

汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§ 5 托管人报告.....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 净资产变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22
§ 7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	65
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.....	65
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.....	66
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.....	66

7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
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	69
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证 500ETF
场内简称	500 添富
基金主代码	563750
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 10 月 22 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	337,237,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 10 月 30 日

注：扩位证券简称：中证 500ETF 汇添富。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	招商证券股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李鹏	韩鑫普
	联系电话	021-28932888	0755-82943666
	电子邮箱	service@99fund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95565
传真		021-28932998	0755-82960794
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码		200010	518000
法定代表人		鲁伟铭	朱江涛

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	56,704,563.07
本期利润	86,979,776.90
加权平均基金份额本期利润	0.2339
本期加权平均净值利润率	20.52%
本期基金份额净值增长率	22.37%
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	53,022,527.63
期末可供分配基金份额利润	0.1572
期末基金资产净值	423,919,313.57

期末基金份额净值	1.2570
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	25.70%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个 月	19.93%	1.65%	18.56%	1.65%	1.37%	0.00%
过去六个 月	22.37%	1.66%	20.97%	1.66%	1.40%	0.00%
自基金合 同生效起 至今	25.70%	1.50%	25.69%	1.51%	0.01%	-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

汇添富中证500ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2025 年 10 月 22 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		
孙浩	本基金的基金经理	2025 年 10 月 22 日	-	6	国籍：中国。学历：北京大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格, CFA。从业经历：2020 年 7 月起任汇添富基金管理股份有限公司数量分析师。2023 年 8 月 29 日至今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。2023 年 8 月 29 日至

					2026 年 5 月 26 日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。2023 年 8 月 29 日至 2025 年 3 月 18 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。2023 年 8 月 29 日至 2026 年 6 月 11 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 9 月 28 日至今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。2023 年 11 月 28 日至 2026 年 5 月 26 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。2023 年 11 月 28 日至今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 12 月 12 日至今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。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至 2026 年 6 月 11 日任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经
--	--	--	--	--	---

					理。2024 年 3 月 12 日至 2024 年 12 月 26 日任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 26 日至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今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。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 4 日至 2025 年 8 月 11 日任汇添富中证芯片产业交易型开放
--	--	--	--	--	--

					式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 20 日至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 7 月 9 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2024 年 11 月 18 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 18 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 27 日至今任汇添富上证科创
--	--	--	--	--	---

					板芯片交易 型开放式指 数证券投资 基金发起式 联接基金的 基金经理。 2025 年 10 月 22 日至今 任汇添富中 证 500 交易 型开放式指 数证券投资 基金的基金 经理。2026 年 5 月 26 日 至今任汇添 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 5 月 26 日至今任 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。
--	--	--	--	--	---

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

2026 年上半年 A 股整体震荡上行，上证指数累计上涨 3.16%。分行业看，电子、通信、建材、基础化工板块涨幅领跑；消费者服务、农林牧渔、商贸零售、传媒板块表现垫底。中信一级行业涨跌幅首尾区间差值达 117.37%，市场结构性分化特征突出；风格维度成长风格显著占优，价值板块持续承压。

2026 年作为“十五五”规划开局之年，国内经济在政策红利释放、外部环境日趋复杂的双重背景下，呈现“总量增速边际走缓、行业结构分化持续加深”的运行特征。1—6 月规模以上工业增加值累计同比增长 5.4%，较一季度（1—3 月）6.1%的累计增速回落 0.7 个百分点，工业总量增速逐季走弱。高技术制造业是工业板块中唯一增速持续抬升的领域：一季度增加值累计同比增长 12.5%，上半年进一步升至 13.3%，累计增速提升 0.8 个百分点，产业升级动力充沛。6 月制造业 PMI 为 50.3%，较 5 月 50.0%小幅回升，与 4 月数值持平；指数连续三个月贴近荣枯线 50%，反映制造业仅处于弱修复区间。分项来看，新订单指数偏弱，意味着内需修复根基尚不稳固，企业生产主要依靠存量在手订单支撑。

需求端“三驾马车”走势大幅分化，出口是上半年经济的核心支撑，也是最大亮点。4、5、6 月单月出口同比增速分别达 14.0%、19.3%、27.0%，二季度出口持续高景气；1—6 月全国出口累计同比增长 17.6%，在全球外需整体疲软环境下充分彰显国内供应链韧性。本轮出口高增核心驱动为全球 AI 产业资本开支扩张，拉动国内科技产业链产品外需放量；半导体、通信设备、消费电子等高技术产品出口占比持续提升，出口结构正加速由劳动密集型向技术密集型转型。

消费修复力度持续偏弱。1—6 月社会消费品零售总额累计同比增长 1.3%，较一季度 2.4%的增速再度回落 1.1 个百分点。消费走弱核心原因是 2025 年以旧换新政策提前透支居民消费需求，2026 年上半年消费市场进入需求真空期。后续消费复苏节奏，将取决于居民收入预期改善与房地产市场企稳两大条件。

整体投资端持续承压，房地产投资为主要拖累项。1—6 月全国固定资产投资累计同比下降 5.7%，其中房地产开发投资累计同比下滑 18.0%，降幅较 1—5 月的 16.2%持续走阔。地产行业深度调整仍是压制整体投资的核心因素：虽然部分核心城市二手房量价边际回暖，但新房销售、投资数据依旧走弱，稳地产政策的托底成效尚未充分显现。制造业投资依托高技术产业拉动保持相对稳健，基建投资受益于财政前置发力与“十五五”储备项目落地具备

一定韧性，但二者增长力度仍无法对冲地产下行带来的拖累。

物价层面，6 月 CPI 同比上涨 1.0%，上半年 CPI 累计同比约 1.0%，物价保持温和修复。PPI 二季度出现显著边际改善：6 月 PPI 同比升至 4.1%，较 3 月 0.5%大幅上行 3.6 个百分点，上半年 PPI 累计同比上涨 1.5%。PPI 快速上行，一方面源于中东地缘冲突推高国际油价带来的输入型成本压力，另一方面也佐证制造业内需边际回暖。

宏观基本面变化与 A 股市场走势形成清晰映射：高技术制造业长期高景气叠加政策支持持续加持，成为上半年市场核心主线，驱动电子、通信等成长赛道大幅走强。PPI 快速上行有望修复中游制造企业盈利预期，叠加“十五五”科技创新、产业升级政策持续落地，持续抬升市场对成长板块的风险偏好。反观传统制造、地产产业链，受投资下行、内需疲软制约，基本面修复动力不足，叠加消费复苏不及预期，价值板块整体表现疲软，最终造就市场极致的结构性分化行情。

