967.88
减：二、营业总支出		15,365,926.61	921,044.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,585,413.91	580,143.40
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,646,353.51	145,035.86
3. 销售服务费		2,036,550.53	151,287.22
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		8,348.51	6.08
8. 其他费用	6.4.7.21	89,260.15	44,571.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		394,825,756.34	18,149,759.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		394,825,756.34	18,149,759.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		394,825,756.34	18,149,759.76

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金

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	991,507,408.92	351,333,311.07	1,342,840,719.99
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	991,507,408.92	351,333,311.07	1,342,840,719.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,675,537,033.74	1,217,614,143.37	2,893,151,177.11
（一）、综合收益总额	-	394,825,756.34	394,825,756.34
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,675,537,033.74	822,788,387.03	2,498,325,420.77
其中：1. 基金申购款	4,274,526,265.10	2,105,455,723.97	6,379,981,989.07
2. 基金赎回款	-2,598,989,231.36	-1,282,667,336.94	-3,881,656,568.30
（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	2,667,044,442.66	1,568,947,454.44	4,235,991,897.10
项目	上年度可比期间		
	2025 年 03 月 27 日（基金合同生效日）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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-

二、本期期初净资产	530,932,800.74	-	530,932,800.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-420,527,948.12	8,819,894.37	-411,708,053.75
（一）、综合收益总额	-	18,149,759.76	18,149,759.76
（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）	-420,527,948.12	-9,329,865.39	-429,857,813.51
其中：1. 基金申购款	32,086,411.96	1,557,118.44	33,643,530.40
2. 基金赎回款	-452,614,360.08	-10,886,983.83	-463,501,343.91
（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	110,404,852.62	8,819,894.37	119,224,746.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可（2025）45 号文《关于准予汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。本基金募集期间为 2025 年 3 月 12 日起至 2025 年 3 月 25 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 530,806,997.33 元，在募集期间产生的利息为人民币 125,803.41 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 530,932,800.74 元，折合

530,932,800.74 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（2025）验字第 70015647_B07 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于 2025 年 3 月 27 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为国信证券股份有限公司。

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	44,047,589.42
等于：本金	44,034,256.02
加：应计利息	13,333.40
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	204,931,278.16
等于：本金	204,928,257.42
加：应计利息	3,020.74
减：坏账准备	-
合计	248,978,867.58

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,819,018,990.82	-	3,954,538,787.12	135,519,796.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,819,018,990.82	-	3,954,538,787.12	135,519,796.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	46,972,860.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	46,972,860.00	-	-	-

资)				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	46,972,860.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2609	IF2609	32	46,558,080.00	-414,780.00
合计				-414,780.00
减：可抵销期货暂收款				-414,780.00
净额				-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	106.44
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	29,752.78
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	89,366.59

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 A500 指数增强 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	576,647,780.76	576,647,780.76
本期申购	2,265,529,030.23	2,265,529,030.23
本期赎回（以“-”号填列）	-1,204,864,878.28	-1,204,864,878.28
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,637,311,932.71	1,637,311,932.71
汇添富中证 A500 指数增强 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	414,859,628.16	414,859,628.16
本期申购	2,008,997,234.87	2,008,997,234.87
本期赎回（以“-”号填列）	-1,394,124,353.08	-1,394,124,353.08
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,029,732,509.95	1,029,732,509.95

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

汇添富中证 A500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	129,447,214.77	75,900,312.19	205,347,526.96
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	129,447,214.77	75,900,312.19	205,347,526.96
本期利润	190,120,533.86	37,812,094.13	227,932,627.99
本期基金份额交易产生的变动数	326,550,912.31	208,444,362.81	534,995,275.12
其中：基金申购款	725,701,478.37	410,678,935.85	1,136,380,414.22
基金赎回款	-399,150,566.06	-202,234,573.04	-601,385,139.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	646,118,660.94	322,156,769.13	968,275,430.07
汇添富中证 A500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	91,476,101.19	54,509,682.92	145,985,784.11
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	91,476,101.19	54,509,682.92	145,985,784.11
本期利润	113,215,328.86	53,677,799.49	166,893,128.35
本期基金份额交易产生的变动数	193,883,307.13	93,909,804.78	287,793,111.91
其中：基金申购款	625,083,050.47	343,992,259.28	969,075,309.75
基金赎回款	-431,199,743.34	-250,082,454.50	-681,282,197.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	398,574,737.18	202,097,287.19	600,672,024.37

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	169,861.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	47,793.42
结算备付金利息收入	18,289.91
其他	9,924.87
合计	245,869.63

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	10,469,505,349.12
减：卖出股票成本总额	10,168,676,346.07
减：交易费用	11,024,358.25
买卖股票差价收入	289,804,644.80

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	2,315,955.38
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

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	25,798,762.63
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	25,798,762.63

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	92,071,413.62
——股票投资	92,071,413.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-581,520.00
——权证投资	-
——期货投资	-581,520.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	91,489,893.62

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	536,556.89
替代损益	-
其他	-
合计	536,556.89

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
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	89,260.15

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
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	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 03 月 27 日（基金合同生效日）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（%）
国信证券	14,630,267,721.11	62.91	768,864,304.94	70.90

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

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 03 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交	成交金额	占当期回购成交

		总额的比例 (%)		总额的比例 (%)
国信证券	-	-	1,150,200,000.00	87.64

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 (%)
国信证券	2,719,771.29	63.27	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 03 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国信证券	142,928.37	71.25	-	-

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 03 月 27 日 （基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
----	---	---

当期发生的基金应支付的管理费	10,585,413.91	580,143.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,640,181.73	270,961.60
应支付基金管理人的净管理费	6,945,232.18	309,181.80

