汇添富沪深 300 指数量化增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 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遵规守信情况的说明 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 13
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 14
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遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15
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 15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 17
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
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 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 56
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 56
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 56
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 56
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 56

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....57
7.12 投资组合报告附注.....57
§8 基金份额持有人信息.....58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....58
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.....58
§9 开放式基金份额变动.....59
§10 重大事件揭示.....59
10.1 基金份额持有人大会决议.....59
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.....59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....59
10.4 基金投资策略的改变.....60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....60
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.....60
10.8 其他重大事件.....62
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....63
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.....63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....63
§12 备查文件目录.....63
12.1 备查文件目录.....63
12.2 存放地点.....64
12.3 查阅方式.....64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富沪深 300 指数量化增强	
基金主代码	025378	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 09 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	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	293,354,011.84	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富沪深 300 指数量化增强 A	汇添富沪深 300 指数量化增强 C
下属分级基金的交易代码	025378	025379
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	170,093,147.13	123,260,864.71

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，以沪深 300 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%，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	沪深 300 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	方圆
	联系电话	021-28932888	95559
	电子邮箱	service@99fund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-9918	95559
传真		021-28932998	021-62701216
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市黄浦区外马路728号	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200010	200336
法定代表人		鲁伟铭	任德奇

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026年01月01日 - 2026年06月30日)	
	汇添富沪深300指数量化增强A	汇添富沪深300指数量化增强C
本期已实现收益	23,098,797.14	14,930,887.01
本期利润	28,840,520.19	18,197,854.86
加权平均基金份额本期利润	0.1646	0.1540
本期加权平均净值利润率	14.95%	14.03%
本期基金份额净值增长率	15.01%	14.79%

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	23,675,844.88	16,731,976.33
期末可供分配基金份额利润	0.1392	0.1357
期末基金资产净值	201,920,124.86	145,885,994.72
期末基金份额净值	1.1871	1.1836
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	18.71%	18.36%

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。

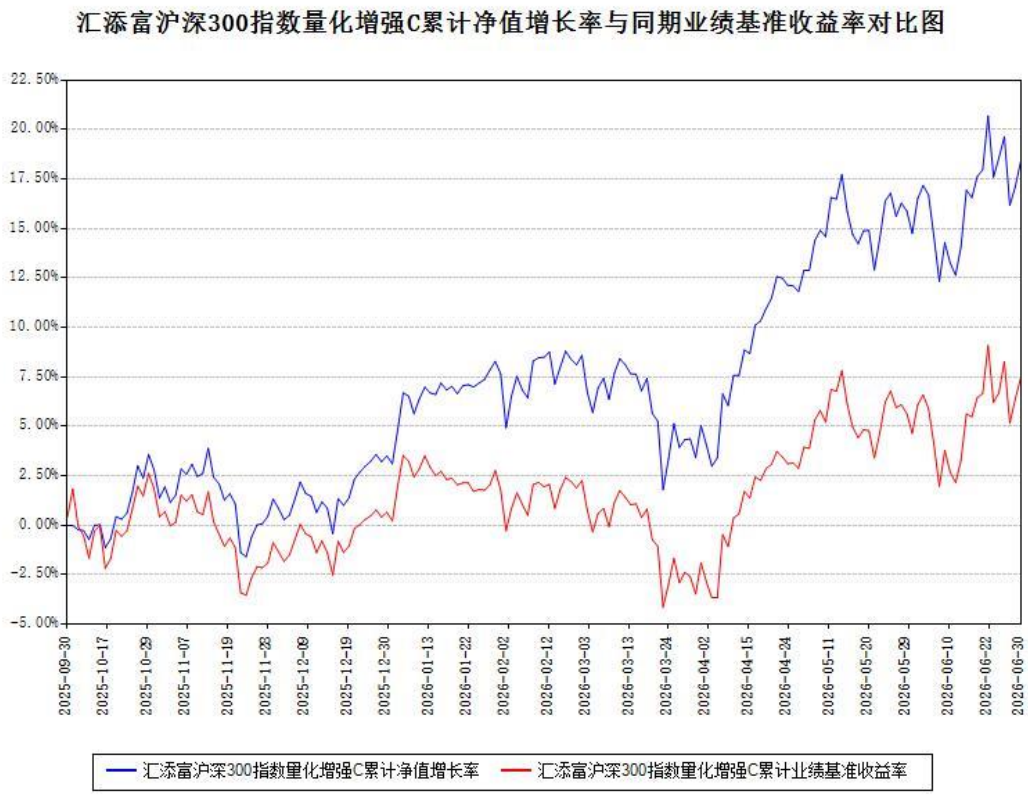
3.2 基金净值表现

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

汇添富沪深300指数量化增强A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.55%	1.21%	11.30%	1.19%	3.25%	0.02%
过去六个月	15.01%	1.12%	7.20%	1.07%	7.81%	0.05%
自基金合同生效起至今	18.71%	1.02%	7.44%	1.01%	11.27%	0.01%
汇添富沪深300指数量化增强C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.43%	1.21%	11.30%	1.19%	3.13%	0.02%
过去六个月	14.79%	1.12%	7.20%	1.07%	7.59%	0.05%