中证 500ETF 汇添富及其联接基金跟踪中证 500 指数。中证 500 指数是中证系列宽基指数中的中小盘风格代表，权重分散，主要行业集中在信息技术、工业和材料等制造业板块。当前大中小盘宽基的产品生态逐步完善，中证 500ETF 汇添富及其联接基金结合期货、期权等衍生品，能够让投资者构建丰富的策略组合。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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 22.37%，同期业绩比较基准收益率为 20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济结构性分化格局预计延续，A 股市场依旧以结构性机会为主。电子、通信等成长板块上半年累计涨幅较大，当前估值处于相对高位，短期资金博弈或将加剧板块波动；但高技术制造业产业升级中长期逻辑未发生改变，叠加 PPI 上行持续修复中游制造盈利，电子、通信、高端装备等成长赛道仍具备较强配置价值，后续业绩增长有望逐步消化当前高估值。消费、地产链板块则仍需等待内需回暖、稳增长托底政策显效的明确信号。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽

核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；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，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位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

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	8,881,415.81	8,878,374.09
结算备付金		5,174,933.73	2,920,591.06
存出保证金		1,471,915.20	1,237,588.80
交易性金融资产	6.4.7.2	410,782,425.33	410,163,040.07
其中：股票投资		410,649,797.26	410,118,039.38
基金投资		-	-
债券投资		132,628.07	45,000.69
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	60,492.63	-
资产总计		426,371,182.70	423,199,594.02
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		2,235,664.78	2,073,229.11

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		49,166.62	55,372.63
应付托管费		16,388.86	18,457.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		35,686.47	0.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	114,962.40	155,952.05
负债合计		2,451,869.13	2,303,011.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	337,237,000.00	409,737,000.00
未分配利润	6.4.7.9	86,682,313.57	11,159,582.66
净资产合计		423,919,313.57	420,896,582.66
负债和净资产总计		426,371,182.70	423,199,594.02

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2570 元，基金份额总额 337,237,000.00 份。

2、本基金合同于 2025 年 10 月 22 日生效，上年度实际报告期间为 2025 年 10 月 22 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 500 交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		87,561,393.09
1. 利息收入		33,559.39
其中：存款利息收入	6.4.7.10	33,559.39
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）		56,835,416.55
其中：股票投资收益	6.4.7.11	51,646,472.83
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	20.33
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	2,633,344.69

股利收益	6.4.7.17	2,555,578.70
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	30,275,213.83
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	417,203.32
减：二、营业总支出		581,616.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	315,106.36
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	105,035.43
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-
7. 税金及附加		9,484.29
8. 其他费用	6.4.7.21	151,990.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		86,979,776.90
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		86,979,776.90
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		86,979,776.90

注：本基金合同于 2025 年 10 月 22 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：汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	409,737,000.00	11,159,582.66	420,896,582.66
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	409,737,000.00	11,159,582.66	420,896,582.66
三、本期增减变动额（减少以	-72,500,000.00	75,522,730.91	3,022,730.91

“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	86,979,776.90	86,979,776.90
(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)	-72,500,000.00	-11,457,045.99	-83,957,045.99
其中: 1. 基金申购款	260,000,000.00	39,130,485.96	299,130,485.96
2. 基金赎回款	-332,500,000.00	-50,587,531.95	-383,087,531.95
(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	337,237,000.00	86,682,313.57	423,919,313.57

注：本基金合同于 2025 年 10 月 22 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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2025〕987 号文《关于准予汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。本基金募集期间为 2025 年 10 月 13 日起至 2025 年 10 月 17 日，首次募集扣除认购费后的净认购金额为人民币 237,237,000.00 元，在募集期间产生的利息为人民币 17,035.53 元，全部归入基金财产，以上有效认购资金合计为人民币 237,254,035.53 元，折合 237,237,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2025）验字第 70015647_B50 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 10 月 22 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管

理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

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。

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	3,526,165.00
等于：本金	3,525,548.23
加：应计利息	616.77
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	5,355,250.81
等于：本金	5,355,134.94
加：应计利息	115.87
减：坏账准备	-
合计	8,881,415.81

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		365,548,872.02	-	410,649,797.26	45,100,925.24
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	100,000.00	21.07	132,628.07	32,607.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	100,000.00	21.07	132,628.07	32,607.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		365,648,872.02	21.07	410,782,425.33	45,133,532.24

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	11,752,800.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	11,752,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,752,800.00	-	-	-

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
IC2609	IC2609	7	12,265,960.00	513,160.00
合计				513,160.00
减：可抵销期货暂收款				513,160.00
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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	22,315.49
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	13,369.04
其他	19,770.50
合计	114,962.40

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	409,737,000.00	409,737,000.00
本期申购	260,000,000.00	260,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-332,500,000.00	-332,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	337,237,000.00	337,237,000.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,171,086.30	9,988,496.36	11,159,582.66
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	1,171,086.30	9,988,496.36	11,159,582.66
本期利润	56,704,563.07	30,275,213.83	86,979,776.90
本期基金份额交易产生的变动数	-4,853,121.74	-6,603,924.25	-11,457,045.99
其中：基金申购款	17,670,700.05	21,459,785.91	39,130,485.96
基金赎回款	-22,523,821.79	-28,063,710.16	-50,587,531.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,022,527.63	33,659,785.94	86,682,313.57

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	11,560.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,630.42
结算备付金利息收入	20,368.65
其他	-
合计	33,559.39

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	39,243,230.56
股票投资收益——赎回差价收入	12,403,242.27
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	51,646,472.83

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	327,482,846.46
减：卖出股票成本总额	287,933,164.47
减：交易费用	306,451.43
买卖股票差价收入	39,243,230.56

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	383,087,531.95
减：现金支付赎回款总额	204,974,314.04
减：赎回股票成本总额	165,709,975.64
减：交易费用	-
赎回差价收入	12,403,242.27

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	20.33
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-
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	20.33

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。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	-
外汇远期投资收益	-
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	2,633,344.69

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	2,555,578.70
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	2,555,578.70

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	30,519,293.83
——股票投资	30,486,686.83
——债券投资	32,607.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-244,080.00
——权证投资	-
——期货投资	-244,080.00
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	30,275,213.83

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	417,203.32
其他	-
合计	417,203.32

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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	630.07
指数使用费	-
登记结算服务费	59,507.37
IOPV 计算与发布费	9,916.99
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	112.82
合计	151,990.11

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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人
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）	该基金是本基金的联接基金

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（%）
招商证券	614,210,236.99	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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（%）
招商证券	103,320.19	100.00	-	-

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	315,106.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	21,959.03
应支付基金管理人的净管理费	293,147.33

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，

顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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	105,035.43

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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末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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
招商证券股份有 限公司	6,704,900.00	1.99	25,118,900.00	6.13
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)	271,029,000.00	80.37	298,616,100.00	72.88

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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
招商证券	5,355,250.81	1,630.42

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：本基金本报告期末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
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	135	7,190.10	7,929.90	
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	69	1,268.22	1,157.82	
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	232	7,048.16	9,045.68	
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	357	3,612.84	9,899.61	
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	79	2,106.14	4,025.84	
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	354	4,924.14	11,494.38	
301666	大普微	2026 年 04 月 08 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	323	14,883.84	149,655.59	