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 03 月 27 日（基 金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,646,353.51	145,035.86

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		
	汇添富中证 A500 指数增强 A	汇添富中证 A500 指数增强 C	合计
东方证券股份有限公司	-	2,277.22	2,277.22
汇添富基金管理股份有限公司	-	128,675.52	128,675.52
国信证券股份有限公司	-	432,338.17	432,338.17
合计	-	563,290.91	563,290.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 03 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 A500 指数增强 A	汇添富中证 A500 指数增强 C	合计
东方证券股份有限公司	-	26.26	26.26
汇添富基金管理股份有限公司	-	379.56	379.56
国信证券股份有限公司	-	59,714.18	59,714.18
合计	-	60,120.00	60,120.00

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%。

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

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 03 月 27 日（基金合同生效日）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
国信证券	145,171,159.98	25,348.15	632,698.91	6,748.69

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于基金托管人基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

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
001220	世盟股份	2026 年 01 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	

301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	
301680	固德电材	2026 年 02 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	
301683	慧谷新材	2026 年 03 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	
603293	埃泰克汽车电子	2026 年 04 月 09 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	

688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	
688785	恒运昌股份	2026 年 01 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	
688811	有研金属复材	2026 年 04 月 01 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	
688813	泰金新能	2026 年 03 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	
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
					-	-	-	-	-	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300214	日科化学	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	10.25	2026 年 07 月 13 日	12.30	49,200	487,860.00	504,300.00	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

6.4.13.3 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	248,978, 867.58	-	-	-	-	-	248,978, 867.58
结算备付 金	2,579,02 0.92	-	-	-	-	-	2,579,02 0.92
存出保证 金	-	-	-	-	-	5,586,96 9.60	5,586,96 9.60
交易性金 融资产	-	-	-	-	-	3,954,53 8,787.12	3,954,53 8,787.12
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售 金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购 款	-	-	-	-	-	48,671,1 54.97	48,671,1 54.97
递延所得 税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	251,557, 888.50	-	-	-	-	4,008,79 6,911.69	4,260,35 4,800.19
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	-	-	-	-	-	20,508,6 72.34	20,508,6 72.34
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	2,583,70 7.57	2,583,70 7.57

应付托管费	-	-	-	-	-	645,926.91	645,926.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	457,310.30	457,310.30
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	77,919.38	77,919.38
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	89,366.59	89,366.59
负债总计	-	-	-	-	-	24,362,903.09	24,362,903.09
利率敏感度缺口	251,557,888.50	-	-	-	-	3,984,434,008.60	4,235,991,897.10
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	76,366,368.53	-	-	-	-	-	76,366,368.53
结算备付金	3,020,852.76	-	-	-	-	-	3,020,852.76
存出保证金	-	-	-	-	-	1,322,841.60	1,322,841.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,243,499,379.97	1,243,499,379.97
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	-	-	-	-	-	30,670,969.88	30,670,969.88
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	79,387,221.29	-	-	-	-	1,275,493,191.45	1,354,880,412.74
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	-	-	-	-	-	10,701,505.14	10,701,505.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	824,206.09	824,206.09
应付托管费	-	-	-	-	-	206,051.53	206,051.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	177,929.99	177,929.99
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	-	-	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	12,039,692.75	12,039,692.75
利率敏感度缺口	79,387,221.29	-	-	-	-	1,263,453,498.70	1,342,840,719.99

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	3,954,538,787.12	93.36	1,243,499,379.97	92.60
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	3,954,538,787.12	93.36	1,243,499,379.97	92.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
		中证 A500 上涨 5%	203,883,034.95
	中证 A500 下跌 5%	-203,883,034.95	-49,652,030.94

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	3,952,985,124.77
第二层次	519,467.10
第三层次	1,034,195.25
合计	3,954,538,787.12

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业等情况，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	3,954,538,787.12	92.82
	其中：股票	3,954,538,787.12	92.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	251,557,888.50	5.90
8	其他各项资产	54,258,124.57	1.27
9	合计	4,260,354,800.19	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	-	-
B	采矿业	196,520,213.36	4.64
C	制造业	2,274,733,493.61	53.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,602,483.00	1.36
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,570,000.00	0.58

G	交通运输、仓储和邮政业	125,613,525.53	2.97
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	97,862,736.34	2.31
J	金融业	413,036,616.82	9.75
K	房地产业	9,308,068.00	0.22
L	租赁和商务服务业	5,080,295.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	63,008,514.00	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	13,974,708.00	0.33
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	3,281,310,653.66	77.46

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	420,320.00	0.01
B	采矿业	15,071,718.00	0.36
C	制造业	511,182,687.34	12.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,683,239.00	0.06
E	建筑业	1,360,100.00	0.03
F	批发和零售业	2,504,330.88	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	9,256,088.34	0.22
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,091,104.20	0.03
J	金融业	80,925,412.50	1.91
K	房地产业	3,269,536.00	0.08
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	22,553,050.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	22,910,547.20	0.54
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	673,228,133.46	15.89

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	300308	中际旭创	142,600	181,102,000.00	4.28
2	300750	宁德时代	345,840	135,918,578.40	3.21
3	300502	新易盛	129,580	78,655,060.00	1.86
4	688256	寒武纪科技	46,552	74,276,043.60	1.75
5	601318	中国平安	1,438,915	68,693,802.10	1.62
6	600519	贵州茅台	53,800	63,779,362.00	1.51
7	601899	紫金矿业	2,441,750	61,385,595.00	1.45
8	000333	美的集团	736,098	55,597,481.94	1.31
9	688041	海光信息	150,043	55,560,922.90	1.31
10	002475	立讯精密	787,200	55,418,880.00	1.31
11	002384	东山精密	200,100	52,496,235.00	1.24
12	688981	中芯国际	317,793	50,471,884.26	1.19
13	603259	药明康德	399,600	49,754,196.00	1.17
14	600030	中信证券	1,580,400	45,404,892.00	1.07
15	603986	兆易创新	55,335	45,098,025.00	1.06

