

汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 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	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	62
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	62
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	62
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	62

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
§ 8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
§ 9 开放式基金份额变动.....	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	65
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.....	65
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富中证 800 指数增强	
基金主代码	017896	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 05 月 19 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	79,511,600.26	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017896	017897
报告期末下属分级基金的份 额总额(份)	27,334,464.22	52,177,136.04

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 800 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%，年跟踪误差不得超过 8.00%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；股票投资策略；港股通标的股票的投资策略；存托凭证的投资策略；债券投资策略；可转债及可交换债投资策略；资产支持证券投资策略；股指期货投资策略；国债期货投资策略；股票期权投资策略；融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证 800 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	杨军智
	联系电话	021-28932888	010-60834299
	电子邮箱	service@99fund.com	yjz@citics.com
客户服务电话		400-888-9918	010-60836588
传真		021-28932998	010-60834004
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市朝阳区亮马桥路 48 号 中信证券大厦 5 层
邮政编码		200010	100125
法定代表人		鲁伟铭	张佑君

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)	
	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C
本期已实现收益	4,470,145.25	7,585,401.14
本期利润	2,647,406.19	3,551,810.23
加权平均基金份额本期利润	0.0771	0.0547
本期加权平均净值利润率	5.77%	4.14%
本期基金份额净值增长率	3.98%	3.77%

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	9,598,745.28	17,460,245.39
期末可供分配基金份额利润	0.3512	0.3346
期末基金资产净值	36,933,209.50	69,637,381.43
期末基金份额净值	1.3512	1.3346
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	35.12%	33.46%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 800 指数增强 A						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	6.76%	1.15%	13.02%	1.27%	-6.26%	-0.12%
过去六个月	3.98%	1.09%	10.59%	1.18%	-6.61%	-0.09%
过去一年	20.54%	0.93%	31.40%	1.04%	-10.86%	-0.11%
过去三年	33.31%	1.02%	33.43%	1.12%	-0.12%	-0.10%
自基金合 同生效起 至今	35.12%	1.01%	30.05%	1.11%	5.07%	-0.10%
汇添富中证 800 指数增强 C						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	6.65%	1.15%	13.02%	1.27%	-6.37%	-0.12%

过去六个月	3.77%	1.09%	10.59%	1.18%	-6.82%	-0.09%
过去一年	20.05%	0.93%	31.40%	1.04%	-11.35%	-0.11%
过去三年	31.73%	1.02%	33.43%	1.12%	-1.70%	-0.10%
自基金合同生效起至今	33.46%	1.01%	30.05%	1.11%	3.41%	-0.10%

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800指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证800指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023 年 05 月 19 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基金经理	2023 年 05 月 19 日	—	16	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任

					汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 2 日至 2024 年 7 月 11 日任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至 2025 年 3 月 8 日任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金
--	--	--	--	--	--

					的基金经 理。2023 年 7 月 19 日至 今任汇添富 中证 500 增 强策略交易 型开放式指 数证券投资 基金的基金 经理。2023 年 11 月 14 日至今任汇 添富稳荣回 报债券型发 起式证券投 资基金的基 金经理。 2024 年 1 月 31 日至 2025 年 11 月 13 日任汇添富 稳元回报债 券型发起式 证券投资基 金的基金经 理。2024 年 3 月 28 日至 今任汇添富 稳兴回报债 券型发起式 证券投资基 金的基金经 理。2026 年 3 月 3 日至 今任汇添富 中证 A500 指 数量化增强 型证券投资 基金的基金 经理。2026 年 5 月 27 日 至今任汇添 富创业板综 合指数增强
--	--	--	--	--	--

					型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---------------

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 and 流程,公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种,以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行T检验。对于未通过T检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中国经济总体平稳、稳中趋缓，“供强需弱”格局延续，结构分化明显。一季度经济开局良好，二季度增速有所回落。生产端韧性较强，工业增加值维持较快增长，高技术制造业增势良好，新质生产力对经济增长的贡献持续提升。出口延续强势，成为上半年经济的重要支撑。投资端整体承压，固定资产投资有所下行，房地产投资仍是主要拖累，基建与制造业投资增速明显回落，高技术产业投资保持增长。消费复苏偏弱，内需不足仍是主要约束。物价温和回升，CPI 中枢逐步抬升，PPI 同比由负转正，“促进物价合理回升”的政策效果逐步显现。政策方面，财政政策保持积极取向，增量与存量工具并举支持有效投资；货币政策稳健偏宽松，年初下调结构性货币政策工具利率，并通过公开市场操作、完善短端利率框架等方式保持流动性充裕；企业端融资需求好于居民端，但信贷需求总体偏弱；产业政策持续聚焦“新质生产力”，引导金融资源向科技创新领域倾斜。海外方面，美联储暂停降息进程，年内降息预期持续降温，美债收益率维持高位，地缘政治风险边际上升，外部环境不确定性加大。

权益市场方面，报告期内 A 股震荡上行，交投活跃度维持高位，风格与结构分化显著。一季度初市场延续上年年末的活跃态势，成长动量风格涨幅较大，随后成交缩量、行情转为震荡，风格阶段性再均衡，红利、价值风格有所表现。二季度市场情绪再度走强，成长风格显著领先，价值及红利风格偏弱，资金向科技成长类资产集中，呈现极致分化格局。风格与因子方面，一季度风格轮动加快，红利与小盘成长相对占优，大盘成长承压；二季度成长、

动量、高 Beta 等因子显著占优，价值、质量、低波动、红利等逆向因子整体回撤，因子有效性随风格切换波动较大。

组合运作方面，本基金使用量化选股策略构建中证 800 指数增强组合，保持了相对均衡的因子配置，结合风险控制模型控制组合相对基准在风格、行业、个股上的偏离。上半年市场风格极致分化，组合超配的低估值、高质量、低波动风格整体表现较差，同时对科技成长类股票的配置比例不足，在风格和选股上都形成拖累，净值收益率落后于业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 800 指数增强 A 类份额净值增长率为 3.98%，同期业绩比较基准收益率为 10.59%。本报告期汇添富中证 800 指数增强 C 类份额净值增长率为 3.77%，同期业绩比较基准收益率为 10.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中国经济预计温和回升，修复斜率取决于内需政策落地效果、房地产企稳程度及外部环境变化。随着存量政策效果逐步释放、财政政策持续积极发力，内需有望边际改善；房地产市场经过数年调整，供求关系正趋于新的平衡；名义增长与微观主体感受之间的“温差”有望收窄。货币政策预计维持稳健偏宽松，结构性工具继续引导金融资源流向科技创新等重点领域。海外方面，美联储政策路径仍存不确定性，地缘政治与经贸关系的反复可能阶段性扰动市场预期。