自基金合同生效起至今	18.36%	1.02%	7.44%	1.01%	10.92%	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



注：本《基金合同》生效之日为 2025 年 09 月 30 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金已完成建仓，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		
王星星	本基金的基金经理	2025年09月30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遵规守信情况的说明

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和流程,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中的公平交易模块，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，沪深 300 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

本报告期汇添富沪深 300 指数量化增强 A 类份额净值增长率为 15.01%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。本报告期汇添富沪深 300 指数量化增强 C 类份额净值增长率为 14.79%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

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；基金管理人可对基金相对标的指数的超额收益率和/或基金的可供分配利润进行评价，当收益评价日核定的超额收益率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配； 当基金收益分配根据基金相对标的指数的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，

本基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在汇添富沪深 300 指数量化增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，汇添富基金管理股份有限公司在汇添富沪深 300 指数量化增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇添富沪深300指数量化增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富沪深300指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	20,270,126.11	24,104,565.85

结算备付金		2,139,495.25	2,915,882.48
存出保证金		490,629.26	817,224.68
交易性金融资产	6.4.7.2	324,915,183.12	405,809,936.72
其中：股票投资		324,915,183.12	405,809,936.72
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		287,529.10	5,231,634.18
应收股利		-	-
应收申购款		1,794,799.17	114,677.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		349,897,762.01	438,993,921.07
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		1,040,644.87	-
应付赎回款		492,191.43	5,926,275.08
应付管理人报酬		208,275.03	330,388.37
应付托管费		26,034.38	41,298.54
应付销售服务费		41,037.82	64,940.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,686.58	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	273,772.32	494,738.16
负债合计		2,091,642.43	6,857,640.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	293,354,011.84	418,829,924.78
未分配利润	6.4.7.9	54,452,107.74	13,306,355.43
净资产合计		347,806,119.58	432,136,280.21

负债和净资产总计		349,897,762.01	438,993,921.07

注：1、报告截止日2026年06月30日，基金份额总额293,354,011.84份。本基金下属汇添富沪深300指数量化增强A基金份额净值1.1871元，基金份额总额170,093,147.13份；本基金下属汇添富沪深300指数量化增强C基金份额净值1.1836元，基金份额总额123,260,864.71份。

2、本基金合同于2025年09月30日生效，上年度实际报告期间为2025年09月30日至2025年12月31日，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深300指数量化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
一、营业总收入		**48,838,011.16**
1.利息收入		75,997.08
其中：存款利息收入	6.4.7.10	75,997.08
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）		39,742,356.61
其中：股票投资收益	6.4.7.11	36,659,850.20
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	751.33
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	367,039.00
股利收益	6.4.7.17	2,714,716.08
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	9,008,690.90
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	10,966.57
减：二、营业总支出		**1,799,636.11**
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,285,443.69
其中：暂估管理人报酬		-

2．托管费	6.4.10.2.2	160,680.46
3．销售服务费		258,049.59
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		1,324.88
8．其他费用	6.4.7.21	94,137.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**47,038,375.05**
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**47,038,375.05**
五、其他综合收益的税后净额		**-**
六、综合收益总额		**47,038,375.05**

注：本基金合同于2025年09月30日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富沪深300指数量化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	418,829,924.78	13,306,355.43	432,136,280.21
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	418,829,924.78	13,306,355.43	432,136,280.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-125,475,912.94	41,145,752.31	-84,330,160.63
（一）、综合收益总额	-	47,038,375.05	47,038,375.05
（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）	-125,475,912.94	-5,892,622.74	-131,368,535.68
其中：1.基金申购款	170,893,633.37	21,970,256.11	192,863,889.48
2.基金赎回款	-296,369,546.31	-27,862,878.85	-324,232,425.16

（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	293,354,011.84	54,452,107.74	347,806,119.58

注：本基金合同于2025年09月30日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富沪深300指数量化增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2025〕1744号文《关于准予汇添富沪深300指数量化增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。本基金募集期间为2025年9月8日起至2025年9月26日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币700,032,528.28元，在募集期间产生的利息为人民币192,964.62元，以上实收基金（本息）合计为人民币700,225,492.90元，折合700,225,492.90 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_B47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9月30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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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第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	20,270,126.11
等于：本金	20,266,057.03
加：应计利息	4,069.08
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	20,270,126.11