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	70	4,060.00	7,851.20	
301682	宏明电子	2026年03月18日	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	198	13,792.68	31,691.88	
301696	三瑞智能	2026年03月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	74	1,826.32	6,423.20	
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	61	961.36	2,849.31	
688781	视涯科技	2026年03月18日	6个月	新股流通受限	22.68	47.61	39	884.52	1,856.79	
688797	臻宝科技	2026年06月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	101	4,500.56	47,335.67	
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	305	1,955.05	7,359.65	
688813	泰金新能	2026年03月24日	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	43	1,130.04	7,399.87	
688820	盛合晶微	2026年04月13日	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	69	1,357.92	9,762.81	

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026 年 06 月 11 日	17 个交易日	新债流通受限	100.00	100.00	550	55,000.00	55,002.53	

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	8,881,41 5.81	-	-	-	-	-	8,881,41 5.81
结算备付 金	5,174,93 3.73	-	-	-	-	-	5,174,93 3.73
存出保证 金	-	-	-	-	-	1,471,91 5.20	1,471,91 5.20
交易性金 融资产	77,625.5 4	-	55,002.5 3	-	-	410,649, 797.26	410,782, 425.33
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售 金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得 税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	60,492.6 3	60,492.6 3
资产总计	14,133,9 75.08	-	55,002.5 3	-	-	412,182, 205.09	426,371, 182.70
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	-	-	-	-	-	2,235,664.78	2,235,664.78
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,166.62	49,166.62
应付托管费	-	-	-	-	-	16,388.86	16,388.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	35,686.47	35,686.47
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	114,962.40	114,962.40
负债总计	-	-	-	-	-	2,451,869.13	2,451,869.13
利率敏感度缺口	14,133,975.08	-	55,002.53	-	-	409,730,335.96	423,919,313.57
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	8,878,374.09	-	-	-	-	-	8,878,374.09
结算备付金	2,920,591.06	-	-	-	-	-	2,920,591.06
存出保证金	-	-	-	-	-	1,237,588.80	1,237,588.80
交易性金融资产	-	-	45,000.69	-	-	410,118,039.38	410,163,040.07
衍生金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
买入返售 金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得 税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,798,9 65.15	-	45,000.6 9	-	-	411,355, 628.18	423,199, 594.02
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	-	-	-	-	-	2,073,22 9.11	2,073,22 9.11
应付赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	55,372.6 3	55,372.6 3
应付托管 费	-	-	-	-	-	18,457.5 6	18,457.5 6
应付销售 服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资 顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.01	0.01
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得 税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	155,952. 05	155,952. 05
负债总计	-	-	-	-	-	2,303,01 1.36	2,303,01 1.36

利率敏感 度缺口	11,798,9 65.15	-	45,000.6 9	-	-	409,052, 616.82	420,896, 582.66
-------------	-------------------	---	---------------	---	---	--------------------	--------------------

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	410,649,797.26	96.87	410,118,039.38	97.44
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	132,628.07	0.03	45,000.69	0.01
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	410,782,425.33	96.90	410,163,040.07	97.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；
----	--

	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上涨 5%	21, 221, 033. 93	19, 482, 988. 89
	中证 500 指数下跌 5%	-21, 221, 033. 93	-19, 482, 988. 89

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	410, 371, 160. 78
第二层次	55, 002. 53
第三层次	356, 262. 02
合计	410, 782, 425. 33

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务情况，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	410,649,797.26	96.31
	其中：股票	410,649,797.26	96.31
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	132,628.07	0.03
	其中：债券	132,628.07	0.03
	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	14,056,349.54	3.30
8	其他各项资产	1,532,407.83	0.36

9	合计	426,371,182.70	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	1,343,724.00	0.32
B	采矿业	12,645,390.47	2.98
C	制造业	308,931,206.67	72.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,969,852.00	2.35
E	建筑业	2,413,379.00	0.57
F	批发和零售业	7,763,342.00	1.83
G	交通运输、仓储和邮政业	4,975,056.00	1.17
H	住宿和餐饮业	296,835.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,381,559.33	6.22
J	金融业	22,466,939.53	5.30
K	房地产业	1,649,326.00	0.39
L	租赁和商务服务业	4,197,410.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	2,969,219.24	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	1,412,637.00	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	959,149.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	1,918,510.00	0.45
S	综合	—	—
	合计	410,293,535.24	96.79

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	356,262.02	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
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	356,262.02	0.08

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	688498	源杰科技	3,538	6,672,668.00	1.57
2	001309	德明利	5,900	5,563,110.00	1.31
3	300604	长川科技	16,100	5,496,862.00	1.30
4	688347	华虹宏力半导体	15,085	5,073,085.50	1.20
5	688120	华海清科	14,660	4,723,158.80	1.11
6	002281	光迅科技	17,500	4,496,450.00	1.06
7	002008	大族激光	29,900	4,488,289.00	1.06
8	300857	协创数据	12,440	4,228,356.00	1.00
9	300136	信维通信	35,300	4,209,525.00	0.99

10	688361	中科飞测	8,707	3,744,010.0 0	0.88
11	300475	香农芯创	12,000	3,600,000.0 0	0.85
12	300223	北京君正	14,000	3,484,600.0 0	0.82
13	002436	兴森科技	61,900	3,153,805.0 0	0.74
14	300285	国瓷材料	28,900	2,981,902.0 0	0.70
15	300054	鼎龙股份	27,700	2,935,369.0 0	0.69
16	300666	江丰电子	7,800	2,875,080.0 0	0.68
17	600105	永鼎股份	42,400	2,861,152.0 0	0.67
18	688777	中控技术	23,085	2,712,487.5 0	0.64
19	300757	罗博特科	4,200	2,599,800.0 0	0.61
20	688200	华峰测控	4,925	2,586,117.5 0	0.61
21	000021	深科技	40,000	2,570,800.0 0	0.61
22	688037	芯源微电子	5,730	2,515,756.5 0	0.59
23	002851	麦格米特	14,800	2,474,264.0 0	0.58
24	300548	长芯博创	8,700	2,418,600.0 0	0.57
25	601869	长飞光纤	4,300	2,347,370.0 0	0.55
26	002409	雅克科技	10,400	2,334,800.0 0	0.55
27	300346	南大光电	25,200	2,334,780.0 0	0.55
28	300567	精测电子	7,300	2,318,480.0 0	0.55
29	688019	安集科技	6,465	2,194,608.9 0	0.52
30	688313	仕佳光子	11,839	2,186,071.3 5	0.52
31	600498	烽火通信	29,500	2,171,200.0 0	0.51