权益市场方面，行情驱动力预计由流动性扩张逐步转向盈利验证，指数层面或维持宽幅震荡，结构性行情仍将延续。当前板块与风格间的分化已较为极致，随着基本面边际改善和盈利修复范围扩大，极致抱团的风格有望迎来均衡轮动，增量资金可能从高位板块向估值合理、基本面稳健的板块分流。成长风格仍有产业趋势支撑，但资金配置比例已处历史高位，波动将有所加大；具备稳定盈利和分红能力的高质量资产在震荡环境中仍具配置价值。选股因子方面，因子有效性有望趋于多元和均衡，盈利质量类因子的重要性可能上升。

本基金将继续基于量化模型挑选个股，保持相对中证 800 在风格和行业上的均衡配置，维持清晰和稳定的大盘均衡风格。中证 800 指数作为 A 股市场大中盘风格的代表，覆盖度高、代表性强，是投资者分享中国经济稳健增长红利的重要工具。未来将继续推进量化选股模型和风险控制模型的迭代优化，提高对市场风格变化的应对能力，提升超额收益的稳定性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

序的一贯性。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本基金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、基金份额申购赎回价格的计算以及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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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，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中证 800 指数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：汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,768,719.66	9,223,669.54
结算备付金		32,565.89	32,357.21
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	100,099,419.67	158,515,722.18
其中：股票投资		100,090,015.07	158,498,748.01
基金投资		-	-
债券投资		9,404.60	16,974.17
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		2,841,269.57	6,215,965.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		108,741,974.79	173,987,714.42

负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,965,858.01	2,358,191.76
应付管理人报酬		86,615.73	149,140.41
应付托管费		8,661.58	14,914.04
应付销售服务费		23,355.78	34,669.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	86,892.76	150,000.00
负债合计		2,171,383.86	2,706,915.65
净资产:			
实收基金	6.4.7.8	79,511,600.26	132,584,970.47
未分配利润	6.4.7.9	27,058,990.67	38,695,828.30
净资产合计		106,570,590.93	171,280,798.77
负债和净资产总计		108,741,974.79	173,987,714.42

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 79,511,600.26 份。本基金下属汇添富中证 800 指数增强 A 基金份额净值 1.3512 元，基金份额总额 27,334,464.22 份；本基金下属汇添富中证 800 指数增强 C 基金份额净值 1.3346 元，基金份额总额 52,177,136.04 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日 至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		7,170,209.82	7,685,672.76
1. 利息收入		15,619.21	36,526.07
其中：存款利息收入	6.4.7.10	15,619.21	36,526.07
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）		12,942,842.41	9,300,239.00
其中：股票投资收益	6.4.7.11	11,890,732.85	6,525,523.41
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,389.37	0.11
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,045,720.19	2,774,715.48
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	-5,856,329.97	-1,810,767.73
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	68,078.17	159,675.42
减：二、营业总支出		970,993.40	1,832,422.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	658,899.73	1,286,900.72
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	65,890.00	128,690.08
3. 销售服务费		171,819.91	335,009.08
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	74,383.76	81,822.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,199,216.42	5,853,250.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,199,216.42	5,853,250.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,199,216.42	5,853,250.02

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期		
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	132,584,970.47	38,695,828.30	171,280,798.77
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	132,584,970.47	38,695,828.30	171,280,798.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-53,073,370.21	-11,636,837.63	-64,710,207.84
（一）、综合收益总额	-	6,199,216.42	6,199,216.42
（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）	-53,073,370.21	-17,836,054.05	-70,909,424.26
其中：1. 基金申购款	323,067,628.36	104,819,402.90	427,887,031.26
2. 基金赎回款	-376,140,998.57	-122,655,456.95	-498,796,455.52
（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	79,511,600.26	27,058,990.67	106,570,590.93
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	279,739,384.35	22,821,762.87	302,561,147.22
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	279,739,384.35	22,821,762.87	302,561,147.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-95,201,437.01	-1,511,194.63	-96,712,631.64
（一）、综合收益总额	-	5,853,250.02	5,853,250.02
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-95,201,437.01	-7,364,444.65	-102,565,881.66

(净资产减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	785,150,367.99	58,656,433.98	843,806,801.97
2. 基金赎回款	-880,351,805.00	-66,020,878.63	-946,372,683.63
(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	184,537,947.34	21,310,568.24	205,848,515.58

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

基金管理人负责人

李骁

主管会计工作负责人

雷青松

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 800 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2023〕130 号文《关于准予汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 5 月 19 日生效。首次设立基金募集规模为 378,056,803.03 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 60466941_B27 号验资报告予以验证。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，基金托管人为中信证券股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露

管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

2. 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、

同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	2,081,355.61
等于：本金	2,080,980.57
加：应计利息	375.04
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	3,687,364.05
等于：本金	3,687,292.39
加：应计利息	71.66
减：坏账准备	-
合计	5,768,719.66

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		100,510,504.81	-	100,090,015.07	-420,489.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,800.00	0.48	9,404.60	1,604.12
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	7,800.00	0.48	9,404.60	1,604.12
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	100,518,304.81	0.48	100,099,419.67	-418,885.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	14,876.39
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	12,509.00
合计	86,892.76

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 800 指数增强 A		
项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,649,262.34	56,649,262.34
本期申购	19,745,074.45	19,745,074.45
本期赎回（以“-”号填列）	-49,059,872.57	-49,059,872.57
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	27,334,464.22	27,334,464.22
汇添富中证 800 指数增强 C		
项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,935,708.13	75,935,708.13
本期申购	303,322,553.91	303,322,553.91
本期赎回（以“-”号填列）	-327,081,126.00	-327,081,126.00
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	52,177,136.04	52,177,136.04

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 800 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,047,415.19	-2,079,559.22	16,967,855.97
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	19,047,415.19	-2,079,559.22	16,967,855.97
本期利润	4,470,145.25	-1,822,739.06	2,647,406.19
本期基金份额交易产生的变动数	-11,114,466.79	1,097,949.91	-10,016,516.88
其中：基金申购款	8,122,761.00	-1,340,293.86	6,782,467.14
基金赎回款	-19,237,227.79	2,438,243.77	-16,798,984.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,403,093.65	-2,804,348.37	9,598,745.28
汇添富中证 800 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,507,072.81	-2,779,100.48	21,727,972.33
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	24,507,072.81	-2,779,100.48	21,727,972.33
本期利润	7,585,401.14	-4,033,590.91	3,551,810.23
本期基金份额交易产生的变动数	-9,322,765.13	1,503,227.96	-7,819,537.17
其中：基金申购款	119,283,393.53	-21,246,457.77	98,036,935.76
基金赎回款	-128,606,158.66	22,749,685.73	-105,856,472.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,769,708.82	-5,309,463.43	17,460,245.39

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	13,594.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,776.00
结算备付金利息收入	208.68
其他	39.95
合计	15,619.21