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		305,371,261.42	-	324,915,183.12	19,543,921.70
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	305,371,261.42	-	324,915,183.12	19,543,921.70

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	2,988,000.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	2,988,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,988,000.00	-	-	-

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	2	2,909,880.00	-78,120.00
合计				-78,120.00
减：可抵销期货暂收款				-78,120.00

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	0.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	184,511.40
其中：交易所市场	184,511.40
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	273,772.32

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富沪深300指数量化增强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	254,761,071.83	254,761,071.83
本期申购	89,561,304.88	89,561,304.88
本期赎回（以“-”号填列）	-174,229,229.58	-174,229,229.58
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	170,093,147.13	170,093,147.13
汇添富沪深300指数量化增强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	164,068,852.95	164,068,852.95
本期申购	81,332,328.49	81,332,328.49
本期赎回（以“-”号填列）	-122,140,316.73	-122,140,316.73
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	123,260,864.71	123,260,864.71

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

汇添富沪深300指数量化增强A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,108,279.80	4,090,967.69	8,199,247.49
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	4,108,279.80	4,090,967.69	8,199,247.49
本期利润	23,098,797.14	5,741,723.05	28,840,520.19
本期基金份额交易产生的变动数	-3,531,232.06	-1,681,557.89	-5,212,789.95
其中：基金申购款	8,581,155.96	2,645,897.75	11,227,053.71
基金赎回款	-12,112,388.02	-4,327,455.64	-16,439,843.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,675,844.88	8,151,132.85	31,826,977.73
汇添富沪深300指数量化增强C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,475,084.77	2,632,023.17	5,107,107.94
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	2,475,084.77	2,632,023.17	5,107,107.94
本期利润	14,930,887.01	3,266,967.85	18,197,854.86
本期基金份额交易产生的变动数	-673,995.45	-5,837.34	-679,832.79
其中：基金申购款	7,982,432.87	2,760,769.53	10,743,202.40
基金赎回款	-8,656,428.32	-2,766,606.87	-11,423,035.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,731,976.33	5,893,153.68	22,625,130.01

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	64,691.53
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	10,755.06
其他	550.49
合计	75,997.08

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	1,136,353,468.82
减：卖出股票成本总额	1,098,610,888.23
减：交易费用	1,082,730.39
买卖股票差价收入	36,659,850.20

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	681.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	70.00
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	751.33

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	500,628.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	499,740.00
减：应计利息总额	818.90
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	70.00

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
外汇期货投资收益	-
股指期货投资收益	367,039.00
国债期货投资收益	-
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	2,714,716.08
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	2,714,716.08

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	9,150,590.90
——股票投资	9,150,590.90
——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	-141,900.00
——权证投资	-
——期货投资	-141,900.00
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	9,008,690.90

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	10,966.57
替代损益	-
其他	-
合计	10,966.57

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	4,877.34
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	94,137.49

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

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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	1,905,801,968.09	88.90

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2026年01月01日至2026年06月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
东方证券	999,550.00	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期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（%）
东方证券	335,217.66	88.90	142,651.74	77.31

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
当期发生的基金应支付的管理费	1,285,443.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	606,308.77
应支付基金管理人的净管理费	679,134.92

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.8%÷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
当期发生的基金应支付的托管费	160,680.46

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷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		
	汇添富沪深 300 指数量化增强 A	汇添富沪深 300 指数量化增强 C	合计
交通银行股份有限公司	-	106,275.96	106,275.96
汇添富基金管理股份有限公司	-	5,870.60	5,870.60
合计	-	112,146.56	112,146.56

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 0.4%。计算方法如下：

H＝E×0.4%÷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:本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期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	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	20,270,126.11	64,691.53

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
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	129	6,870.54	7,577.46	
001312	福恩股份	2026年04月14日	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	109	2,003.42	1,829.02	
001365	天海电子	2026年05月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	324	8,809.56	10,144.44	
001393	维通利	2026年05月08日	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	216	6,562.08	8,421.84	
001399	惠科股份	2026年06月16	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	1,518	15,362.16	42,094.14	

		日								
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	
301599	理奇智能	2026年04月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	376	5,230.16	12,208.72	
301666	大普微	2026年04月08日	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	453	20,874.24	209,888.49	
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	109	6,322.00	12,225.44	
301682	宏明电子	2026年03月18日	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	283	19,713.78	45,296.98	
301683	慧谷新材	2026年03月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	69	5,408.22	8,402.13	
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	
301696	三瑞智能	2026年03月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	196	4,837.28	17,012.80	
601112	振石股份	2026年01月21	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	363	4,058.34	6,385.17	