16	300059	东方财富	2,094,804	42,692,105. 52	1.01
17	600183	生益科技	242,504	42,050,193. 60	0.99
18	601398	工商银行	5,533,300	39,120,431. 00	0.92
19	002463	沪电股份	243,400	37,191,520. 00	0.88
20	300476	胜宏科技	107,000	37,068,010. 00	0.88
21	688498	源杰科技	18,600	35,079,600. 00	0.83
22	600036	招商银行	919,900	32,656,450. 00	0.77
23	601288	农业银行	5,309,100	32,226,237. 00	0.76
24	603019	中科曙光	293,600	31,482,728. 00	0.74
25	601328	交通银行	4,779,130	30,729,805. 90	0.73
26	600150	中国船舶	894,725	30,232,757. 75	0.71
27	603993	洛阳钼业	1,687,500	29,615,625. 00	0.70
28	600176	中国巨石	403,700	29,421,656. 00	0.69
29	000338	潍柴动力	1,073,300	29,247,425. 00	0.69
30	002916	深南电路	61,600	28,206,640. 00	0.67
31	600309	万华化学	397,211	27,173,204. 51	0.64
32	002415	海康威视	790,800	27,045,360. 00	0.64
33	300857	协创数据	76,912	26,142,388. 80	0.62
34	300124	汇川技术	387,800	25,722,774. 00	0.61
35	002371	北方华创	29,035	25,683,199. 60	0.61
36	601857	中国石油	2,911,200	25,269,216. 00	0.60
37	300475	香农芯创	81,900	24,570,000. 00	0.58

38	002028	思源电气	139,603	24,151,319.00	0.57
39	300014	亿纬锂能	368,900	23,989,567.00	0.57
40	600031	三一重工	1,360,100	23,502,528.00	0.55
41	002156	通富微电	309,400	23,474,178.00	0.55
42	600549	厦门钨业	273,800	23,327,760.00	0.55
43	000792	盐湖股份	757,600	22,871,944.00	0.54
44	300408	三环集团	134,953	22,523,655.70	0.53
45	000100	TCL 科技	3,775,155	21,971,402.10	0.52
46	002353	杰瑞股份	143,900	21,944,750.00	0.52
47	601988	中国银行	3,823,300	21,869,276.00	0.52
48	600900	长江电力	816,600	21,615,402.00	0.51
49	300033	同花顺	86,620	20,875,420.00	0.49
50	603799	华友钴业	431,638	20,830,849.88	0.49
51	000938	紫光股份	721,600	20,825,376.00	0.49
52	688012	中微半导体设备	44,007	20,617,279.50	0.49
53	002938	鹏鼎控股	195,530	20,604,951.40	0.49
54	601985	中国核电	2,271,900	20,515,257.00	0.48
55	002600	领益智造	1,176,100	20,393,574.00	0.48
56	600938	中国海油	726,500	19,724,475.00	0.47
57	688002	睿创微纳	127,200	19,676,568.00	0.46
58	002049	紫光国微	219,500	19,480,625.00	0.46
59	688008	澜起科技	62,465	19,357,903.50	0.46

60	002851	麦格米特	114,573	19,154,314.14	0.45
61	601628	中国人寿	539,338	19,065,598.30	0.45
62	605117	德业股份	177,740	18,872,433.20	0.45
63	601872	招商轮船	1,069,634	18,793,469.38	0.44
64	601100	恒立液压	170,300	18,317,468.00	0.43
65	000425	徐工机械	2,261,671	18,296,918.39	0.43
66	600489	中金黄金	1,010,600	18,241,330.00	0.43
67	600893	航发动力	472,700	18,123,318.00	0.43
68	000408	藏格矿业	259,300	17,974,676.00	0.42
69	603288	海天味业	541,535	17,957,300.60	0.42
70	600487	亨通光电	163,255	17,850,301.70	0.42
71	002179	中航光电	382,900	17,689,980.00	0.42
72	000807	云铝股份	786,900	17,421,966.00	0.41
73	600362	江西铜业	396,700	17,177,110.00	0.41
74	600989	宝丰能源	843,400	17,146,322.00	0.40
75	002001	新 和 成	600,844	17,075,986.48	0.40
76	600875	东方电气	587,000	16,887,990.00	0.40
77	600418	江淮汽车	647,500	16,724,925.00	0.39
78	002080	中材科技	184,400	16,596,000.00	0.39
79	600547	山东黄金	702,492	16,220,540.28	0.38
80	000301	东方盛虹	1,412,100	16,168,545.00	0.38
81	002532	天山铝业	1,501,800	16,114,314.00	0.38

82	688111	金山办公	74,600	15,893,530.00	0.38
83	300568	星源材质	845,900	15,835,248.00	0.37
84	600115	中国东航	4,140,111	15,773,822.91	0.37
85	300458	全志科技	393,720	15,536,191.20	0.37
86	600026	中远海能	862,200	15,467,868.00	0.37
87	000975	山金国际	903,600	15,361,200.00	0.36
88	600233	圆通速递	970,900	15,291,675.00	0.36
89	601111	中国国航	2,518,100	15,234,505.00	0.36
90	002493	荣盛石化	1,406,600	15,120,950.00	0.36
91	300803	指南针	162,900	14,933,043.00	0.35
92	600029	南方航空	2,856,600	14,797,188.00	0.35
93	000725	京东方 A	1,695,800	14,719,544.00	0.35
94	601233	桐昆股份	676,500	14,646,225.00	0.35
95	002821	凯莱英	88,900	14,401,800.00	0.34
96	603806	福斯特	850,800	14,284,932.00	0.34
97	002271	东方雨虹	1,200,200	14,246,374.00	0.34
98	601166	兴业银行	856,300	14,180,328.00	0.33
99	601021	春秋航空	309,100	14,088,778.00	0.33
100	002266	浙富控股	2,761,800	13,974,708.00	0.33
101	600426	华鲁恒升	573,500	13,718,120.00	0.32
102	002414	高德红外	1,019,700	13,521,222.00	0.32
103	003816	中国广核	3,422,000	13,380,020.00	0.32