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	291,175,389.25
减：卖出股票成本总额	279,012,897.99
减：交易费用	271,758.41
买卖股票差价收入	11,890,732.85

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,388.50
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	6,389.37

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	18,096.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,700.00
减：应计利息总额	5.90
减：交易费用	1.70
买卖债券差价收入	6,388.50

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,045,720.19
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	1,045,720.19

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	-5,856,329.97
——股票投资	-5,852,665.43
——债券投资	-3,664.54
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,856,329.97

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	68,078.17
替代损益	-
其他	-
合计	68,078.17

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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	-
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	-
合计	74,383.76

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
中信证券股份有限公司 (“中信证券”)	基金托管人, 基金销售机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
中信证券	273,735,605.31	52.90	380,234,913.51	37.98

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		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
中信证券	13,473.70	74.46	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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（%）
中信证券	49,469.54	53.21	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中信证券	69,083.71	38.02	-	-

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	658,899.73	1,286,900.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	269,197.80	514,843.73
应支付基金管理人的净管理费	389,701.93	772,056.99

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核

对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	65,890.00	128,690.08

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 800 指数 增强 A	汇添富中证 800 指数 增强 C	合计
东方证券股份有限公司	-	762.25	762.25
汇添富基金管理股份有限公司	-	2,553.51	2,553.51
中信证券股份有限公司	-	101,911.93	101,911.93

合计	-	105,227.69	105,227.69
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 800 指数 增强 A	汇添富中证 800 指数 增强 C	合计
东方证券股份有限公司	-	1,142.00	1,142.00
汇添富基金管理股份有限公司	-	2,506.86	2,506.86
中信证券股份有限公司	-	193,740.06	193,740.06
合计	-	197,388.92	197,388.92

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限

费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券	3,332,269.56	1,469.84	6,294,203.11	5,410.38

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
00122	世盟	2026	6 个	新股	28.00	27.78	43	1,204	1,194	

0	股份	年 01 月 27 日	月	流通受限				.00	.54	
301680	固德电材	2026 年 02 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	45	2,610.00	5,047.20	
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	127	8,846.82	20,327.62	
301696	三瑞智能	2026 年 03 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	88	2,171.84	7,638.40	
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	153	1,710.54	2,691.27	
603284	林平发展	2026 年 02 月 03 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	31	1,174.28	1,080.97	
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	25	837.25	848.25	
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	58	1,269.04	1,480.16	
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	85	1,178.10	6,244.10	
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	52	819.52	2,428.92	
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	91	1,610.70	7,673.12	
68871	北芯	2026	6 个	新股	17.52	35.92	105	1,839	3,771	

2	生命	年 01 月 28 日	月	流通 受限				. 60	. 60	
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	6 个 月	新股 流通 受限	22. 68	47. 61	44	997. 9 2	2, 094 . 84	
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. 0 0	100. 0 0	50	5, 000 . 00	5, 000 . 23	

6. 4. 12. 2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 （股 ）	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大 事项 停牌	879. 5 3	2026 年 07 月 13 日	890. 9 9	300	202, 2 00. 00	263, 8 59. 00	

6. 4. 12. 3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6. 4. 12. 3. 1 银行间市场债券正回购

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

6. 4. 12. 3. 2 交易所市场债券正回购

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

6. 4. 12. 4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6. 4. 13 金融工具风险及管理

6. 4. 13. 1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,768,719.66	-	-	-	-	-	5,768,719.66
结算备付金	32,565.89	-	-	-	-	-	32,565.89
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	9,404.60	-	-	100,090,015.07	100,099,419.67
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	-	-	-	-	-	2,841,269.57	2,841,269.57
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,801,285.55	-	9,404.60	-	-	102,931,284.64	108,741,974.79
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	-	-	-	-	-	1,965,858.01	1,965,858.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	86,615.73	86,615.73
应付托管费	-	-	-	-	-	8,661.58	8,661.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	23,355.78	23,355.78
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	-	-	-	-	-	86,892.76	86,892.76
负债总计	-	-	-	-	-	2,171,383.86	2,171,383.86
利率敏感度缺口	5,801,285.55	-	9,404.60	-	-	100,759,900.78	106,570,590.93

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	9,223,66 9.54	-	-	-	-	-	9,223,66 9.54
结算备付 金	32,357.2 1	-	-	-	-	-	32,357.2 1
存出保证 金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金 融资产	16,974.1 7	-	-	-	-	158,498, 748.01	158,515, 722.18
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	-	-	-	-	-	6,215,96 5.49	6,215,96 5.49
递延所得 税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,273,00 0.92	-	-	-	-	164,714, 713.50	173,987, 714.42
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	-	-	-	-	-	2,358,19 1.76	2,358,19 1.76
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	149,140. 41	149,140. 41

应付托管费	-	-	-	-	-	14,914.04	14,914.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	34,669.44	34,669.44
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	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,706,915.65	2,706,915.65
利率敏感度缺口	9,273,000.92	-	-	-	-	162,007,797.85	171,280,798.77

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	100,090,015.07	93.92	158,498,748.01	92.54

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,404.60	0.01	16,974.17	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	100,099,419.67	93.93	158,515,722.18	92.55

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 800 指数上涨 5%	4,582,413.24	7,227,297.32
	中证 800 指数下跌 5%	-4,582,413.24	-7,227,297.32

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	99,768,039.45
第二层次	268,859.23
第三层次	62,520.99
合计	100,099,419.67

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	100,090,015.07	92.04
	其中：股票	100,090,015.07	92.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,404.60	0.01
	其中：债券	9,404.60	0.01
	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	5,801,285.55	5.33
8	其他各项资产	2,841,269.57	2.61
9	合计	108,741,974.79	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	232,141.00	0.22
B	采矿业	4,835,422.80	4.54
C	制造业	57,999,251.63	54.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,448,134.00	2.30
E	建筑业	197,377.00	0.19
F	批发和零售业	317,878.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	645,021.00	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,450,429.90	5.11
J	金融业	12,168,708.00	11.42
K	房地产业	10,676.00	0.01
L	租赁和商务服务业	422,420.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	926,588.00	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	4,970.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	30,072.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	12,782.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	85,701,871.33	80.42

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	71,344.00	0.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,999,147.20	10.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	183,890.00	0.17
E	建筑业	82,566.00	0.08
F	批发和零售业	377,341.00	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	160,243.54	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,605,188.00	1.51
J	金融业	106,780.00	0.10
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	164,653.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	465,111.00	0.44
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	109,800.00	0.10
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	62,080.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	14,388,143.74	13.50

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	3,000	3,810,000.00	3.58
2	300750	宁德时代	7,960	3,128,359.60	2.94
3	600519	贵州茅台	1,700	2,015,333.00	1.89