32	688002	睿创微纳	13,956	2,158,853.6 4	0.51
33	002185	华天科技	96,500	2,152,915.0 0	0.51
34	002138	顺络电子	29,200	2,134,520.0 0	0.50
35	300620	光库科技	5,600	2,117,920.0 0	0.50
36	002407	多氟多	41,700	2,094,591.0 0	0.49
37	600879	航天电子	95,900	2,041,711.0 0	0.48
38	300395	菲利华	15,200	2,032,696.0 0	0.48
39	300390	天华新能	21,300	1,991,763.0 0	0.47
40	688469	芯联集成	182,860	1,940,144.6 0	0.46
41	301526	国际复材	41,100	1,918,137.0 0	0.45
42	688017	绿的谐波	4,553	1,902,516.5 8	0.45
43	300373	扬杰科技	11,900	1,871,037.0 0	0.44
44	300058	蓝色光标	130,500	1,795,680.0 0	0.42
45	603256	宏和科技	6,700	1,777,711.0 0	0.42
46	300037	新宙邦	19,000	1,764,150.0 0	0.42
47	300751	迈为股份	6,200	1,751,252.0 0	0.41
48	688172	燕东微电子 股份	20,886	1,747,322.7 6	0.41
49	002273	水晶光电	48,200	1,710,136.0 0	0.40
50	688702	盛科通信	4,369	1,703,866.3 1	0.40
51	605358	立昂微	21,600	1,676,160.0 0	0.40
52	688099	晶晨半导体	15,638	1,609,150.2 0	0.38
53	301377	鼎泰高科	2,900	1,597,610.0 0	0.38

54	600988	赤峰黄金	60,600	1,594,992.0 0	0.38
55	605589	圣泉集团	24,700	1,570,179.0 0	0.37
56	600885	宏发股份	44,900	1,548,601.0 0	0.37
57	000960	锡业股份	36,000	1,536,840.0 0	0.36
58	002126	银轮股份	30,700	1,528,860.0 0	0.36
59	001389	广合科技	6,400	1,518,400.0 0	0.36
60	600392	盛和资源	51,000	1,518,270.0 0	0.36
61	002738	中矿资源	25,400	1,498,346.0 0	0.35
62	000831	中国稀土	27,000	1,498,230.0 0	0.35
63	600601	方正科技	105,500	1,460,120.0 0	0.34
64	300570	太辰光	5,900	1,455,589.0 0	0.34
65	002812	恩捷股份	21,500	1,438,565.0 0	0.34
66	600141	兴发集团	30,500	1,432,585.0 0	0.34
67	601179	中国西电	93,100	1,389,052.0 0	0.33
68	301358	湖南裕能	18,300	1,388,421.0 0	0.33
69	600378	昊华科技	18,300	1,379,454.0 0	0.33
70	002850	科达利	7,200	1,362,960.0 0	0.32
71	002195	岩山科技	206,200	1,348,548.0 0	0.32
72	600497	驰宏锌锗	109,800	1,329,678.0 0	0.31
73	688234	天岳先进	7,633	1,324,401.8 3	0.31
74	002261	拓维信息	46,000	1,288,460.0 0	0.30
75	600157	永泰能源	787,300	1,267,553.0 0	0.30

76	600711	盛屯矿业	112,500	1,234,125.0 0	0.29
77	688629	四川华丰科技	6,551	1,228,378.0 1	0.29
78	002340	格林美	185,500	1,226,155.0 0	0.29
79	600909	华安证券	109,500	1,216,545.0 0	0.29
80	003031	中瓷电子	6,700	1,208,010.0 0	0.28
81	600143	金发科技	77,800	1,202,010.0 0	0.28
82	002821	凯莱英	7,400	1,198,800.0 0	0.28
83	300017	网宿科技	90,800	1,181,308.0 0	0.28
84	000783	长江证券	120,600	1,175,850.0 0	0.28
85	301611	珂玛科技	6,500	1,170,455.0 0	0.28
86	002131	利欧股份	246,300	1,169,925.0 0	0.28
87	600352	浙江龙盛	94,600	1,145,606.0 0	0.27
88	601555	东吴证券	144,500	1,144,440.0 0	0.27
89	688052	纳芯微电子	3,966	1,143,437.4 6	0.27
90	002203	海亮股份	50,000	1,142,500.0 0	0.27
91	688213	思特威电子科技	10,604	1,135,370.2 8	0.27
92	688411	海博思创	3,889	1,132,476.8 0	0.27
93	002966	苏州银行	162,400	1,130,304.0 0	0.27
94	601233	桐昆股份	51,900	1,123,635.0 0	0.27
95	603659	璞泰来	38,800	1,122,484.0 0	0.26
96	301200	大族数控	3,100	1,118,015.0 0	0.26
97	300339	润和软件	28,900	1,112,939.0 0	0.26

98	688578	艾力斯医药科技	10,191	1,112,857.20	0.26
99	688220	翱捷科技	8,916	1,108,437.12	0.26
100	300759	康龙化成	37,600	1,087,768.00	0.26
101	688027	科大国盾量子	2,141	1,079,085.41	0.25
102	688122	西部超导	16,755	1,052,381.55	0.25
103	603308	应流股份	17,200	1,038,880.00	0.25
104	601108	财通证券	118,200	1,022,430.00	0.24
105	688235	百济神州	4,007	1,020,222.27	0.24
106	300207	欣旺达	53,700	1,019,763.00	0.24
107	300001	特锐德	26,800	1,013,844.00	0.24
108	002517	恺英网络	62,200	1,010,750.00	0.24
109	002797	第一创业	152,900	1,004,553.00	0.24
110	002601	龙佰集团	60,800	1,001,984.00	0.24
111	688385	复旦微电	14,013	998,986.77	0.24
112	300458	全志科技	25,280	997,548.80	0.24
113	601958	金钼股份	35,300	992,283.00	0.23
114	002472	双环传动	23,900	992,089.00	0.23
115	688387	中信科移动	49,650	985,056.00	0.23
116	600563	法拉电子	5,100	973,080.00	0.23
117	603129	春风动力	3,800	972,040.00	0.23
118	300115	长盈精密	34,600	966,724.00	0.23
119	601198	东兴证券	70,400	956,736.00	0.23
120	601991	大唐发电	135,100	956,508.00	0.23
121	002155	湖南黄金	39,800	950,026.00	0.22
122	000703	恒逸石化	69,400	941,758.00	0.22
123	688322	奥比中光	7,125	930,168.75	0.22
124	002465	海格通信	72,300	923,271.00	0.22
125	300454	深信服	9,500	913,900.00	0.22
126	688301	奕瑞科技股份	7,360	912,640.00	0.22