104	000933	神火股份	627,400	13,300,880.00	0.31
105	300012	华测检测	956,300	13,254,318.00	0.31
106	601677	明泰铝业	791,900	13,145,540.00	0.31
107	002064	华峰化学	1,360,400	12,910,196.00	0.30
108	002281	光迅科技	48,300	12,410,202.00	0.29
109	002185	华天科技	540,700	12,063,017.00	0.28
110	601658	邮储银行	2,418,800	11,924,684.00	0.28
111	002436	兴森科技	227,600	11,596,220.00	0.27
112	600816	建元信托	4,279,800	10,442,712.00	0.25
113	002709	天赐材料	188,700	9,704,841.00	0.23
114	300073	当升科技	202,000	9,704,080.00	0.23
115	002460	赣锋锂业	147,300	9,633,420.00	0.23
116	688166	博瑞生物医药	270,200	9,459,702.00	0.22
117	001979	招商蛇口	1,447,600	9,308,068.00	0.22
118	601000	唐山港	2,208,900	9,166,935.00	0.22
119	601600	中国铝业	1,055,200	8,673,744.00	0.20
120	603659	璞泰来	299,100	8,652,963.00	0.20
121	300919	中伟新材	190,900	8,351,875.00	0.20
122	601319	中国人保	1,205,700	8,150,532.00	0.19
123	300432	富临精工	402,500	8,086,225.00	0.19
124	601127	赛力斯	128,038	7,842,327.50	0.19
125	002602	世纪华通	545,600	7,692,960.00	0.18

126	600276	恒瑞医药	139,513	7,260,256.5 2	0.17
127	001965	招商公路	764,114	6,999,284.2 4	0.17
128	002594	比亚迪	87,700	6,989,690.0 0	0.17
129	300274	阳光电源	42,632	6,779,340.6 4	0.16
130	688578	艾力斯医药 科技	61,000	6,661,200.0 0	0.16
131	600988	赤峰黄金	237,600	6,253,632.0 0	0.15
132	002407	多氟多	116,340	5,843,758.2 0	0.14
133	000733	振华科技	94,500	5,352,480.0 0	0.13
134	002837	英维克	66,785	5,313,414.6 0	0.13
135	300049	福瑞医科	134,500	5,229,360.0 0	0.12
136	600887	伊利股份	192,500	4,612,300.0 0	0.11
137	002131	利欧股份	927,300	4,404,675.0 0	0.10
138	002812	恩捷股份	63,000	4,215,330.0 0	0.10
139	301358	湖南裕能	55,119	4,181,878.5 3	0.10
140	300394	天孚通信	12,240	3,704,803.2 0	0.09
141	002155	湖南黄金	139,500	3,329,865.0 0	0.08
142	300001	特锐德	80,900	3,060,447.0 0	0.07
143	600482	中国动力	85,100	2,791,280.0 0	0.07
144	600177	雅戈尔	336,305	2,532,376.6 5	0.06
145	600011	华能国际	275,600	2,091,804.0 0	0.05
146	002273	水晶光电	56,400	2,001,072.0 0	0.05
147	002025	航天电器	24,900	1,897,878.0 0	0.04

148	000988	华工科技	9,400	1,735,334.00	0.04
149	600711	盛屯矿业	101,900	1,117,843.00	0.03
150	000157	中联重科	129,900	905,403.00	0.02
151	000623	吉林敖东	44,900	796,077.00	0.02
152	000415	渤海租赁	166,000	675,620.00	0.02
153	000657	中钨高新	3,600	344,592.00	0.01
154	601601	中国太保	2,500	71,300.00	0.00
155	301308	江波龙	20	14,076.00	0.00
156	300763	锦浪科技	30	2,710.50	0.00
157	601689	拓普集团	30	1,692.60	0.00
158	601225	陕西煤业	40	814.00	0.00
159	600111	北方稀土	12	576.60	0.00
160	000960	锡业股份	8	341.52	0.00
161	002195	岩山科技	31	202.74	0.00
162	601088	中国神华	2	78.08	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001389	广合科技	60,200	14,282,450.00	0.34
2	002653	海思科	204,300	13,553,262.00	0.32
3	600601	方正科技	943,700	13,060,808.00	0.31
4	000810	创维数字	971,200	12,868,400.00	0.30
5	301536	星宸科技	98,700	12,703,677.00	0.30
6	688653	康希通信	721,600	12,541,408.00	0.30
7	600999	招商证券	593,500	12,522,850.00	0.30
8	688758	赛分科技	567,400	12,488,474.00	0.29
9	000776	广发证券	532,300	12,455,820.00	0.29