		日								
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	54	1,808.46	1,832.22	
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	200	3,540.00	16,864.00	
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	
688781	视涯科技	2026年03月18日	6个月	新股流通受限	22.68	47.61	97	2,199.96	4,618.17	
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	101	9,310.18	46,778.15	
688797	臻宝科技	2026年06月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	117	5,213.52	54,834.39	
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	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	232	6,096.96	39,924.88	

		日								
688820	盛合晶微	2026年04月13日	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	437	8,600.16	61,831.13	
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

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	20,270,126.11	-	-	-	-	-	20,270,126.11
结算备付金	2,139,495.25	-	-	-	-	-	2,139,495.25
存出保证金	141,443.66	-	-	-	-	349,185.60	490,629.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	324,915,183.12	324,915,183.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	287,529.10	287,529.10
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,794,799.17	1,794,799.17
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,551,0	-	-	-	-	327,346,	349,897,

	65.02					696.99	762.01
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	-	-	-	-	-	1,040,644.87	1,040,644.87
应付赎回款	-	-	-	-	-	492,191.43	492,191.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	208,275.03	208,275.03
应付托管费	-	-	-	-	-	26,034.38	26,034.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	41,037.82	41,037.82
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	9,686.58	9,686.58
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	273,772.32	273,772.32
负债总计	-	-	-	-	-	2,091,642.43	2,091,642.43
利率敏感度缺口	22,551,065.02	-	-	-	-	325,255,054.56	347,806,119.58
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	24,104,565.85	-	-	-	-	-	24,104,565.85
结算备付金	2,915,882.48	-	-	-	-	-	2,915,882.48
存出保证金	197,142.68	-	-	-	-	620,082.00	817,224.68

交易性金融资产	-	-	-	-	-	405,809,936.72	405,809,936.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	5,231,634.18	5,231,634.18
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	114,677.16	114,677.16
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	27,217,591.01	-	-	-	-	411,776,330.06	438,993,921.07
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	-	-	-	-	-	5,926,275.08	5,926,275.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	330,388.37	330,388.37
应付托管费	-	-	-	-	-	41,298.54	41,298.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-	64,940.71	64,940.71
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	-	-	-	-	-	494,738.	494,738.

						16	16
负债总计	-	-	-	-	-	6,857,640.86	6,857,640.86
利率敏感度缺口	27,217,591.01	-	-	-	-	404,918,689.20	432,136,280.21

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	324,915,183.12	93.42	405,809,936.72	93.91
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	324,915,183.12	93.42	405,809,936.72	93.91

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末2026年06月30日	上年度末2025年12月31日
	沪深300指数上涨5%	17,019,610.55	16,406,206.34
	沪深300指数下跌5%	-17,019,610.55	-16,406,206.34

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	324,206,461.91
第二层次	15,167.10
第三层次	693,554.11
合计	324,915,183.12

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	324,915,183.12	92.86
	其中：股票	324,915,183.12	92.86
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	22,409,621.36	6.40
8	其他各项资产	2,572,957.53	0.74
9	合计	349,897,762.01	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	17,964,296.00	5.17
C	制造业	163,694,010.22	47.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,457,352.00	2.43
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,368,096.00	2.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,644,186.05	2.20
J	金融业	56,050,506.90	16.12
K	房地产业	465,532.00	0.13
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,743,831.00	1.36
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	269,387,810.17	77.45

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	36,519.00	0.01
B	采矿业	1,636,327.00	0.47
C	制造业	41,869,052.49	12.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	716,445.00	0.21
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,978,218.00	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	1,574,039.46	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,124.00	0.02

J	金融业	2,438,546.00	0.70
K	房地产业	801,946.00	0.23
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,565,470.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	2,851,686.00	0.82
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	55,527,372.95	15.97

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	14,400	18,288,000.00	5.26
2	300750	宁德时代	34,000	13,362,340.00	3.84
3	300502	新易盛	12,180	7,393,260.00	2.13
4	688256	寒武纪科技	4,311	6,878,416.05	1.98
5	600519	贵州茅台	5,700	6,757,293.00	1.94
6	601899	紫金矿业	227,800	5,726,892.00	1.65
7	601318	中国平安	110,800	5,289,592.00	1.52
8	000333	美的集团	68,600	5,181,358.00	1.49
9	002475	立讯精密	73,100	5,146,240.0	1.48