4	300502	新易盛	3,008	1,825,856.0 0	1.71
5	601318	中国平安	35,800	1,709,092.0 0	1.60
6	601899	紫金矿业	58,000	1,458,120.0 0	1.37
7	002371	北方华创	1,590	1,406,450.4 0	1.32
8	002475	立讯精密	19,400	1,365,760.0 0	1.28
9	000333	美的集团	17,750	1,340,657.5 0	1.26
10	603986	兆易创新	1,500	1,222,500.0 0	1.15
11	688012	中微半导体 设备	2,386	1,117,841.0 0	1.05
12	600036	招商银行	30,900	1,096,950.0 0	1.03
13	601166	兴业银行	61,700	1,021,752.0 0	0.96
14	688041	海光信息	2,400	888,720.00	0.83
15	600900	长江电力	33,400	884,098.00	0.83
16	601138	工业富联	11,800	851,370.00	0.80
17	688981	中芯国际	5,283	839,046.06	0.79
18	688008	澜起科技	2,700	836,730.00	0.79
19	688256	寒武纪科技	498	794,583.90	0.75
20	300476	胜宏科技	2,200	762,146.00	0.72
21	002415	海康威视	22,100	755,820.00	0.71
22	600276	恒瑞医药	13,700	712,948.00	0.67
23	000792	盐湖股份	22,600	682,294.00	0.64
24	600031	三一重工	38,600	667,008.00	0.63
25	600406	国电南瑞	28,400	648,940.00	0.61
26	603259	药明康德	5,200	647,452.00	0.61
27	601601	中国太保	22,600	644,552.00	0.60
28	601088	中国神华	16,400	640,256.00	0.60
29	002384	东山精密	2,300	603,405.00	0.57
30	002916	深南电路	1,300	595,270.00	0.56
31	600309	万华化学	8,600	588,326.00	0.55
32	688002	睿创微纳	3,791	586,429.79	0.55
33	600919	江苏银行	54,300	585,354.00	0.55
34	601688	华泰证券	28,100	579,422.00	0.54
35	300274	阳光电源	3,600	572,472.00	0.54
36	603799	华友钴业	11,800	569,468.00	0.53

37	000425	徐工机械	70,200	567,918.00	0.53
38	600150	中国船舶	16,300	550,777.00	0.52
39	603993	洛阳钼业	31,300	549,315.00	0.52
40	601211	国泰海通	30,000	546,000.00	0.51
41	600489	中金黄金	29,200	527,060.00	0.49
42	002273	水晶光电	14,500	514,460.00	0.48
43	600887	伊利股份	21,400	512,744.00	0.48
44	601727	上海电气	72,800	509,600.00	0.48
45	002463	沪电股份	3,300	504,240.00	0.47
46	000807	云铝股份	22,700	502,578.00	0.47
47	600795	国电电力	105,200	491,284.00	0.46
48	601728	中国电信	91,200	473,328.00	0.44
49	601398	工商银行	66,400	469,448.00	0.44
50	600183	生益科技	2,700	468,180.00	0.44
51	002600	领益智造	26,500	459,510.00	0.43
52	601360	三六零	51,800	450,142.00	0.42
53	300014	亿纬锂能	6,700	435,701.00	0.41
54	300458	全志科技	10,900	430,114.00	0.40
55	688728	格科微有限公司	20,335	427,848.40	0.40
56	600941	中国移动	4,900	422,037.00	0.40
57	000338	潍柴动力	15,300	416,925.00	0.39
58	300623	捷捷微电	9,200	413,908.00	0.39
59	600660	福耀玻璃	8,200	413,608.00	0.39
60	002414	高德红外	31,100	412,386.00	0.39
61	000166	申万宏源	93,500	411,400.00	0.39
62	600050	中国联通	102,800	411,200.00	0.39
63	601877	正泰电器	16,300	408,641.00	0.38
64	000423	东阿阿胶	8,700	394,632.00	0.37
65	000895	双汇发展	17,600	394,240.00	0.37
66	300699	光威复材	13,500	386,775.00	0.36
67	002065	东华软件	54,100	386,274.00	0.36
68	002027	分众传媒	79,300	383,812.00	0.36
69	002532	天山铝业	35,400	379,842.00	0.36
70	600741	华域汽车	24,300	377,136.00	0.35
71	600061	国投资本	56,800	372,040.00	0.35
72	002340	格林美	55,100	364,211.00	0.34
73	002402	和而泰	14,100	364,203.00	0.34
74	600690	海尔智家	17,800	363,298.00	0.34
75	002517	恺英网络	21,800	354,250.00	0.33
76	000538	云南白药	7,400	350,538.00	0.33
77	601018	宁波港	109,900	346,185.00	0.32
78	000725	京东方 A	39,700	344,596.00	0.32

79	002152	广电运通	36,700	344,246.00	0.32
80	600685	中船防务	13,500	343,440.00	0.32
81	000683	博源化工	59,500	342,720.00	0.32
82	601600	中国铝业	41,100	337,842.00	0.32
83	600111	北方稀土	6,900	331,545.00	0.31
84	600132	重庆啤酒	8,000	330,400.00	0.31
85	300627	华测导航	11,500	326,600.00	0.31
86	688475	萤石网络	11,800	322,730.00	0.30
87	300059	东方财富	15,800	322,004.00	0.30
88	600884	杉杉股份	22,900	310,295.00	0.29
89	601628	中国人寿	8,600	304,010.00	0.29
90	002236	大华股份	18,300	301,767.00	0.28
91	600460	士兰微	5,500	300,630.00	0.28
92	300408	三环集团	1,800	300,420.00	0.28
93	601288	农业银行	49,200	298,644.00	0.28
94	603501	豪威集团	3,100	294,035.00	0.28
95	601766	中国中车	54,300	282,360.00	0.26
96	000100	TCL 科技	48,500	282,270.00	0.26
97	601328	交通银行	43,200	277,776.00	0.26
98	002602	世纪华通	19,500	274,950.00	0.26
99	601857	中国石油	31,600	274,288.00	0.26
100	300223	北京君正	1,100	273,790.00	0.26
101	300394	天孚通信	900	272,412.00	0.26
102	002241	歌尔股份	11,900	268,107.00	0.25
103	600845	宝信软件	15,900	264,417.00	0.25
104	688072	拓荆科技	300	263,859.00	0.25
105	601788	光大证券	18,200	262,626.00	0.25
106	600176	中国巨石	3,600	262,368.00	0.25
107	600886	国投电力	19,600	260,876.00	0.24
108	601898	中煤能源	21,100	256,998.00	0.24
109	603858	步长制药	17,600	256,960.00	0.24
110	002078	太阳纸业	20,400	254,796.00	0.24
111	600499	科达制造	18,400	253,920.00	0.24
112	002493	荣盛石化	23,200	249,400.00	0.23
113	000001	平安银行	24,000	241,200.00	0.23
114	600885	宏发股份	6,980	240,740.20	0.23
115	603160	汇顶科技	3,900	240,669.00	0.23
116	300012	华测检测	16,800	232,848.00	0.22
117	000975	山金国际	13,200	224,400.00	0.21
118	000027	深圳能源	35,200	218,240.00	0.20
119	601100	恒立液压	2,000	215,120.00	0.20
120	688396	华润微电子	2,200	214,610.00	0.20
121	000651	格力电器	5,600	210,000.00	0.20