				00	
10	603588	高能环境	638,900	12,266,880.00	0.29
11	301086	鸿富瀚	58,320	12,205,209.60	0.29
12	300681	英搏尔	425,700	12,183,534.00	0.29
13	300590	移为通信	844,100	12,112,835.00	0.29
14	603638	艾迪精密	516,408	12,109,767.60	0.29
15	603268	松发股份	86,400	12,033,792.00	0.28
16	600961	株冶集团	371,400	12,029,646.00	0.28
17	000922	佳电股份	860,100	12,006,996.00	0.28
18	001339	智微智能	117,190	11,986,193.20	0.28
19	000783	长江证券	1,225,400	11,947,650.00	0.28
20	000969	安泰科技	485,900	11,923,986.00	0.28
21	688388	嘉元科技	269,600	11,862,400.00	0.28
22	301371	敷尔佳	455,700	11,848,200.00	0.28
23	002154	报喜鸟	3,251,846	11,576,571.76	0.27
24	000060	中金岭南	1,520,900	11,513,213.00	0.27
25	002379	宏桥控股	776,300	11,465,951.00	0.27
26	601336	新华保险	191,600	11,430,856.00	0.27
27	300206	理邦仪器	908,500	11,110,955.00	0.26
28	603083	剑桥科技	43,500	11,086,845.00	0.26
29	301238	瑞泰新材	454,057	11,078,990.80	0.26
30	300620	光库科技	29,200	11,043,440.00	0.26

31	300628	亿联网络	324,620	10,978,648.40	0.26
32	002849	威星智能	641,400	10,852,488.00	0.26
33	600292	电投水电	884,000	10,643,360.00	0.25
34	605151	西上海	528,200	9,301,602.00	0.22
35	300416	苏试试验	435,300	8,871,414.00	0.21
36	603162	海通发展	985,304	8,838,176.88	0.21
37	601882	海天精工	420,000	8,496,600.00	0.20
38	603516	淳中科技	60,900	8,197,749.00	0.19
39	300602	飞荣达	159,400	8,161,280.00	0.19
40	002805	丰元股份	281,400	8,045,226.00	0.19
41	300478	杭州高新	216,200	7,932,378.00	0.19
42	000552	甘肃能化	3,408,600	7,635,264.00	0.18
43	002948	青岛银行	1,496,400	7,601,712.00	0.18
44	603116	红蜻蜓	1,331,400	7,562,352.00	0.18
45	002142	宁波银行	251,700	7,472,973.00	0.18
46	603075	热威科技股份	315,647	7,057,866.92	0.17
47	301295	美硕科技	166,800	7,035,624.00	0.17
48	601995	中金公司	192,900	6,973,335.00	0.16
49	600841	动力新科	1,089,900	6,648,390.00	0.16
50	301487	盟固利	345,921	6,624,387.15	0.16
51	601456	国联民生	717,600	6,343,584.00	0.15
52	600189	泉阳泉	784,600	5,908,038.00	0.14

53	688046	药康生物	241,400	5,841,880.0 0	0.14
54	300746	汉嘉数智	517,800	5,597,418.0 0	0.13
55	603057	上海紫燕食品	250,600	5,588,380.0 0	0.13
56	001280	中国铀业	83,700	5,582,790.0 0	0.13
57	002545	东方铁塔	292,400	4,742,728.0 0	0.11
58	300106	西部牧业	477,800	4,701,552.0 0	0.11
59	301272	英华特	139,800	4,605,012.0 0	0.11
60	601187	厦门银行	611,300	4,175,179.0 0	0.10
61	301456	盘古智能	176,800	3,992,144.0 0	0.09
62	001311	多利科技	244,530	3,944,268.9 0	0.09
63	301279	金道科技	174,800	3,798,404.0 0	0.09
64	001221	悍高集团	91,800	3,692,196.0 0	0.09
65	603296	华勤技术	47,080	3,496,631.6 0	0.08
66	603175	超颖电子	38,800	3,456,692.0 0	0.08
67	001314	亿道信息	55,900	3,454,620.0 0	0.08
68	688378	奥来德光电	55,280	3,427,360.0 0	0.08
69	000517	荣安地产	1,969,600	3,269,536.0 0	0.08
70	300263	隆华科技	172,600	2,813,380.0 0	0.07
71	002708	光洋股份	209,700	2,765,943.0 0	0.07
72	301500	飞南资源	104,600	2,724,830.0 0	0.06
73	603006	联明股份	182,100	2,594,925.0 0	0.06
74	603125	江苏常青树科技	73,500	2,406,390.0 0	0.06

75	603223	恒通股份	172,900	2,256,345.0 0	0.05
76	301024	霍普股份	60,900	2,242,338.0 0	0.05
77	605299	舒华体育	157,400	2,101,290.0 0	0.05
78	301002	崧盛股份	51,900	2,003,340.0 0	0.05
79	002662	峰璟股份	468,200	1,732,340.0 0	0.04
80	300817	双飞集团	110,200	1,719,120.0 0	0.04
81	002752	昇兴股份	308,500	1,702,920.0 0	0.04
82	605138	盛泰集团	292,800	1,616,256.0 0	0.04
83	600971	恒源煤电	232,600	1,604,940.0 0	0.04
84	601061	中信金属	135,300	1,457,181.0 0	0.03
85	603929	亚翔集成	5,000	1,360,100.0 0	0.03
86	688236	春立正达医疗	93,474	1,351,634.0 4	0.03
87	301180	万祥科技	106,500	1,334,445.0 0	0.03
88	301469	恒达新材	47,300	1,304,534.0 0	0.03
89	688301	奕瑞科技股份	9,200	1,140,800.0 0	0.03
90	600060	海信视像	39,800	1,109,226.0 0	0.03
91	603889	新澳股份	215,650	1,101,971.5 0	0.03
92	301055	张小泉	25,800	1,095,726.0 0	0.03
93	300575	中旗股份	219,500	1,079,940.0 0	0.03
94	001266	宏英智能	21,600	1,060,560.0 0	0.03
95	301156	美农生物	92,510	1,005,583.7 0	0.02
96	300790	宇瞳光学	35,400	924,294.00	0.02

