

汇添富上证综合指数证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

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 07 月 21 日

§ 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责任。

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 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富上证综合指数
基金主代码	470007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 07 月 01 日
报告期末基金份额总额(份)	841,548,386.93
投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 6%，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动

	性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。本基金的投资策略主要包括：资产配置、抽样股票组合构建、股票组合调整、存托凭证的投资策略。		
业绩比较基准	上证综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。		
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		
下属分级基金的基金简称	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y
下属分级基金的交易代码	470007	018536	025883
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	731,986,102.71	106,182,442.67	3,379,841.55

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026 年 04 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)		
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y
1. 本期已实现收益	23,768,548.51	2,577,183.68	85,320.63
2. 本期利润	54,470,035.52	7,655,279.86	161,992.69
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0723	0.0887	0.0629
4. 期末基金资产净值	932,539,387.60	133,666,412.73	4,318,523.49
5. 期末基金份额净值	1.274	1.259	1.278

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

汇添富上证综合指数 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	5.73%	0.90%	4.96%	0.89%	0.77%	0.01%
过去六个 月	4.61%	0.91%	3.04%	0.91%	1.57%	0.00%
过去一年	19.98%	0.77%	17.92%	0.79%	2.06%	-0.02%
过去三年	35.17%	0.93%	26.59%	0.95%	8.58%	-0.02%
过去五年	25.78%	0.92%	13.69%	0.94%	12.09%	-0.02%
过去七年	60.80%	0.96%	36.03%	0.97%	24.77%	-0.01%
过去十年	86.66%	0.95%	38.52%	0.97%	48.14%	-0.02%
自基金合 同生效起 至今	87.84%	1.21%	38.76%	1.20%	49.08%	0.01%
汇添富上证综合指数 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	5.71%	0.90%	4.96%	0.89%	0.75%	0.01%
过去六个 月	4.49%	0.91%	3.04%	0.91%	1.45%	0.00%
过去一年	19.59%	0.77%	17.91%	0.79%	1.68%	-0.02%
过去三年	33.46%	0.92%	26.59%	0.95%	6.87%	-0.03%
自基金合 同生效起 至今	31.58%	0.92%	23.61%	0.94%	7.97%	-0.02%
汇添富上证综合指数 Y						
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	5.88%	0.89%	4.96%	0.89%	0.92%	0.00%
过去六个 月	4.93%	0.91%	3.04%	0.91%	1.89%	0.00%
自基金合 同生效起 至今	5.10%	0.83%	3.39%	0.84%	1.71%	-0.01%

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

汇添富上证综合指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数Y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（2009 年 07 月 01 日）起 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金于 2023 年 05 月 19 日新增 C 类份额，于 2025 年 10 月 31 日新增 Y 类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2010 年 02 月 06 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。
--	--	--	--	--	---

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。

4.1.1 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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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：

一、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。

二、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。

三、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。

四、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% 的次数为 1。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年二季度，海内外宏观环境与市场风格迎来阶段性切换，A 股和港股整体呈现结构

性行情为主、普涨行情缺失的特征，资金持续集中布局人工智能产业主线，半导体、软硬件、通信等科技成长赛道持续领跑，传统行业表现相对平淡。地缘层面，二季度霍尔木兹海峡冲突逐步缓和，3月末出现降温迹象，4月初达成临时停火，虽过程有所反复，但整体修复趋势明确；6月中旬相关备忘录落地后，区域航运通行效率明显回升，油价回落至季度初水平，市场地缘风险偏好稳步修复。目前多方利益存在分歧，冲突尚未完全落地，后续仍有小幅扰动可能，但对市场的冲击力度已显著弱化。

海外货币政策方面，美联储二季度维持基准利率不变。随着新任联储主席履职，6月议息会议大幅简化对外沟通、放弃前瞻指引，交由经济数据主导市场定价。政策思路的调整引发市场预期重构，年内加息预期从不足一次上调至一至两次，海外流动性收紧预期升温，对全球成长资产及港股等离岸市场形成阶段性压制。

国内经济二季度延续温和修复态势，结构性分化特征突出。整体呈现外需与生产端韧性较强、内需消费修复偏弱的格局，地产投资持续疲软，仍是拖累经济复苏的主要因素。内需修复乏力也导致传统消费、地产链行业缺乏行情支撑，市场整体表现偏弱。