122	601225	陕西煤业	10,200	207,570.00	0.19
123	603893	瑞芯微	1,100	207,196.00	0.19
124	300604	长川科技	600	204,852.00	0.19
125	601881	中国银河	16,000	201,120.00	0.19
126	001286	陕西能源	19,800	200,772.00	0.19
127	300628	亿联网络	5,800	196,156.00	0.18
128	002410	广联达	24,000	195,840.00	0.18
129	000776	广发证券	8,300	194,220.00	0.18
130	600372	中航机载	17,800	193,130.00	0.18
131	001309	德明利	200	188,580.00	0.18
132	002049	紫光国微	2,100	186,375.00	0.17
133	002594	比亚迪	2,300	183,310.00	0.17
134	603019	中科曙光	1,700	182,291.00	0.17
135	301536	星宸科技	1,400	180,194.00	0.17
136	000063	中兴通讯	4,800	173,712.00	0.16
137	600089	特变电工	7,700	173,250.00	0.16
138	300124	汇川技术	2,600	172,458.00	0.16
139	002444	巨星科技	5,500	171,050.00	0.16
140	688347	华虹宏力半 导体	500	168,150.00	0.16
141	603298	杭叉集团	6,900	164,634.00	0.15
142	601319	中国人保	24,100	162,916.00	0.15
143	601009	南京银行	16,200	160,218.00	0.15
144	600801	华新建材	9,800	152,880.00	0.14
145	300475	香农芯创	500	150,000.00	0.14
146	688521	芯原微电子	400	148,456.00	0.14
147	000408	藏格矿业	2,100	145,572.00	0.14
148	000157	中联重科	20,600	143,582.00	0.13
149	300373	扬杰科技	900	141,507.00	0.13
150	000009	中国宝安	22,400	139,552.00	0.13
151	601818	光大银行	48,200	139,298.00	0.13
152	601216	君正集团	30,900	137,814.00	0.13
153	600598	北大荒	12,700	137,668.00	0.13
154	300857	协创数据	400	135,960.00	0.13
155	601668	中国建筑	31,300	135,842.00	0.13
156	600028	中国石化	30,400	135,584.00	0.13
157	600584	长电科技	1,300	134,615.00	0.13
158	688563	航空材料股 份	2,600	133,198.00	0.12
159	603288	海天味业	4,000	132,640.00	0.12
160	002142	宁波银行	4,400	130,636.00	0.12
161	300054	鼎龙股份	1,200	127,164.00	0.12
162	601336	新华保险	2,100	125,286.00	0.12

163	600711	盛屯矿业	11,100	121,767.00	0.11
164	688385	复旦微电	1,700	121,193.00	0.11
165	002008	大族激光	800	120,088.00	0.11
166	603659	璞泰来	4,100	118,613.00	0.11
167	601377	兴业证券	19,300	116,572.00	0.11
168	600171	上海贝岭	3,600	114,984.00	0.11
169	002500	山西证券	21,900	113,004.00	0.11
170	000988	华工科技	600	110,766.00	0.10
171	601058	赛轮轮胎	9,500	109,535.00	0.10
172	000021	深科技	1,700	109,259.00	0.10
173	600522	中天科技	1,800	109,224.00	0.10
174	600547	山东黄金	4,700	108,523.00	0.10
175	601995	中金公司	3,000	108,450.00	0.10
176	600098	广州发展	18,200	107,562.00	0.10
177	603444	吉比特	300	107,526.00	0.10
178	300395	菲利华	800	106,984.00	0.10
179	600562	国睿科技	5,000	106,100.00	0.10
180	002938	鹏鼎控股	1,000	105,380.00	0.10
181	600019	宝钢股份	19,217	104,348.31	0.10
182	002028	思源电气	600	103,800.00	0.10
183	002352	顺丰控股	3,300	103,158.00	0.10
184	002281	光迅科技	400	102,776.00	0.10
185	603129	春风动力	400	102,320.00	0.10
186	601985	中国核电	11,200	101,136.00	0.09
187	002261	拓维信息	3,400	95,234.00	0.09
188	002850	科达利	500	94,650.00	0.09
189	002714	牧原股份	2,700	94,473.00	0.09
190	600938	中国海油	3,400	92,310.00	0.09
191	002202	金风科技	3,800	90,820.00	0.09
192	600160	巨化股份	1,700	90,117.00	0.08
193	000963	华东医药	3,100	87,172.00	0.08
194	600000	浦发银行	10,100	86,961.00	0.08
195	603606	东方电缆	2,080	86,340.80	0.08
196	688361	中科飞测	200	86,000.00	0.08
197	688111	金山办公	400	85,220.00	0.08
198	601658	邮储银行	17,200	84,796.00	0.08
199	601939	建设银行	8,800	84,744.00	0.08
200	300136	信维通信	700	83,475.00	0.08
201	603296	华勤技术	1,120	83,182.40	0.08
202	300919	中伟新材	1,900	83,125.00	0.08
203	600570	恒生电子	3,900	82,641.00	0.08
204	601555	东吴证券	10,300	81,576.00	0.08
205	600926	杭州银行	5,600	80,920.00	0.08