97	688718	唯赛勃科技	55,200	881,544.00	0.02
98	600319	亚星化学	139,300	867,839.00	0.02
99	301286	侨源股份	13,900	806,061.00	0.02
100	002104	恒宝股份	76,800	791,808.00	0.02
101	002955	鸿合科技	19,700	704,275.00	0.02
102	600688	上海石化	238,800	699,684.00	0.02
103	301603	乔锋智能	4,800	690,240.00	0.02
104	301210	金杨精密	19,900	597,000.00	0.01
105	300921	南凌科技	25,020	508,156.20	0.01
106	300214	日科化学	49,200	504,300.00	0.01
107	603696	安记食品	42,200	485,300.00	0.01
108	301159	三维天地	16,400	477,240.00	0.01
109	301381	赛维时代	24,900	459,156.00	0.01
110	300127	银河磁体	15,900	444,405.00	0.01
111	301082	久盛电气	47,800	428,288.00	0.01
112	001286	陕西能源	42,100	426,894.00	0.01
113	002772	众兴菌业	37,000	420,320.00	0.01
114	002320	海峡股份	66,400	416,328.00	0.01
115	300855	图南股份	12,700	397,002.00	0.01
116	301057	汇隆新材	15,300	351,900.00	0.01
117	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
118	301177	迪阿股份	10,700	294,999.00	0.01
119	601121	宝地矿业	44,100	248,724.00	0.01
120	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
121	301563	云汉芯城	992	172,994.88	0.00
122	600356	恒丰纸业	21,200	157,092.00	0.00
123	301290	东星医疗	4,800	130,800.00	0.00
124	002702	海欣食品	27,200	121,040.00	0.00
125	605056	咸亨国际	7,500	120,000.00	0.00
126	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
127	688051	罗克佳华科技	4,600	105,708.00	0.00
128	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
129	688785	恒运昌股份	116	53,725.40	0.00
130	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
131	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
132	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
133	688811	有研金属复材	834	20,124.42	0.00
134	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
135	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
136	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
137	001393	维通利	387	15,089.13	0.00

138	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
139	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
140	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
141	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
142	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
143	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
144	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
145	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
146	002931	锋龙股份	44	3,035.12	0.00
147	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
148	002636	金安国纪	22	2,639.34	0.00
149	603293	埃泰克汽车电子	72	2,442.96	0.00
150	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
151	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
152	601066	中信建投	50	1,453.50	0.00
153	605389	长龄液压	10	960.00	0.00
154	001230	劲旅环境	20	307.20	0.00
155	300876	蒙泰高新	20	286.60	0.00
156	002615	哈尔斯	25	172.50	0.00
157	300839	博汇股份	9	105.39	0.00
158	300580	贝斯特	3	60.33	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688008	澜起科技	113,152,484.09	8.43
2	600487	亨通光电	104,052,948.02	7.75
3	002463	沪电股份	103,319,756.00	7.69
4	000725	京东方 A	102,319,773.00	7.62
5	603993	洛阳钼业	102,285,469.00	7.62
6	002460	赣锋锂业	93,542,650.60	6.97
7	688012	中微半导体设备	92,632,199.71	6.90
8	601318	中国平安	92,039,278.64	6.85
9	300750	宁德时代	91,225,136.90	6.79
10	600183	生益科技	86,609,092.44	6.45
11	300059	东方财富	84,146,827.43	6.27
12	000100	TCL 科技	81,696,321.10	6.08
13	688521	芯原微电子	81,636,233.06	6.08

14	002938	鹏鼎控股	81,370,803.50	6.06
15	300308	中际旭创	76,285,728.82	5.68
16	300502	新易盛	76,285,285.67	5.68
17	600176	中国巨石	75,926,878.18	5.65
18	300476	胜宏科技	73,512,060.88	5.47
19	600519	贵州茅台	71,839,344.00	5.35
20	002384	东山精密	71,323,596.00	5.31
21	601857	中国石油	70,598,268.89	5.26
22	300442	润泽科技	70,026,212.72	5.21
23	603986	兆易创新	68,757,699.75	5.12
24	300223	北京君正	67,421,784.98	5.02
25	688981	中芯国际	65,794,425.42	4.90
26	002714	牧原股份	65,264,500.52	4.86
27	300857	协创数据	63,755,757.24	4.75
28	300394	天孚通信	62,391,221.08	4.65
29	002709	天赐材料	62,193,829.92	4.63
30	000333	美的集团	60,904,109.62	4.54
31	600584	长电科技	59,027,762.16	4.40
32	603019	中科曙光	59,013,080.00	4.39
33	002371	北方华创	57,983,464.90	4.32
34	601899	紫金矿业	57,738,935.50	4.30
35	300408	三环集团	57,444,828.96	4.28
36	300604	长川科技	57,254,239.32	4.26
37	601872	招商轮船	55,437,022.88	4.13
38	300438	鹏辉能源	54,883,852.93	4.09
39	300054	鼎龙股份	54,092,588.08	4.03
40	688256	寒武纪科技	53,853,908.96	4.01
41	300274	阳光电源	53,600,664.54	3.99
42	002185	华天科技	52,889,884.56	3.94
43	605117	德业股份	52,488,557.38	3.91
44	000938	紫光股份	52,258,317.44	3.89
45	600989	宝丰能源	52,086,563.66	3.88
46	601868	中国能建	51,925,192.00	3.87
47	002475	立讯精密	51,793,042.00	3.86
48	002156	通富微电	51,314,567.00	3.82
49	002281	光迅科技	51,057,191.64	3.80
50	600276	恒瑞医药	50,934,418.80	3.79
51	300136	信维通信	50,908,393.00	3.79
52	600522	中天科技	50,856,527.00	3.79
53	000988	华工科技	50,383,305.00	3.75
54	600497	驰宏锌锗	50,275,579.82	3.74
55	002008	大族激光	49,857,431.00	3.71
56	002436	兴森科技	49,381,612.67	3.68