127	601665	齐鲁银行	156,600	903,582.00	0.21
128	002056	横店东磁	29,500	899,160.00	0.21
129	603179	新泉股份	18,040	895,686.00	0.21
130	603156	养元饮品	18,200	893,074.00	0.21
131	603650	彤程新材	9,100	891,618.00	0.21
132	600884	杉杉股份	65,400	886,170.00	0.21
133	688676	海南金盘智能科技	10,400	880,256.00	0.21
134	300024	机器人	45,400	877,582.00	0.21
135	002130	沃尔核材	46,000	872,160.00	0.21
136	601162	天风证券	256,500	864,405.00	0.20
137	000060	中金岭南	113,100	856,167.00	0.20
138	600707	彩虹股份	50,600	854,634.00	0.20
139	002429	兆驰股份	82,200	854,058.00	0.20
140	300012	华测检测	61,300	849,618.00	0.20
141	002432	九安医疗	11,900	841,092.00	0.20
142	000878	云南铜业	52,900	840,052.00	0.20
143	002402	和而泰	32,500	839,475.00	0.20
144	601099	太平洋	247,800	835,086.00	0.20
145	000893	亚钾国际	20,300	830,067.00	0.20
146	300496	中科创达	13,400	827,986.00	0.20
147	600109	国金证券	94,200	827,076.00	0.20
148	002414	高德红外	62,200	824,772.00	0.19
149	002271	东方雨虹	69,400	823,778.00	0.19
150	688331	荣昌生物	6,321	823,373.46	0.19
151	603688	石英股份	9,900	817,839.00	0.19
152	000034	神州数码	29,460	817,515.00	0.19
153	689009	九号公司	21,338	814,044.70	0.19
154	603379	三美股份	10,700	812,023.00	0.19
155	002444	巨星科技	26,100	811,710.00	0.19
156	301536	星辰科技	6,300	810,873.00	0.19
157	300623	捷捷微电	18,000	809,820.00	0.19
158	002487	大金重工	13,900	805,783.00	0.19
159	300474	景嘉微	13,300	804,384.00	0.19
160	600298	安琪酵母	22,200	803,640.00	0.19
161	603979	金诚信	13,600	802,808.00	0.19
162	600256	广汇能源	162,500	802,750.00	0.19
163	002335	科华数据	18,865	800,819.25	0.19
164	000733	振华科技	14,100	798,624.00	0.19
165	300763	锦浪科技	8,800	795,080.00	0.19
166	000661	长春高新	11,900	792,540.00	0.19
167	600060	海信视像	28,400	791,508.00	0.19
168	002756	永兴材料	13,700	775,968.00	0.18

169	600021	上海电力	51,300	773,091.00	0.18
170	688728	格科微有限公司	36,670	771,536.80	0.18
171	601128	常熟银行	132,550	771,441.00	0.18
172	600699	均胜电子	35,600	769,316.00	0.18
173	300748	金力永磁	24,900	768,165.00	0.18
174	688266	泽璟制药	6,582	767,856.12	0.18
175	601696	中银证券	60,700	767,855.00	0.18
176	601577	长沙银行	87,800	764,738.00	0.18
177	002078	太阳纸业	61,100	763,139.00	0.18
178	002025	航天电器	10,000	762,200.00	0.18
179	601615	明阳智能	65,800	761,306.00	0.18
180	300073	当升科技	15,800	759,032.00	0.18
181	002157	正邦科技	269,200	756,452.00	0.18
182	603920	世运电路	15,700	754,228.00	0.18
183	300142	沃森生物	58,000	753,420.00	0.18
184	300432	富临精工	37,300	749,357.00	0.18
185	300919	中伟新材	17,000	743,750.00	0.18
186	603606	东方电缆	17,900	743,029.00	0.18
187	000423	东阿阿胶	16,300	739,368.00	0.17
188	603087	甘李药业	13,000	737,880.00	0.17
189	300953	震裕科技	5,500	735,350.00	0.17
190	688343	云天励飞股份	8,942	730,203.72	0.17
191	002252	上海莱士	167,800	728,252.00	0.17
192	688599	天合光能	51,036	720,628.32	0.17
193	300724	捷佳伟创	10,200	720,120.00	0.17
194	000728	国元证券	95,100	712,299.00	0.17
195	688608	恒玄科技	4,195	701,362.05	0.17
196	688169	石头科技	7,368	699,738.96	0.17
197	603119	浙江荣泰股份	10,400	689,936.00	0.16
198	002064	华峰化学	72,300	686,127.00	0.16
199	000786	北新建材	37,200	672,948.00	0.16
200	001203	大中矿业	22,400	670,880.00	0.16
201	688180	君实生物	19,658	664,833.56	0.16
202	688375	国博电子	6,352	662,513.60	0.16
203	002831	裕同科技	18,606	661,629.36	0.16
204	600171	上海贝岭	20,700	661,158.00	0.16
205	603290	斯达半导	4,300	657,642.00	0.16
206	300679	电连技术	10,900	653,891.00	0.15
207	300383	光环新网	52,300	650,612.00	0.15
208	300677	英科医疗	16,600	650,222.00	0.15

209	688065	凯赛生物	13,412	641,764.20	0.15
210	688018	乐鑫科技	4,996	639,088.32	0.15
211	000519	中兵红箭	30,300	638,421.00	0.15
212	603806	福斯特	38,000	638,020.00	0.15
213	688187	时代电气	9,260	635,791.60	0.15
214	600516	方大炭素	102,500	632,425.00	0.15
215	002673	西部证券	97,400	632,126.00	0.15
216	600177	雅戈尔	83,900	631,767.00	0.15
217	603160	汇顶科技	10,200	629,442.00	0.15
218	000559	万向钱潮	48,300	624,519.00	0.15
219	688568	中科星图公司	14,953	620,100.91	0.15
220	600642	申能股份	71,000	619,830.00	0.15
221	601699	潞安环能	43,400	619,752.00	0.15
222	000623	吉林敖东	34,900	618,777.00	0.15
223	002624	完美世界	49,400	613,548.00	0.14
224	600637	东方明珠	73,500	610,785.00	0.14
225	300699	光威复材	21,300	610,245.00	0.14
226	603345	安井食品	7,600	609,444.00	0.14
227	300972	万辰集团	3,500	606,935.00	0.14
228	001696	宗申动力	29,100	605,571.00	0.14
229	300558	贝达药业	9,300	605,151.00	0.14
230	688188	上海柏楚电子科技	5,635	601,254.50	0.14
231	002085	万丰奥威	54,000	598,860.00	0.14
232	000983	山西焦煤	103,200	598,560.00	0.14
233	000750	国海证券	162,400	597,632.00	0.14
234	603225	新凤鸣	30,400	597,360.00	0.14
235	002318	久立特材	24,900	595,110.00	0.14
236	002739	儒意电影	61,500	590,400.00	0.14
237	600100	同方股份	85,400	584,990.00	0.14
238	600369	西南证券	144,900	582,498.00	0.14
239	002065	东华软件	81,500	581,910.00	0.14
240	600499	科达制造	41,800	576,840.00	0.14
241	300627	华测导航	20,300	576,520.00	0.14
242	600536	中国软件	20,500	576,460.00	0.14
243	002266	浙富控股	113,900	576,334.00	0.14
244	600595	中孚实业	102,100	573,802.00	0.14
245	002044	美年健康	113,900	572,917.00	0.14
246	603596	伯特利	22,952	570,127.68	0.13
247	603699	纽威股份	11,300	568,390.00	0.13
248	688772	珠海冠宇电池	28,911	567,522.93	0.13