				0	
10	002384	东山精密	19,600	5,142,060.00	1.48
11	688041	海光信息	13,400	4,962,020.00	1.43
12	603259	药明康德	38,100	4,743,831.00	1.36
13	600900	长江电力	176,100	4,661,367.00	1.34
14	603986	兆易创新	5,700	4,645,500.00	1.34
15	601138	工业富联	59,400	4,285,710.00	1.23
16	600030	中信证券	145,900	4,191,707.00	1.21
17	688981	中芯国际	24,928	3,959,064.96	1.14
18	300059	东方财富	192,200	3,917,036.00	1.13
19	600183	生益科技	22,400	3,884,160.00	1.12
20	601398	工商银行	508,200	3,592,974.00	1.03
21	600036	招商银行	98,400	3,493,200.00	1.00
22	300476	胜宏科技	9,800	3,395,014.00	0.98
23	002463	沪电股份	21,900	3,346,320.00	0.96
24	601211	国泰海通	176,300	3,208,660.00	0.92
25	601288	农业银行	489,100	2,968,837.00	0.85
26	603019	中科曙光	26,600	2,852,318.00	0.82
27	002371	北方华创	3,100	2,742,136.00	0.79
28	600150	中国船舶	80,954	2,735,435.66	0.79
29	603993	洛阳钼业	152,400	2,674,620.00	0.77
30	000338	潍柴动力	98,100	2,673,225.00	0.77

31	002916	深南电路	5,400	2,472,660.00	0.71
32	600309	万华化学	35,600	2,435,396.00	0.70
33	002415	海康威视	71,100	2,431,620.00	0.70
34	688012	中微半导体设备	4,984	2,335,004.00	0.67
35	601857	中国石油	260,400	2,260,272.00	0.65
36	300124	汇川技术	33,500	2,222,055.00	0.64
37	002028	思源电气	12,500	2,162,500.00	0.62
38	300014	亿纬锂能	33,000	2,145,990.00	0.62
39	601688	华泰证券	103,600	2,136,232.00	0.61
40	600031	三一重工	121,600	2,101,248.00	0.60
41	002142	宁波银行	69,050	2,050,094.50	0.59
42	688008	澜起科技	6,548	2,029,225.20	0.58
43	601988	中国银行	337,400	1,929,928.00	0.55
44	601939	建设银行	199,600	1,922,148.00	0.55
45	600999	招商证券	90,700	1,913,770.00	0.55
46	000776	广发证券	77,600	1,815,840.00	0.52
47	601985	中国核电	200,400	1,809,612.00	0.52
48	300033	同花顺	7,500	1,807,500.00	0.52
49	002600	领益智造	103,600	1,796,424.00	0.52
50	600938	中国海油	63,600	1,726,740.00	0.50
51	002049	紫光国微	19,300	1,712,875.00	0.49
52	002460	赣锋锂业	25,600	1,674,240.00	0.48

53	605117	德业股份	15,540	1,650,037.20	0.47
54	000725	京东方A	188,800	1,638,784.00	0.47
55	601872	招商轮船	92,700	1,628,739.00	0.47
56	600893	航发动力	41,700	1,598,778.00	0.46
57	601658	邮储银行	324,100	1,597,813.00	0.46
58	601166	兴业银行	96,200	1,593,072.00	0.46
59	603288	海天味业	47,800	1,585,048.00	0.46
60	002938	鹏鼎控股	14,800	1,559,624.00	0.45
61	000425	徐工机械	191,900	1,552,471.00	0.45
62	601628	中国人寿	43,200	1,527,120.00	0.44
63	000807	云铝股份	68,200	1,509,948.00	0.43
64	600176	中国巨石	20,300	1,479,464.00	0.43
65	600989	宝丰能源	72,600	1,475,958.00	0.42
66	002001	新 和 成	51,800	1,472,156.00	0.42
67	601336	新华保险	24,200	1,443,772.00	0.42
68	600362	江西铜业	33,000	1,428,900.00	0.41
69	601998	中信银行	200,980	1,392,791.40	0.40
70	601009	南京银行	140,000	1,384,600.00	0.40
71	000301	东方盛虹	120,200	1,376,290.00	0.40
72	601995	中金公司	37,400	1,352,010.00	0.39
73	600115	中国东航	353,400	1,346,454.00	0.39
74	600026	中远海能	73,500	1,318,590.00	0.38