206	600369	西南证券	19,800	79,596.00	0.07
207	601919	中远海控	5,900	78,234.00	0.07
208	688702	盛科通信	200	77,998.00	0.07
209	000938	紫光股份	2,700	77,922.00	0.07
210	601988	中国银行	13,400	76,648.00	0.07
211	601608	中信重工	16,000	76,320.00	0.07
212	002353	杰瑞股份	500	76,250.00	0.07
213	300620	光库科技	200	75,640.00	0.07
214	300390	天华新能	800	74,808.00	0.07
215	600875	东方电气	2,600	74,802.00	0.07
216	002050	三花智控	1,700	74,511.00	0.07
217	300346	南大光电	800	74,120.00	0.07
218	688469	芯联集成	6,900	73,209.00	0.07
219	688778	厦钨新能源	1,300	70,720.00	0.07
220	301308	江波龙	100	70,380.00	0.07
221	600999	招商证券	3,300	69,630.00	0.07
222	600893	航发动力	1,800	69,012.00	0.06
223	600298	安琪酵母	1,900	68,780.00	0.06
224	600988	赤峰黄金	2,500	65,800.00	0.06
225	688578	艾力斯医药 科技	600	65,520.00	0.06
226	300037	新宙邦	700	64,995.00	0.06
227	600585	海螺水泥	3,800	64,410.00	0.06
228	300033	同花顺	260	62,660.00	0.06
229	000617	中油资本	9,500	62,605.00	0.06
230	601077	渝农商行	10,200	62,322.00	0.06
231	000513	丽珠集团	2,100	60,669.00	0.06
232	002001	新 和 成	2,100	59,682.00	0.06
233	600109	国金证券	6,600	57,948.00	0.05
234	601816	京沪高铁	12,700	57,531.00	0.05
235	300661	圣邦股份	400	57,392.00	0.05
236	002773	康弘药业	2,800	57,260.00	0.05
237	601878	浙商证券	6,000	57,000.00	0.05
238	002709	天赐材料	1,100	56,573.00	0.05
239	600352	浙江龙盛	4,600	55,706.00	0.05
240	000737	北方铜业	4,200	55,524.00	0.05
241	002466	天齐锂业	900	55,188.00	0.05
242	300760	迈瑞医疗	400	54,332.00	0.05
243	002311	海大集团	1,200	53,532.00	0.05
244	002812	恩捷股份	800	53,528.00	0.05
245	003816	中国广核	13,600	53,176.00	0.05
246	300115	长盈精密	1,900	53,086.00	0.05
247	300073	当升科技	1,100	52,844.00	0.05

248	600482	中国动力	1,601	52,512.80	0.05
249	600015	华夏银行	8,200	52,398.00	0.05
250	002926	华西证券	6,400	52,288.00	0.05
251	300432	富临精工	2,600	52,234.00	0.05
252	600346	恒力石化	2,900	51,359.00	0.05
253	688235	百济神州	200	50,922.00	0.05
254	688676	海南金盘智能科技	600	50,784.00	0.05
255	601012	隆基绿能	3,700	48,544.00	0.05
256	001389	广合科技	200	47,450.00	0.04
257	600989	宝丰能源	2,300	46,759.00	0.04
258	300759	康龙化成	1,600	46,288.00	0.04
259	600188	兖矿能源	2,600	46,202.00	0.04
260	600066	宇通客车	1,700	45,577.00	0.04
261	002130	沃尔核材	2,400	45,504.00	0.04
262	600862	中航高科	2,500	45,075.00	0.04
263	000831	中国稀土	800	44,392.00	0.04
264	600601	方正科技	3,200	44,288.00	0.04
265	603233	大参林	2,900	43,587.00	0.04
266	000301	东方盛虹	3,800	43,510.00	0.04
267	600426	华鲁恒升	1,800	43,056.00	0.04
268	600196	复星医药	1,900	42,693.00	0.04
269	000977	浪潮信息	600	42,000.00	0.04
270	000768	中航西飞	2,000	40,960.00	0.04
271	300450	先导智能	1,000	40,720.00	0.04
272	002487	大金重工	700	40,579.00	0.04
273	000999	华润三九	1,790	40,257.10	0.04
274	000937	冀中能源	10,060	40,038.80	0.04
275	000708	中信特钢	3,100	39,122.00	0.04
276	600415	小商品城	3,800	38,608.00	0.04
277	300433	蓝思科技	700	37,562.00	0.04
278	000858	五粮液	500	37,000.00	0.03
279	300666	江丰电子	100	36,860.00	0.03
280	000729	燕京啤酒	3,600	36,468.00	0.03
281	688617	惠泰医疗	200	36,312.00	0.03
282	601698	中国卫通	1,200	36,300.00	0.03
283	002064	华峰化学	3,700	35,113.00	0.03
284	600918	中泰证券	6,400	34,048.00	0.03
285	601689	拓普集团	600	33,852.00	0.03
286	603816	顾家家居	1,500	33,540.00	0.03
287	002736	国信证券	3,300	32,967.00	0.03
288	002945	华林证券	2,400	32,232.00	0.03
289	600039	四川路桥	4,100	32,062.00	0.03

290	002299	圣农发展	2,100	31,836.00	0.03
291	601577	长沙银行	3,600	31,356.00	0.03
292	600600	青岛啤酒	600	31,338.00	0.03
293	601901	方正证券	4,200	30,240.00	0.03
294	600901	江苏金租	5,200	29,900.00	0.03
295	603766	隆鑫通用	2,500	29,825.00	0.03
296	300454	深信服	300	28,860.00	0.03
297	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.03
298	300748	金力永磁	900	27,765.00	0.03
299	600085	同仁堂	1,200	27,732.00	0.03
300	000786	北新建材	1,500	27,135.00	0.03
301	600105	永鼎股份	400	26,992.00	0.03
302	603256	宏和科技	100	26,533.00	0.02
303	002155	湖南黄金	1,100	26,257.00	0.02
304	600027	华电国际	5,900	26,255.00	0.02
305	000728	国元证券	3,500	26,215.00	0.02
306	002460	赣锋锂业	400	26,160.00	0.02
307	000400	许继电气	1,200	26,040.00	0.02
308	600362	江西铜业	600	25,980.00	0.02
309	603699	纽威股份	500	25,150.00	0.02
310	000750	国海证券	6,800	25,024.00	0.02
311	300442	润泽科技	300	24,921.00	0.02
312	600025	华能水电	2,800	24,892.00	0.02
313	000623	吉林敖东	1,400	24,822.00	0.02
314	600642	申能股份	2,800	24,444.00	0.02
315	301606	绿联科技	400	24,408.00	0.02
316	002673	西部证券	3,700	24,013.00	0.02
317	601390	中国中铁	5,700	23,769.00	0.02
318	600803	新奥股份	1,500	23,700.00	0.02
319	688777	中控技术	200	23,500.00	0.02
320	002683	广东宏大	800	23,432.00	0.02
321	000568	泸州老窖	300	23,256.00	0.02
322	600312	平高电气	1,300	22,958.00	0.02
323	688213	思特威电子科技	200	21,414.00	0.02
324	600018	上港集团	4,500	21,240.00	0.02
325	600348	华阳股份	2,700	20,655.00	0.02
326	002032	苏泊尔	500	19,800.00	0.02
327	603939	益丰药房	1,100	19,778.00	0.02
328	600016	民生银行	6,000	19,320.00	0.02
329	300999	金龙鱼	800	18,608.00	0.02
330	300496	中科创达	300	18,537.00	0.02
331	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.02