249	002223	鱼跃医疗	22,000	564,520.00	0.13
250	000155	川能动力	47,100	564,258.00	0.13
251	000629	钒钛股份	168,900	564,126.00	0.13
252	000400	许继电气	25,900	562,030.00	0.13
253	688617	惠泰医疗	3,083	559,749.48	0.13
254	300002	神州泰岳	71,400	557,634.00	0.13
255	300003	乐普医疗	47,000	556,950.00	0.13
256	000032	深桑达 A	22,200	553,890.00	0.13
257	601016	节能风电	142,400	552,512.00	0.13
258	600985	淮北矿业	39,200	550,760.00	0.13
259	600521	华海药业	38,100	548,640.00	0.13
260	000415	渤海租赁	134,800	548,636.00	0.13
261	002430	杭氧股份	17,700	547,992.00	0.13
262	300487	蓝晓科技	9,300	547,305.00	0.13
263	601216	君正集团	122,600	546,796.00	0.13
264	601212	白银有色	107,600	546,608.00	0.13
265	600862	中航高科	30,300	546,309.00	0.13
266	601997	贵阳银行	106,300	545,319.00	0.13
267	601717	中创智领	39,200	545,272.00	0.13
268	000683	博源化工	94,500	544,320.00	0.13
269	000039	中集集团	66,900	542,559.00	0.13
270	603444	吉比特	1,502	538,346.84	0.13
271	600863	华能蒙电	114,000	535,800.00	0.13
272	603766	隆鑫通用	44,700	533,271.00	0.13
273	600704	物产中大	112,900	532,888.00	0.13
274	601001	晋控煤业	30,300	526,917.00	0.12
275	000050	深天马 A	53,100	526,221.00	0.12
276	601990	南京证券	79,900	524,943.00	0.12
277	600873	梅花生物	71,200	523,320.00	0.12
278	688297	中航无人机	12,589	523,072.95	0.12
279	688538	和辉光电	200,844	522,194.40	0.12
280	002841	视源股份	15,100	521,403.00	0.12
281	603077	和邦生物	224,700	521,304.00	0.12
281	603605	珀莱雅	8,700	521,304.00	0.12
283	600312	平高电气	29,500	520,970.00	0.12
284	000729	燕京啤酒	51,300	519,669.00	0.12
285	000887	中鼎股份	28,700	513,443.00	0.12
286	600332	白云山	25,600	513,024.00	0.12
287	600765	中航重机	39,500	510,340.00	0.12
288	600166	福田汽车	172,700	502,557.00	0.12
289	600153	建发股份	63,300	501,969.00	0.12
290	600348	华阳股份	65,600	501,840.00	0.12
291	000967	盈峰环境	47,300	498,069.00	0.12

292	000830	鲁西化工	41,500	498,000.00	0.12
293	002410	广联达	60,200	491,232.00	0.12
294	002939	长城证券	58,800	490,392.00	0.12
295	601799	星宇股份	5,400	489,348.00	0.12
296	601611	中国核建	43,700	487,255.00	0.11
297	002007	华兰生物	39,800	485,162.00	0.11
298	000062	深圳华强	15,200	483,664.00	0.11
299	600901	江苏金租	84,100	483,575.00	0.11
300	002683	广东宏大	16,500	483,285.00	0.11
301	688615	合合信息	4,178	472,531.80	0.11
302	688692	达梦数据	1,931	471,723.99	0.11
303	600578	京能电力	73,100	471,495.00	0.11
304	002926	华西证券	57,200	467,324.00	0.11
305	688582	芯动联科	7,136	463,840.00	0.11
306	000737	北方铜业	34,700	458,734.00	0.11
307	603568	伟明环保	29,800	458,324.00	0.11
308	600363	联创光电	12,800	457,984.00	0.11
309	000591	太阳能	99,500	457,700.00	0.11
310	600737	中粮糖业	37,100	457,443.00	0.11
311	600398	海澜之家	87,400	457,102.00	0.11
312	000921	海信家电	16,700	456,244.00	0.11
313	002603	以岭药业	30,300	454,500.00	0.11
314	688114	华大智造	8,878	453,488.24	0.11
315	600486	扬农化工	8,900	451,230.00	0.11
316	603298	杭叉集团	18,900	450,954.00	0.11
317	000528	柳工	59,400	448,470.00	0.11
318	601000	唐山港	107,700	446,955.00	0.11
319	603728	鸣志电器	7,300	444,716.00	0.10
320	000738	航发控制	24,000	438,960.00	0.10
321	600208	衢州发展	154,700	437,801.00	0.10
322	603341	龙旗科技	10,300	437,647.00	0.10
323	600316	洪都航空	15,600	435,864.00	0.10
324	600008	首创环保	160,100	435,472.00	0.10
325	000932	华菱钢铁	124,700	432,709.00	0.10
326	603486	科沃斯	8,500	431,375.00	0.10
327	600435	北方导航	38,500	431,200.00	0.10
328	600995	南网储能	35,000	430,500.00	0.10
329	600170	上海建工	193,900	430,458.00	0.10
330	600998	九州通	91,700	430,073.00	0.10
331	000987	越秀资本	54,700	427,754.00	0.10
332	002152	广电运通	45,000	422,100.00	0.10
333	000997	新大陆	25,800	420,540.00	0.10
334	002262	恩华药业	22,300	418,125.00	0.10

335	000951	中国重汽	21,400	417,514.00	0.10
336	600161	天坛生物	36,000	416,880.00	0.10
337	600820	隧道股份	80,000	416,800.00	0.10
338	688248	南方电网电 力科技	6,018	416,325.24	0.10
339	601106	中国一重	124,800	411,840.00	0.10
340	600282	南钢股份	89,700	411,723.00	0.10
341	600483	福能股份	40,400	411,676.00	0.10
342	000009	中国宝安	65,600	408,688.00	0.10
343	603885	吉祥航空	39,700	408,513.00	0.10
344	002500	山西证券	78,300	404,028.00	0.10
345	600583	海油工程	80,300	403,909.00	0.10
346	688166	博瑞生物医 药	11,437	400,409.37	0.09
347	603816	顾家家居	17,800	398,008.00	0.09
348	603939	益丰药房	22,100	397,358.00	0.09
349	603338	浙江鼎力	9,300	395,250.00	0.09
350	600546	山煤国际	36,100	394,573.00	0.09
351	000582	北部湾港	36,700	393,791.00	0.09
352	688778	厦钨新能源	7,171	390,102.40	0.09
353	688295	中复神鹰碳 纤维	6,394	387,092.76	0.09
354	600329	达仁堂	10,400	387,088.00	0.09
355	600763	通策医疗	11,400	386,232.00	0.09
356	601666	平煤股份	53,800	384,670.00	0.09
357	601567	三星电气	25,600	382,464.00	0.09
358	600562	国睿科技	17,900	379,838.00	0.09
359	600685	中船防务	14,900	379,056.00	0.09
360	600602	云赛智联	23,500	377,880.00	0.09
361	002312	川发龙鳞	41,100	376,887.00	0.09
362	600038	中直股份	14,900	376,821.00	0.09
363	000723	美锦能源	112,200	375,870.00	0.09
364	600380	健康元	39,900	375,858.00	0.09
365	003022	联泓新科	14,500	375,550.00	0.09
366	300676	华大基因	10,700	375,142.00	0.09
367	603565	中谷物流	38,200	374,742.00	0.09
368	601156	东航物流	23,200	373,984.00	0.09
369	600390	五矿资本	81,700	372,552.00	0.09
370	601880	辽港股份	268,200	370,116.00	0.09
371	000513	丽珠集团	12,800	369,792.00	0.09
372	600132	重庆啤酒	8,900	367,570.00	0.09
373	601399	国机重装	104,900	367,150.00	0.09
374	601865	福莱特	34,700	364,697.00	0.09