57	002532	天山铝业	48,544,336.67	3.62
58	600362	江西铜业	47,421,521.90	3.53
59	000063	中兴通讯	47,204,374.00	3.52
60	600900	长江电力	46,458,830.00	3.46
61	603806	福斯特	46,359,718.99	3.45
62	601398	工商银行	46,336,914.00	3.45
63	600309	万华化学	46,136,257.07	3.44
64	601600	中国铝业	45,865,662.00	3.42
65	000338	潍柴动力	45,831,589.00	3.41
66	300124	汇川技术	45,006,253.00	3.35
67	601288	农业银行	44,907,935.00	3.34
68	300014	亿纬锂能	44,340,761.35	3.30
69	600026	中远海能	43,786,229.94	3.26
70	600893	航发动力	43,741,125.00	3.26
71	002353	杰瑞股份	43,102,654.00	3.21
72	301358	湖南裕能	42,618,622.66	3.17
73	601727	上海电气	42,135,207.00	3.14
74	601328	交通银行	41,810,577.50	3.11
75	603659	璞泰来	41,686,790.38	3.10
76	002837	英维克	41,220,850.30	3.07
77	600418	江淮汽车	41,127,141.00	3.06
78	600028	中国石化	40,485,758.00	3.01
79	600111	北方稀土	39,894,709.88	2.97
80	600030	中信证券	39,710,077.25	2.96
81	600547	山东黄金	39,534,813.36	2.94
82	600036	招商银行	39,520,621.00	2.94
83	002028	思源电气	39,427,722.18	2.94
84	688498	源杰科技	39,061,301.33	2.91
85	600346	恒力石化	39,061,005.00	2.91
86	601168	西部矿业	38,740,709.73	2.88
87	688111	金山办公	38,362,896.53	2.86
88	300390	天华新能	37,927,534.56	2.82
89	300418	昆仑万维	37,757,030.32	2.81
90	600460	士兰微	37,756,930.30	2.81
91	600961	株冶集团	37,387,765.00	2.78
92	002851	麦格米特	36,898,940.79	2.75
93	601100	恒立液压	36,429,275.27	2.71
94	000425	徐工机械	35,747,207.01	2.66
95	300058	蓝色光标	35,633,370.60	2.65
96	000408	藏格矿业	35,011,038.00	2.61
97	688002	睿创微纳	33,954,193.99	2.53
98	300568	星源材质	33,849,617.00	2.52
99	000426	兴业银锡	33,758,594.00	2.51

100	603799	华友钴业	32,949,656.60	2.45
101	600549	厦门钨业	31,762,256.00	2.37
102	688041	海光信息	31,607,204.61	2.35
103	002493	荣盛石化	31,552,532.00	2.35
104	601088	中国神华	31,521,998.00	2.35
105	002594	比亚迪	30,660,400.35	2.28
106	002050	三花智控	30,069,903.98	2.24
107	301308	江波龙	30,047,158.30	2.24
108	600887	伊利股份	29,714,863.00	2.21
109	601985	中国核电	29,503,912.00	2.20
110	002916	深南电路	29,434,600.46	2.19
111	000807	云铝股份	29,137,800.00	2.17
112	600482	中国动力	28,840,978.00	2.15
113	601988	中国银行	28,634,711.00	2.13
114	002558	巨人网络	28,633,544.20	2.13
115	603083	剑桥科技	28,337,420.00	2.11
116	601179	中国西电	27,964,966.00	2.08
117	600115	中国东航	27,949,108.19	2.08
118	000783	长江证券	27,824,061.82	2.07
119	000776	广发证券	27,815,044.00	2.07
120	002271	东方雨虹	27,780,354.59	2.07
121	000792	盐湖股份	27,681,942.00	2.06
122	688396	华润微电子	27,665,353.33	2.06
123	600673	东阳光	27,424,541.00	2.04
124	000933	神火股份	27,343,005.52	2.04
125	603259	药明康德	27,318,555.00	2.03
126	300432	富临精工	27,145,768.50	2.02

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	000725	京东方 A	113,788,996.89	8.47
2	688008	澜起科技	112,826,803.07	8.40
3	600487	亨通光电	99,037,000.52	7.38
4	603986	兆易创新	87,801,337.92	6.54
5	688012	中微半导体设备	86,182,990.88	6.42
6	002460	赣锋锂业	84,303,707.82	6.28
7	002463	沪电股份	83,026,905.05	6.18
8	688521	芯原微电子	81,103,742.72	6.04