75	600233	圆通速递	82,800	1,304,100.00	0.37
76	601111	中国国航	215,300	1,302,565.00	0.37
77	002493	荣盛石化	120,600	1,296,450.00	0.37
78	603296	华勤技术	17,400	1,292,298.00	0.37
79	600029	南方航空	243,800	1,262,884.00	0.36
80	601066	中信建投	43,300	1,258,731.00	0.36
81	600547	山东黄金	54,000	1,246,860.00	0.36
82	600000	浦发银行	141,700	1,220,037.00	0.35
83	601100	恒立液压	11,100	1,193,916.00	0.34
84	000975	山金国际	69,700	1,184,900.00	0.34
85	601898	中煤能源	97,100	1,182,678.00	0.34
86	300628	亿联网络	34,800	1,176,936.00	0.34
87	600489	中金黄金	65,200	1,176,860.00	0.34
88	000792	盐湖股份	38,400	1,159,296.00	0.33
89	003816	中国广核	294,300	1,150,713.00	0.33
90	601021	春秋航空	25,200	1,148,616.00	0.33
91	000408	藏格矿业	16,500	1,143,780.00	0.33
92	300803	指南针	11,800	1,081,706.00	0.31
93	001965	招商公路	115,300	1,056,148.00	0.30
94	002179	中航光电	22,800	1,053,360.00	0.30
95	601456	国联民生	112,800	997,152.00	0.29
96	600549	厦门钨业	11,400	971,280.00	0.28
97	300408	三环集团	5,720	954,668.00	0.27

98	002594	比亚迪	11,300	900,610.00	0.26
99	600276	恒瑞医药	17,100	889,884.00	0.26
100	300274	阳光电源	5,500	874,610.00	0.25
101	600919	江苏银行	80,600	868,868.00	0.25
102	600025	华能水电	94,000	835,660.00	0.24
103	600875	东方电气	28,300	814,191.00	0.23
104	000938	紫光股份	26,200	756,132.00	0.22
105	601127	赛力斯	12,000	735,000.00	0.21
106	002353	杰瑞股份	4,800	732,000.00	0.21
107	603799	华友钴业	13,600	656,336.00	0.19
108	002532	天山铝业	60,000	643,800.00	0.19
109	300394	天孚通信	2,040	617,467.20	0.18
110	002602	世纪华通	39,200	552,720.00	0.16
111	601088	中国神华	12,000	468,480.00	0.13
112	001979	招商蛇口	72,400	465,532.00	0.13
113	002709	天赐材料	7,000	360,010.00	0.10
114	600426	华鲁恒升	11,200	267,904.00	0.08
115	000651	格力电器	6,600	247,500.00	0.07
116	600028	中国石化	54,400	242,624.00	0.07
117	688111	金山办公	1,000	213,050.00	0.06
118	600887	伊利股份	5,900	141,364.00	0.04
119	601319	中国人保	14,100	95,316.00	0.03
120	001280	中国铀业	1,100	73,370.00	0.02
121	600522	中天科技	1,200	72,816.00	0.02
122	301308	江波龙	100	70,380.00	0.02
123	601600	中国铝业	4,400	36,168.00	0.01
124	000858	五 粮 液	300	22,200.00	0.01
125	000568	泸州老窖	200	15,504.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001389	广合科技	4,900	1,162,525.00	0.33
2	002653	海思科	17,000	1,127,780.00	0.32
3	600601	方正科技	78,100	1,080,904.00	0.31

4	300475	香农芯创	3,600	1,080,000.00	0.31
5	000810	创维数字	79,700	1,056,025.00	0.30
6	688002	睿创微纳	6,800	1,051,892.00	0.30
7	002156	通富微电	13,800	1,047,006.00	0.30
8	300857	协创数据	3,000	1,019,700.00	0.29
9	603083	剑桥科技	4,000	1,019,480.00	0.29
10	301536	星宸科技	7,900	1,016,809.00	0.29
11	603588	高能环境	52,500	1,008,000.00	0.29
12	603638	艾迪精密	42,400	994,280.00	0.29
13	002266	浙富控股	195,900	991,254.00	0.29
14	600961	株冶集团	30,500	987,895.00	0.28
15	300681	英搏尔	34,300	981,666.00	0.28
16	000922	佳电股份	70,280	981,108.80	0.28
17	002379	宏桥控股	66,400	980,728.00	0.28
18	301371	敷尔佳	37,700	980,200.00	0.28
19	300590	移为通信	68,300	980,105.00	0.28
20	603268	松发股份	7,000	974,960.00	0.28
21	000783	长江证券	99,800	973,050.00	0.28
22	603057	上海紫燕食品	43,600	972,280.00	0.28
23	600418	江淮汽车	37,600	971,208.00	0.28
24	603075	热威科技股份	43,400	970,424.00	0.28
25	603162	海通发展	106,800	957,996.00	0.28
26	002154	报 喜 鸟	268,800	956,928.00	0.28
27	000060	中金岭南	123,400	934,138.00	0.27
28	002948	青岛银行	182,000	924,560.00	0.27
29	688758	赛分科技	42,000	924,420.00	0.27
30	600841	动力新科	151,000	921,100.00	0.26
31	603806	福斯特	53,500	898,265.00	0.26
32	601061	中信金属	83,400	898,218.00	0.26
33	301238	瑞泰新材	36,700	895,480.00	0.26
34	688653	康希通信	51,400	893,332.00	0.26
35	002064	华峰化学	90,700	860,743.00	0.25
36	300746	汉嘉数智	79,000	853,990.00	0.25