332	600483	福能股份	1,700	17,323.00	0.02
333	603338	浙江鼎力	400	17,000.00	0.02
334	603737	三棵树	700	16,870.00	0.02
335	002851	麦格米特	100	16,718.00	0.02
336	002939	长城证券	2,000	16,680.00	0.02
337	300015	爱尔眼科	2,000	16,520.00	0.02
338	000932	华菱钢铁	4,300	14,921.00	0.01
339	601059	信达证券	900	14,571.00	0.01
340	000155	川能动力	1,200	14,376.00	0.01
341	600765	中航重机	1,100	14,212.00	0.01
342	600390	五矿资本	3,100	14,136.00	0.01
343	600380	健康元	1,500	14,130.00	0.01
344	601136	首创证券	1,000	13,950.00	0.01
345	601198	东兴证券	1,000	13,590.00	0.01
346	600763	通策医疗	400	13,552.00	0.01
347	000739	普洛药业	800	13,328.00	0.01
348	600967	内蒙一机	1,200	13,020.00	0.01
349	601233	桐昆股份	600	12,990.00	0.01
350	300144	宋城演艺	2,200	12,782.00	0.01
351	601880	辽港股份	9,200	12,696.00	0.01
352	603308	应流股份	200	12,080.00	0.01
353	600602	云赛智联	700	11,256.00	0.01
354	601916	浙商银行	4,100	10,783.00	0.01
355	600663	陆家嘴	1,700	10,676.00	0.01
356	300285	国瓷材料	100	10,318.00	0.01
357	002126	银轮股份	200	9,960.00	0.01
358	601228	广州港	3,500	9,870.00	0.01
359	002648	卫星化学	400	9,396.00	0.01
360	000983	山西焦煤	1,600	9,280.00	0.01
361	601298	青岛港	1,100	8,855.00	0.01
362	600295	鄂尔多斯	800	8,576.00	0.01
363	002230	科大讯飞	200	8,168.00	0.01
364	601808	中海油服	700	7,567.00	0.01
365	002138	顺络电子	100	7,310.00	0.01
366	600029	南方航空	1,400	7,252.00	0.01
367	601099	太平洋	2,100	7,077.00	0.01
368	600764	中国海防	400	6,972.00	0.01
369	002841	视源股份	200	6,906.00	0.01
370	688009	中国通号	1,400	6,664.00	0.01
371	000630	铜陵有色	1,000	6,360.00	0.01
372	601825	沪农商行	800	5,992.00	0.01
373	002508	老板电器	400	5,848.00	0.01
374	600970	中材国际	800	5,704.00	0.01

375	300140	节能环保	1,000	4,970.00	0.00
376	603000	人民网	300	4,437.00	0.00
377	603658	安图生物	100	2,902.00	0.00
378	601112	振石股份	153	2,691.27	0.00
379	601169	北京银行	200	980.00	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	300127	银河磁体	10,900	304,655.00	0.29
2	002090	金智科技	33,100	292,604.00	0.27
3	002017	东信和平	20,000	292,600.00	0.27
4	002349	精华制药	46,400	288,144.00	0.27
5	002651	利君股份	39,000	285,090.00	0.27
6	301339	通行宝	27,000	276,210.00	0.26
7	688128	中国电器研 究院	11,477	272,463.98	0.26
8	301289	国缆检测	5,700	267,957.00	0.25
9	300722	新余国科	11,600	258,680.00	0.24
10	002516	旷达科技	45,600	254,448.00	0.24
11	600267	海正药业	25,100	253,761.00	0.24
12	002338	奥普光电	4,400	251,680.00	0.24
13	300493	润欣科技	16,800	250,488.00	0.24
14	002690	美亚光电	16,000	229,280.00	0.22
15	600479	千金药业	24,300	225,990.00	0.21
16	688110	东芯股份	1,100	224,070.00	0.21
17	000045	深纺织 A	21,200	223,448.00	0.21
18	605118	力鼎光电	6,400	223,296.00	0.21
19	002454	松芝股份	46,480	222,174.40	0.21
20	603025	大豪科技	15,900	216,876.00	0.20
21	688522	纳睿雷达科 技	10,400	208,208.00	0.20
22	300414	中光防雷	17,700	195,054.00	0.18
23	300701	森霸传感	20,300	194,271.00	0.18
24	300613	富瀚微	2,400	192,192.00	0.18
25	600558	大西洋	38,600	190,684.00	0.18
26	688279	峰岬科技	800	179,552.00	0.17
27	300847	中船汉光	13,800	178,572.00	0.17

28	002077	大港股份	9,200	177,468.00	0.17
29	600526	菲达环保	42,000	172,620.00	0.16
30	000795	英洛华	19,800	171,270.00	0.16
31	301019	宁波色母	9,600	171,168.00	0.16
32	600210	紫江企业	27,300	169,260.00	0.16
33	688100	威胜信息	5,500	168,245.00	0.16
34	301299	卓创资讯	3,700	163,022.00	0.15
35	002004	华邦健康	40,600	159,558.00	0.15
36	000650	仁和药业	31,000	157,790.00	0.15
37	300563	神宇股份	5,500	156,145.00	0.15
38	002593	日上集团	38,800	154,812.00	0.15
39	605005	合兴股份	9,700	153,357.00	0.14
40	300678	中科信息	6,500	145,600.00	0.14
41	002576	通达动力	10,200	144,330.00	0.14
42	300512	中亚股份	21,100	143,902.00	0.14
43	601326	秦港股份	44,300	139,988.00	0.13
44	600288	大恒科技	10,400	138,320.00	0.13
45	002953	日丰股份	15,200	132,544.00	0.12
46	603648	畅联股份	15,200	130,416.00	0.12
47	300079	数码视讯	30,200	126,840.00	0.12
48	688230	芯导科技	1,600	126,096.00	0.12
49	603268	松发股份	900	125,352.00	0.12
50	603235	天新药业	5,500	122,375.00	0.11
51	688049	炬芯科技	2,500	117,275.00	0.11
52	600640	国脉文化	11,900	115,073.00	0.11
53	603987	康德莱	16,600	114,540.00	0.11
54	003015	日久光电	8,600	112,058.00	0.11
55	600455	博通股份	5,000	109,800.00	0.10
56	603927	中科软	8,500	108,035.00	0.10
57	301508	中机认检	4,500	104,130.00	0.10
58	605277	新亚电子	5,280	100,636.80	0.09
59	301223	中荣股份	6,200	99,944.00	0.09
60	600506	统一股份	7,000	97,230.00	0.09
61	002287	奇正藏药	4,900	92,316.00	0.09
62	001236	弘业期货	12,800	88,960.00	0.08
63	603013	亚普股份	5,300	83,687.00	0.08
64	301359	东南电子	5,200	82,576.00	0.08
65	002163	海南发展	9,900	82,566.00	0.08
66	600725	云维股份	26,500	81,885.00	0.08
67	002275	桂林三金	6,600	80,454.00	0.08
68	301202	朗威股份	2,400	79,992.00	0.08
69	300098	高新兴	17,300	79,407.00	0.07
70	301386	未来电器	3,700	76,257.00	0.07