375	688318	财富趋势	5,040	359,402.40	0.08
376	600535	天士力	27,100	358,533.00	0.08
377	600511	国药股份	13,700	356,748.00	0.08
378	000739	普洛药业	21,200	353,192.00	0.08
379	600906	财达证券	47,300	352,858.00	0.08
380	601236	红塔证券	51,500	351,230.00	0.08
381	600977	中国电影	27,100	350,132.00	0.08
382	600816	建元信托	143,200	349,408.00	0.08
383	000598	兴蓉环境	54,200	347,964.00	0.08
384	300100	双林股份	12,500	347,250.00	0.08
385	002299	圣农发展	22,700	344,132.00	0.08
386	002244	滨江集团	45,100	342,760.00	0.08
387	300718	长盛轴承	5,600	341,432.00	0.08
388	600970	中材国际	47,800	340,814.00	0.08
389	688281	华秦科技实 业	6,778	340,458.94	0.08
390	601155	新城控股	33,000	338,580.00	0.08
391	688336	三生国健	6,368	338,140.80	0.08
392	002120	韵达股份	52,700	335,172.00	0.08
393	300146	汤臣倍健	37,000	334,480.00	0.08
394	300735	光弘科技	14,700	334,278.00	0.08
395	600967	内蒙一机	30,800	334,180.00	0.08
396	000883	湖北能源	77,200	333,504.00	0.08
397	300144	宋城演艺	57,100	331,751.00	0.08
398	000027	深圳能源	51,900	321,780.00	0.08
399	600131	国网信通	21,900	319,740.00	0.08
400	000800	一汽解放	53,600	318,920.00	0.08
401	002568	百润股份	18,800	318,096.00	0.08
402	601608	中信重工	66,600	317,682.00	0.07
403	688278	特宝生物	5,800	315,520.00	0.07
404	601866	中远海发	141,900	313,599.00	0.07
405	600095	湘财股份	41,500	312,495.00	0.07
406	603737	三棵树	12,880	310,408.00	0.07
407	000088	盐田港	75,700	309,613.00	0.07
408	601118	海南橡胶	62,300	306,516.00	0.07
409	688363	华熙生物	8,556	306,048.12	0.07
410	002583	海能达	39,700	305,293.00	0.07
411	600801	华新建材	19,400	302,640.00	0.07
412	600126	杭钢股份	49,200	301,596.00	0.07
413	603000	人民网	20,200	298,758.00	0.07
414	600871	石化油服	146,600	297,598.00	0.07
415	600566	济川药业	13,400	297,346.00	0.07
416	003021	兆威机电	3,400	296,990.00	0.07

417	600754	锦江酒店	16,500	296,835.00	0.07
418	002984	森麒麟	22,700	296,689.00	0.07
419	600517	国网英大	62,400	292,032.00	0.07
420	000709	河钢股份	149,900	290,806.00	0.07
421	600655	豫园股份	70,600	290,166.00	0.07
422	603589	口子窖	15,200	283,936.00	0.07
423	000825	太钢不锈	82,700	282,007.00	0.07
424	600598	北大荒	25,900	280,756.00	0.07
425	601598	中国外运	56,200	278,752.00	0.07
426	603858	步长制药	19,000	277,400.00	0.07
427	002423	中粮资本	33,611	276,618.53	0.07
428	001286	陕西能源	27,200	275,808.00	0.07
429	603899	晨光股份	13,300	274,379.00	0.06
430	002773	康弘药业	13,400	274,030.00	0.06
431	600350	山东高速	24,600	273,798.00	0.06
432	600004	白云机场	37,500	272,250.00	0.06
433	601966	玲珑轮胎	26,600	271,054.00	0.06
434	600663	陆家嘴	42,800	268,784.00	0.06
435	301606	绿联科技	4,400	268,488.00	0.06
436	600582	天地科技	60,300	268,335.00	0.06
437	688349	三一重能	17,581	266,879.58	0.06
438	688192	迪哲医药	6,610	263,937.30	0.06
439	600848	上海临港	34,900	261,401.00	0.06
440	688709	成都华微	6,787	258,516.83	0.06
441	000429	粤高速 A	18,900	257,985.00	0.06
442	601098	中南传媒	26,100	256,824.00	0.06
443	002508	老板电器	17,100	250,002.00	0.06
444	603233	大参林	16,500	247,995.00	0.06
445	688561	奇安信集团	10,295	246,874.10	0.06
446	600968	海油发展	74,000	246,420.00	0.06
447	300957	贝泰妮	7,800	245,778.00	0.06
448	688563	航空材料股份	4,796	245,699.08	0.06
449	601928	凤凰传媒	27,700	243,483.00	0.06
450	600062	华润双鹤	15,100	242,204.00	0.06
451	300888	稳健医疗	8,600	240,714.00	0.06
452	003035	南网能源	41,300	240,366.00	0.06
453	002032	苏泊尔	6,000	237,600.00	0.06
454	600688	上海石化	79,900	234,107.00	0.06
455	688425	铁建重工	58,101	233,566.02	0.06
456	601808	中海油服	21,600	233,496.00	0.06
457	002670	国盛证券	21,200	233,200.00	0.06
458	600295	鄂尔多斯	21,700	232,624.00	0.05