37	600292	电投水电	70,800	852,432.00	0.25
38	600189	泉阳泉	107,100	806,463.00	0.23
39	000517	荣安地产	483,100	801,946.00	0.23
40	300432	富临精工	38,500	773,465.00	0.22
41	601882	海天精工	37,000	748,510.00	0.22
42	688795	摩尔线程	1,000	716,490.00	0.21
43	603223	恒通股份	54,900	716,445.00	0.21
44	688046	药康生物	29,400	711,480.00	0.20
45	300206	理邦仪器	56,400	689,772.00	0.20
46	000969	安泰科技	28,000	687,120.00	0.20
47	300458	全志科技	17,400	686,604.00	0.20
48	688388	嘉元科技	14,600	642,400.00	0.18
49	688166	博瑞生物医药	17,600	616,176.00	0.18
50	002320	海峡股份	98,000	614,460.00	0.18
51	301086	鸿富瀚	2,900	606,912.00	0.17
52	000552	甘肃能化	268,500	601,440.00	0.17
53	601187	厦门银行	79,200	540,936.00	0.16
54	601699	潞安环能	37,600	536,928.00	0.15
55	600688	上海石化	183,100	536,483.00	0.15
56	600871	石化油服	245,300	497,959.00	0.14
57	600801	华新建材	31,900	497,640.00	0.14
58	300620	光库科技	1,300	491,660.00	0.14
59	002821	凯莱英	2,800	453,600.00	0.13
60	301180	万祥科技	34,600	433,538.00	0.12
61	002545	东方铁塔	23,600	382,792.00	0.11
62	001221	悍高集团	9,500	382,090.00	0.11
63	300478	杭州高新	10,200	374,238.00	0.11
64	600060	海信视像	12,900	359,523.00	0.10
65	600299	安迪苏	42,200	331,270.00	0.10
66	001339	智微智能	2,860	292,520.80	0.08
67	301210	金杨精密	8,720	261,600.00	0.08
68	301082	久盛电气	28,700	257,152.00	0.07
69	301279	金道科技	11,300	245,549.00	0.07
70	301666	大普微	453	209,888.49	0.06
71	605151	西上海	10,700	188,427.00	0.05
72	002851	麦格米特	1,100	183,898.00	0.05
73	603889	新澳股份	26,900	137,459.00	0.04
74	001311	多利科技	8,200	132,266.00	0.04
75	301469	恒达新材	4,600	126,868.00	0.04
76	688236	春立正达医疗	7,400	107,004.00	0.03
77	603345	安井食品	1,300	104,247.00	0.03

78	001314	亿道信息	1,100	67,980.00	0.02
79	301295	美硕科技	1,600	67,488.00	0.02
80	601233	桐昆股份	3,100	67,115.00	0.02
81	688820	盛合晶微	437	61,831.13	0.02
82	688718	唯赛勃科技	3,800	60,686.00	0.02
83	300959	线上线下	400	59,124.00	0.02
84	688797	臻宝科技	117	54,834.39	0.02
85	688785	恒运昌股份	101	46,778.15	0.01
86	301682	宏明电子	283	45,296.98	0.01
87	001399	惠科股份	1,518	42,094.14	0.01
88	688813	泰金新能	232	39,924.88	0.01
89	002458	益生股份	4,700	36,519.00	0.01
90	688811	有研金属复材	834	20,124.42	0.01
91	301696	三瑞智能	196	17,012.80	0.00
92	603459	红板科技	200	16,864.00	0.00
93	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
94	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
95	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
96	301680	固德电材	109	12,225.44	0.00
97	301599	理奇智能	376	12,208.72	0.00
98	001365	天海电子	324	10,144.44	0.00
99	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
100	001393	维通利	216	8,421.84	0.00
101	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
102	301683	慧谷新材	69	8,402.13	0.00
103	001237	惠康科技	129	7,577.46	0.00
104	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
105	601112	振石股份	363	6,385.17	0.00
106	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
107	688781	视涯科技	97	4,618.17	0.00
108	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
109	603092	德力佳传动	46	2,482.62	0.00
110	603293	埃泰克汽车电子	54	1,832.22	0.00
111	001312	福恩股份	109	1,829.02	0.00
112	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
113	300428	立中集团	34	618.12	0.00
114	301276	嘉曼服饰	20	426.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	603986	兆易创新	12,847,254.00	2.97
2	002463	沪电股份	9,892,979.00	2.29
3	688012	中微半导体设备	9,665,339.93	2.24
4	300476	胜宏科技	9,159,758.00	2.12
5	688008	澜起科技	8,282,715.01	1.92
6	600183	生益科技	7,907,572.00	1.83
7	601857	中国石油	7,832,026.00	1.81
8	300502	新易盛	7,603,986.06	1.76
9	601872	招商轮船	7,546,636.00	1.75
10	002938	鹏鼎控股	7,342,580.00	1.70
11	002028	思源电气	7,036,157.00	1.63
12	600028	中国石化	6,982,036.00	1.62
13	600111	北方稀土	6,786,834.00	1.57
14	601898	中煤能源	6,452,148.68	1.49
15	600989	宝丰能源	6,413,293.00	1.48
16	600584	长电科技	6,328,748.00	1.46
17	600309	万华化学	6,005,991.00	1.39
18	002709	天赐材料	5,971,953.00	1.38
19	002714	牧原股份	5,960,644.00	1.38
20	002460	赣锋锂业	5,942,450.20	1.38