资本市场层面，A股二季度极致结构化特征显著，行情高度聚焦AI产业升级主线，芯片、半导体设备材料、计算机、通信等科技板块领涨市场，成为指数上行的核心动力。二季度中证800指数上涨13.7%，指数成份持续迭代，科技成长板块权重持续抬升，体现出资本市场对产业智能化、数字化转型的长期定价趋势，而缺乏景气支撑的传统行业持续震荡走弱，板块分化明显。

整体来看，二季度市场核心逻辑清晰，地缘风险缓和提振市场情绪，但海外政策预期波动带来短期扰动，国内经济温和修复、结构分化，资金持续聚焦产业升级主线。短期市场仍将受流动性、情绪影响存在震荡，但AI产业升级、国内经济稳步修复的中长期逻辑不变。

上证综合指数是A股市场代表性宽基指数，本基金则是这一代表性指数的产品化形式，为投资者提供了整体配置国内权益资产的优质工具。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富上证综合指数A类份额净值增长率为5.73%，同期业绩比较基准收益率为4.96%。本报告期汇添富上证综合指数C类份额净值增长率为5.71%，同期业绩比较基准收益率为4.96%。本报告期汇添富上证综合指数Y类份额净值增长率为5.88%，同期业绩比较基准收益率为4.96%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,014,204,744.56	94.33
	其中：股票	1,014,204,744.56	94.33
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	24,656,012.82	2.29
	其中：债券	24,656,012.82	2.29
	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	32,672,806.96	3.04
8	其他资产	3,612,163.88	0.34
9	合计	1,075,145,728.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,365,885.80	0.13
B	采矿业	77,160,579.88	7.21
C	制造业	501,956,038.41	46.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,668,293.38	3.71
E	建筑业	11,545,040.48	1.08

F	批发和零售业	11,858,152.60	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	30,998,232.30	2.90
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	78,153,509.12	7.30
J	金融业	213,106,556.68	19.91
K	房地产业	9,766,463.67	0.91
L	租赁和商务服务业	3,590,683.55	0.34
M	科学研究和技术服务业	14,970,592.71	1.40
N	水利、环境和公共设施管理业	7,860,650.52	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,007,670.00	0.09
Q	卫生和社会工作	740,921.72	0.07
R	文化、体育和娱乐业	1,954,075.00	0.18
S	综合	484,946.00	0.05
	合计	1,006,188,291.82	93.99

5.2.2 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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	7,086,035.62	0.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	930,417.12	0.09
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,016,452.74	0.75

5.2.3 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。

5.3 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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	601288	农业银行	6,337,373	38,467,854.11	3.59
2	601988	中国银行	5,402,872	30,904,427.84	2.89
3	601857	中国石油	2,735,657	23,745,502.76	2.22
4	600519	贵州茅台	19,829	23,507,081.	2.20

				21	
5	601138	工业富联	311,300	22,460,295.00	2.10
6	688256	寒武纪科技	12,071	19,259,884.05	1.80
7	688041	海光信息	36,097	13,366,719.10	1.25
8	600036	招商银行	346,115	12,287,082.50	1.15
9	601628	中国人寿	344,871	12,191,189.85	1.14
10	601088	中国神华	283,115	11,052,809.60	1.03

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	688809	强一股份	2,584	1,609,832.00	0.15
2	688729	屹唐半导体股份	34,234	1,472,062.00	0.14
3	688818	中电科蓝天科技	17,168	1,266,122.03	0.12
4	600930	华电新能源集团	195,056	930,417.12	0.09
5	688785	恒运昌股份	1,155	556,632.57	0.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	24,656,012.82	2.30
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	24,656,012.82	2.30

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	244,000	24,656,012.82	2.30

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	95,865.44
2	应收证券清算款	1,078,062.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,438,236.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,612,163.88

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688818	中电科蓝天科技	120,430.38	0.01	新股流通受限
2	688785	恒运昌股份	53,725.40	0.01	新股流通受限

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y
本报告期期初基金份额总额	776,319,116.89	94,293,604.28	2,170,165.14
本报告期基金总申购份额	71,055,725.58	132,013,249.68	2,076,322.95
减：本报告期基金总赎回份额	115,388,739.76	120,124,411.29	866,646.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	731,986,102.71	106,182,442.67	3,379,841.55

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合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、报告期内汇添富上证综合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。

9.2 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

9.3 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 07 月 21 日