9	300223	北京君正	78,169,248.85	5.82
10	603993	洛阳钼业	76,241,262.44	5.68
11	300442	润泽科技	73,191,560.34	5.45
12	002714	牧原股份	72,103,158.56	5.37
13	600176	中国巨石	71,119,820.79	5.30
14	600183	生益科技	70,757,070.09	5.27
15	300604	长川科技	69,906,272.56	5.21
16	002008	大族激光	68,934,827.00	5.13
17	300394	天孚通信	68,109,764.52	5.07
18	002371	北方华创	66,558,709.00	4.96
19	000100	TCL 科技	66,524,672.00	4.95
20	300438	鹏辉能源	65,816,025.54	4.90
21	600584	长电科技	64,949,297.03	4.84
22	002938	鹏鼎控股	64,478,727.86	4.80
23	300408	三环集团	61,295,982.50	4.56
24	300054	鼎龙股份	57,657,968.00	4.29
25	601868	中国能建	57,034,343.00	4.25
26	300274	阳光电源	56,303,954.48	4.19
27	600497	驰宏锌锗	56,280,282.20	4.19
28	600522	中天科技	55,185,233.03	4.11
29	300502	新易盛	53,989,080.60	4.02
30	002709	天赐材料	53,775,497.10	4.00
31	300136	信维通信	53,555,991.58	3.99
32	000988	华工科技	49,743,538.00	3.70
33	002436	兴森科技	49,708,884.95	3.70
34	601857	中国石油	49,161,271.00	3.66
35	000063	中兴通讯	48,812,722.84	3.64
36	600276	恒瑞医药	48,669,614.57	3.62
37	002281	光迅科技	48,577,285.82	3.62
38	600028	中国石化	48,543,410.10	3.61
39	300059	东方财富	47,594,806.43	3.54
40	600460	士兰微	46,160,120.26	3.44
41	601600	中国铝业	45,929,385.00	3.42
42	601872	招商轮船	44,901,154.86	3.34
43	002185	华天科技	44,265,254.47	3.30
44	002384	东山精密	43,559,338.00	3.24
45	600346	恒力石化	43,257,953.00	3.22
46	300857	协创数据	42,839,340.78	3.19
47	002837	英维克	41,785,144.65	3.11
48	600989	宝丰能源	41,690,486.00	3.10
49	300390	天华新能	40,924,293.06	3.05
50	300418	昆仑万维	40,785,548.74	3.04
51	601088	中国神华	39,833,915.00	2.97

52	300476	胜宏科技	39,795,720.44	2.96
53	603019	中科曙光	39,728,447.51	2.96
54	601727	上海电气	39,444,500.00	2.94
55	002156	通富微电	38,524,490.00	2.87
56	300058	蓝色光标	38,083,193.63	2.84
57	301358	湖南裕能	37,694,279.05	2.81
58	688396	华润微电子	37,642,776.76	2.80
59	601318	中国平安	37,158,246.00	2.77
60	688981	中芯国际	36,980,391.89	2.75
61	600362	江西铜业	36,649,410.46	2.73
62	600111	北方稀土	36,454,746.00	2.71
63	603659	璞泰来	36,098,744.00	2.69
64	000426	兴业银锡	35,935,305.00	2.68
65	601168	西部矿业	34,930,118.56	2.60
66	605117	德业股份	34,674,402.95	2.58
67	000938	紫光股份	32,909,084.00	2.45
68	301308	江波龙	32,086,656.00	2.39
69	600887	伊利股份	32,020,045.00	2.38
70	002245	蔚蓝锂芯	31,838,510.20	2.37
71	600026	中远海能	31,097,204.00	2.32
72	600893	航发动力	30,910,065.00	2.30
73	600900	长江电力	30,799,764.00	2.29
74	300014	亿纬锂能	30,716,367.00	2.29
75	002558	巨人网络	29,583,933.96	2.20
76	601688	华泰证券	29,530,316.00	2.20
77	002353	杰瑞股份	29,001,008.00	2.16
78	601179	中国西电	28,831,494.00	2.15
79	002050	三花智控	28,545,970.00	2.13
80	603806	福斯特	28,485,894.72	2.12
81	600010	宝钢股份	28,352,889.00	2.11
82	600673	东阳光	28,298,887.34	2.11
83	002532	天山铝业	27,948,621.08	2.08
84	002552	宝鼎科技	27,880,873.00	2.08
85	600406	国电南瑞	27,772,443.00	2.07
86	600482	中国动力	27,713,388.58	2.06
87	600011	华能国际	27,553,662.00	2.05
88	601689	拓普集团	26,941,704.30	2.01
89	601061	中信金属	26,864,457.84	2.00

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	12,787,644,339.60
卖出股票收入（成交）总额	10,469,505,349.12

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

若相关法律法规发生变化时，基金管理人股指期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

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，立讯精密工业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	5,586,969.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	48,671,154.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,258,124.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富中证 A500 指数增强 A	56,402	29,029.32	752,033,371.31	45.93	885,278,561.40	54.07
汇添富中证 A500 指	44,965	22,900.76	354,772,687.52	34.45	674,959,822.43	65.55

数增强 C						
合计	101,367	26,310.78	1,106,806,058.83	41.50	1,560,238,383.83	58.50

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	汇添富中证 A500 指数增强 A	1,069,432.51	0.07
	汇添富中证 A500 指数增强 C	32,656.27	0.00
	合计	1,102,088.78	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	汇添富中证 A500 指数增强 A	0
	汇添富中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 A500 指数增强 A	0
	汇添富中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 A500 指数增强 A	汇添富中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 03 月 27 日）基金份额总额	221,913,488.44	309,019,312.30
本报告期期初基金份额总额	576,647,780.76	414,859,628.16
本报告期基金总申购份额	2,265,529,030.23	2,008,997,234.87
减：本报告期基金总赎回份额	1,204,864,878.28	1,394,124,353.08
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	1,637,311,932.71	1,029,732,509.95

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期无托管人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

本报告期无托管人相关从业人员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 (%)	
国信证券	3	14,630,267,721.11	62.91	2,719,771.29	63.27	
申万宏源证券	3	4,685,127,760.49	20.15	846,399.74	19.69	
国投证券	3	3,939,919,837.97	16.94	732,433.42	17.04	

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 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	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 03 月 20 日
3	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 03 月 20 日
4	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
5	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
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	公司网站	2026 年 04 月 30 日

	金持股) 参与股东大会投票信息披露		
8	汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛(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中证 A500 指数增强型证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5、报告期内汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告;
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日