459	600098	广州发展	38,300	226,353.00	0.05
460	000539	粤电力 A	32,200	219,282.00	0.05
461	000537	绿发电力	29,800	217,838.00	0.05
462	600808	马钢股份	86,900	217,250.00	0.05
463	688708	佳驰科技	4,263	216,560.40	0.05
464	002153	石基信息	29,700	214,731.00	0.05
465	600292	电投水电	17,400	209,496.00	0.05
466	600377	宁沪高速	17,900	207,103.00	0.05
467	601298	青岛港	25,500	205,275.00	0.05
468	603833	欧派家居	6,800	204,748.00	0.05
469	000959	首钢股份	56,300	197,613.00	0.05
470	002265	建设工业	11,300	196,620.00	0.05
471	301301	川宁生物	24,400	193,736.00	0.05
472	002608	江苏国信	27,400	189,060.00	0.04
473	600339	中油工程	61,001	187,273.07	0.04
474	603658	安图生物	6,400	185,728.00	0.04
475	603529	爱玛科技	9,500	185,345.00	0.04
476	600032	浙江新能	26,200	184,710.00	0.04
477	600606	绿地控股	152,200	184,162.00	0.04
478	600764	中国海防	10,400	181,272.00	0.04
479	000785	居然智家	90,600	181,200.00	0.04
480	601139	深圳燃气	31,300	177,158.00	0.04
481	603786	科博达	4,300	175,913.00	0.04
482	301498	乖宝宠物	4,300	174,537.00	0.04
483	688520	神州细胞集 团公司	5,012	171,460.52	0.04
484	300140	节能环境	33,900	168,483.00	0.04
485	000937	冀中能源	42,330	168,473.40	0.04
486	000898	鞍钢股份	86,900	162,503.00	0.04
487	601228	广州港	54,400	153,408.00	0.04
488	688475	萤石网络	5,595	153,023.25	0.04
489	603049	中策橡胶	3,400	152,354.00	0.04
490	603175	超颖电子	1,700	151,453.00	0.04
491	601019	山东出版	22,800	145,920.00	0.03
492	002945	华林证券	9,900	132,957.00	0.03
493	600927	永安期货	10,600	131,970.00	0.03
494	601112	振石股份	7,100	129,433.00	0.03
495	002461	珠江啤酒	16,000	121,120.00	0.03
496	600299	安迪苏	14,500	113,825.00	0.03
497	688819	天能电池集 团股份	4,835	107,337.00	0.03
498	603092	德力佳传动	1,300	70,161.00	0.02
499	001221	悍高集团	1,400	56,308.00	0.01

500	001386	马可波罗	3,800	53,808.00	0.01
-----	--------	------	-------	-----------	------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301666	大普微	323	149,655.59	0.04
2	688797	臻宝科技	101	47,335.67	0.01
3	301682	宏明电子	198	31,691.88	0.01
4	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
5	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
6	301599	理奇智能	354	11,494.38	0.00
7	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
8	001399	惠科股份	357	9,899.61	0.00
9	688820	盛合晶微	69	9,762.81	0.00
10	001393	维通利	232	9,045.68	0.00
11	001237	惠康科技	135	7,929.90	0.00
12	301680	固德电材	70	7,851.20	0.00
13	688813	泰金新能	43	7,399.87	0.00
14	688811	有研金属复材	305	7,359.65	0.00
15	301696	三瑞智能	74	6,423.20	0.00
16	301513	尚水智能	79	4,025.84	0.00
17	603435	嘉德利	61	2,849.31	0.00
18	688781	视涯科技	39	1,856.79	0.00
19	001312	福恩股份	69	1,157.82	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	688498	源杰科技	5,442,355.61	1.29
2	301308	江波龙	5,344,484.00	1.27
3	001309	德明利	5,235,220.00	1.24
4	300751	迈为股份	4,105,567.20	0.98
5	300857	协创数据	3,071,024.00	0.73

6	300136	信维通信	3,010,129.00	0.72
7	300666	江丰电子	2,806,975.00	0.67
8	300475	香农芯创	2,706,797.00	0.64
9	002850	科达利	2,686,242.00	0.64
10	300548	长芯博创	2,469,271.00	0.59
11	002353	杰瑞股份	2,384,945.00	0.57
12	300567	精测电子	2,363,630.00	0.56
13	600105	永鼎股份	2,356,472.00	0.56
14	300570	太辰光	2,297,996.00	0.55
15	300620	光库科技	2,256,377.00	0.54
16	001389	广合科技	2,202,817.00	0.52
17	002837	英维克	2,153,936.40	0.51
18	688525	佰维存储	2,087,411.51	0.50
19	601869	长飞光纤	2,069,739.00	0.49
20	002008	大族激光	2,034,197.00	0.48

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	301308	江波龙	9,008,266.00	2.14
2	600487	亨通光电	7,375,943.00	1.75
3	002353	杰瑞股份	6,259,931.00	1.49
4	688525	佰维存储	5,431,704.39	1.29
5	002156	通富微电	4,634,289.00	1.10
6	002837	英维克	4,462,454.40	1.06
7	000657	中钨高新	4,388,280.82	1.04
8	300751	迈为股份	4,342,382.00	1.03
9	000426	兴业银锡	4,219,854.00	1.00
10	002202	金风科技	4,190,670.00	1.00
11	300136	信维通信	3,715,390.00	0.88
12	300450	先导智能	3,642,444.00	0.87
13	300857	协创数据	3,595,809.00	0.85
14	000933	神火股份	3,189,203.00	0.76
15	002532	天山铝业	3,074,074.00	0.73
16	002558	巨人网络	2,949,622.00	0.70
17	002850	科达利	2,841,748.00	0.68
18	002080	中材科技	2,830,355.00	0.67
19	600549	厦门钨业	2,799,179.90	0.67
20	002008	大族激光	2,652,299.00	0.63

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	287,206,868.96
卖出股票收入（成交）总额	327,482,846.46

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	132,628.07	0.03
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	132,628.07	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118063	金 05 转债	450	77,625.54	0.02
2	113704	春风转债	550	55,002.53	0.01

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

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行投资,以降低交易成本,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,471,915.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	1,532,407.83

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

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301666	大普微	149,655.59	0.04	新股流通受限
2	688797	臻宝科技	47,335.67	0.01	新股流通受限
3	301682	宏明电子	31,691.88	0.01	新股流通受限
4	301669	高特电子	15,506.40	0.00	新股流通受限
5	301531	春光集团	14,952.40	0.00	新股流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		招商证券股份有限公司-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)	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,154	292,233.10	287,227,200.00	85.17	50,009,800.00	14.83	271,029,000.00	80.37

注: 机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 10 月 22 日）基金份额总额	237,237,000.00
本报告期期初基金份额总额	409,737,000.00
本报告期基金总申购份额	260,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	332,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	337,237,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部总经理职务，另有任用。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强担任托管部副总经理（主持工作）；2026 年 6 月 10 日，任托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

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，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无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（%）	
招商证券	6	614,210,236.99	100.00	103,320.19	100.00	

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（%）
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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关于旗下部分基金增加世纪证券为申购赎回代理券商的公告	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 12 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司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
4	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
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金公司为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 02 月 26 日
6	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
7	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
8	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
9	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
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华源证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 06 月 03 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于终止中证金牛 (北京) 基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上证报	2026 年 06 月 06 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
招商证券股份有限公司—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)	1	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	298,616,100.00	56,552,500.00	84,139,600.00	271,029,000.00	80.37
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日