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	603986	兆易创新	13,131,983.00	3.04
2	688008	澜起科技	10,756,844.65	2.49
3	300502	新易盛	10,310,465.00	2.39
4	600028	中国石化	9,930,976.00	2.30
5	002714	牧原股份	9,066,553.00	2.10
6	601600	中国铝业	8,767,407.00	2.03
7	000725	京东方A	8,747,823.00	2.02
8	688012	中微半导体设备	8,695,306.48	2.01
9	601872	招商轮船	8,629,381.00	2.00
10	002028	思源电气	8,498,347.00	1.97
11	688041	海光信息	8,404,766.92	1.94

12	600176	中国巨石	8,385,997.00	1.94
13	601318	中国平安	8,209,378.00	1.90
14	002463	沪电股份	7,914,004.00	1.83
15	600036	招商银行	7,828,920.00	1.81
16	601857	中国石油	7,799,295.00	1.80
17	600276	恒瑞医药	7,486,554.60	1.73
18	601138	工业富联	7,406,032.00	1.71
19	600309	万华化学	7,336,265.00	1.70
20	000100	TCL科技	7,330,793.00	1.70

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,008,565,543.73
卖出股票收入（成交）总额	1,136,353,468.82

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	490,629.26
2	应收清算款	287,529.10
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,794,799.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,572,957.53

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（%）
汇添富沪深300指数量化增强A	5,314	32,008.50	54,508,341.13	32.05	115,584,806.00	67.95
汇添富沪深300指数量化增强C	14,979	8,228.91	20,979,241.29	17.02	102,281,623.42	82.98
合计	20,293	14,455.92	75,487,582.42	25.73	217,866,429.42	74.27

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	汇添富沪深300指数量化增强A	10,539.22	0.01
	汇添富沪深300指数量化增强C	0.00	0.00
	合计	10,539.22	0.00

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	汇添富沪深300指数量化增强A	0
	汇添富沪深300指数量化增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富沪深300指数量化增强A	0

	汇添富沪深300指数量化增强C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富沪深300指数量化增强A	汇添富沪深300指数量化增强C
基金合同生效日（2025年09月30日）基金份额总额	412,678,881.52	287,546,611.38
本报告期期初基金份额总额	254,761,071.83	164,068,852.95
本报告期基金总申购份额	89,561,304.88	81,332,328.49
减：本报告期基金总赎回份额	174,229,229.58	122,140,316.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	170,093,147.13	123,260,864.71

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

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

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（%）	
东方证券	2	1,905,801,968.09	88.90	335,217.66	88.90	
中信证券	3	203,576,532.75	9.50	35,810.06	9.50	
广发证券	4	34,393,668.51	1.60	6,049.60	1.60	
财通证券	2	-	-	-	-	
长江证券	3	-	-	-	-	
国联民生	2	-	-	-	-	
国泰海通	2	-	-	-	-	
华安证券	2	-	-	-	-	

华福证券	2	-	-	-	-	
华金证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
摩根大通证券	2	-	-	-	-	
南京证券	1	-	-	-	-	
银河证券	2	-	-	-	-	
招商证券	4	-	-	-	-	
中信建投证券	2	-	-	-	-	

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（%）
东方证券	999,550.00	100.00	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部（合称“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

（2）交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

（6）交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2025年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,	2026年01月22日

		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部分基金更新基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2026年02月13日
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02月13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

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沪深300指数量化增强型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富沪深300指数量化增强型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富沪深300指数量化增强型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富沪深300指数量化增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路728号　汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026年08月31日