71	301156	美农生物	6,970	75,763.90	0.07
72	300299	富春股份	15,200	74,480.00	0.07
73	301167	建研设计	6,000	74,340.00	0.07
74	300034	钢研高纳	4,200	71,988.00	0.07
75	002942	新农股份	4,800	68,784.00	0.06
76	301059	金三江	6,000	66,540.00	0.06
77	300008	天海防务	10,700	64,842.00	0.06
78	002296	辉煌科技	7,200	63,936.00	0.06
79	301025	读客文化	8,000	62,080.00	0.06
80	300050	世纪鼎利	10,400	61,568.00	0.06
81	300645	正元智慧	4,800	56,496.00	0.05
82	600354	敦煌种业	11,800	56,168.00	0.05
83	688616	西力科技	5,300	53,530.00	0.05
84	003039	顺控发展	4,800	52,848.00	0.05
85	300172	中电环保	12,700	52,451.00	0.05
86	301048	金鹰重工	6,000	51,660.00	0.05
87	000049	德赛电池	2,100	49,077.00	0.05
88	300306	远方信息	4,900	47,530.00	0.04
89	603638	艾迪精密	1,900	44,555.00	0.04
90	603111	康尼机电	7,800	44,148.00	0.04
91	001218	丽臣实业	1,900	41,914.00	0.04
92	601218	吉鑫科技	9,600	41,280.00	0.04
93	002749	国光股份	5,140	41,017.20	0.04
94	300047	天源迪科	4,500	39,960.00	0.04
95	002817	黄山胶囊	6,800	39,848.00	0.04
96	002383	合众思壮	5,700	38,703.00	0.04
97	603006	联明股份	2,600	37,050.00	0.03
98	603053	成都燃气	4,400	36,784.00	0.03
99	300771	智莱科技	3,500	36,120.00	0.03
100	603107	上海汽配	3,100	35,185.00	0.03
101	002401	中远海科	3,000	34,830.00	0.03
102	000676	智度股份	6,700	34,237.00	0.03
103	300447	全信股份	2,200	32,846.00	0.03
104	300629	新劲刚	1,500	32,190.00	0.03
105	002925	盈趣科技	1,300	32,058.00	0.03
106	603551	奥普科技	3,400	30,566.00	0.03
107	000419	通程控股	6,700	30,217.00	0.03
108	300515	三德科技	2,300	30,015.00	0.03
109	600099	林海股份	3,700	29,526.00	0.03
110	002095	生意宝	2,300	29,440.00	0.03
111	003016	欣贺股份	4,800	29,424.00	0.03
112	603817	海峡环保	5,300	27,083.00	0.03
113	300987	川网传媒	2,200	27,060.00	0.03

114	002107	沃华医药	4,700	26,743.00	0.03
115	603948	建业股份	1,100	26,510.00	0.02
116	002917	金奥博	2,500	26,350.00	0.02
117	300823	建科智能	1,700	24,786.00	0.02
118	688395	深圳正弦电 气股份	1,100	24,310.00	0.02
119	300962	中金辐照	1,900	23,750.00	0.02
120	603508	思维列控	1,000	21,360.00	0.02
121	301682	宏明电子	127	20,327.62	0.02
122	002239	奥特佳	8,000	19,760.00	0.02
123	300134	大富科技	2,300	19,665.00	0.02
124	301329	信音电子	800	19,432.00	0.02
125	600717	天津港	4,900	19,061.00	0.02
126	301215	中汽股份	3,600	18,684.00	0.02
127	300698	万马科技	600	16,320.00	0.02
128	301353	普莱得	900	14,949.00	0.01
129	300717	华信新材	700	14,910.00	0.01
130	601368	绿城水务	3,600	14,724.00	0.01
131	000933	神火股份	600	12,720.00	0.01
132	600318	新力金融	2,100	12,642.00	0.01
133	301388	欣灵电气	500	11,660.00	0.01
134	300101	振芯科技	700	11,319.00	0.01
135	300817	双飞集团	700	10,920.00	0.01
136	300978	东箭科技	1,300	10,543.00	0.01
137	603172	浙江万丰股 份	600	9,858.00	0.01
138	001378	德冠新材	530	9,492.30	0.01
139	600778	友好集团	1,900	9,291.00	0.01
140	002069	獐子岛	3,100	9,114.00	0.01
141	603079	圣达生物	800	9,056.00	0.01
142	600148	长春一东	600	8,706.00	0.01
143	600993	马应龙	400	8,648.00	0.01
144	300045	华力创通	500	8,620.00	0.01
145	002985	北摩高科	300	8,310.00	0.01
146	688805	健信超导	176	8,266.72	0.01
147	603459	红板科技	91	7,673.12	0.01
148	301696	三瑞智能	88	7,638.40	0.01
149	300971	博亚精工	400	7,464.00	0.01
150	603407	长裕集团	85	6,244.10	0.01
151	300075	数字政通	600	6,132.00	0.01
152	600257	大湖股份	1,400	6,062.00	0.01
153	002441	众业达	700	5,460.00	0.01
154	601519	大智慧	600	5,178.00	0.00

155	301680	固德电材	45	5,047.20	0.00
156	002777	久远银海	400	4,812.00	0.00
157	300784	利安科技	100	4,237.00	0.00
158	002255	海陆重工	400	3,928.00	0.00
159	688712	北芯生命	105	3,771.60	0.00
160	001369	双欣材料	261	3,528.72	0.00
161	603435	嘉德利	52	2,428.92	0.00
162	688781	视涯科技	44	2,094.84	0.00
163	603352	至信股份	58	1,480.16	0.00
164	001220	世盟股份	43	1,194.54	0.00
165	001219	青岛食品	100	1,146.00	0.00
166	603284	林平发展	31	1,080.97	0.00
167	603293	埃泰克汽车电子	25	848.25	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	601318	中国平安	3,305,294.00	1.93
2	300750	宁德时代	2,497,677.00	1.46
3	601899	紫金矿业	2,447,594.00	1.43
4	300502	新易盛	1,957,958.00	1.14
5	601600	中国铝业	1,917,394.00	1.12
6	601088	中国神华	1,896,546.12	1.11
7	000425	徐工机械	1,826,825.00	1.07
8	601166	兴业银行	1,725,791.00	1.01
9	000333	美的集团	1,700,992.00	0.99
10	002475	立讯精密	1,609,757.00	0.94
11	002600	领益智造	1,517,348.00	0.89
12	300308	中际旭创	1,516,980.00	0.89
13	300433	蓝思科技	1,417,458.00	0.83
14	600660	福耀玻璃	1,405,467.00	0.82
15	002156	通富微电	1,389,774.00	0.81
16	603993	洛阳钼业	1,334,702.00	0.78
17	600406	国电南瑞	1,334,405.00	0.78
18	300033	同花顺	1,268,586.00	0.74
19	002371	北方华创	1,250,525.00	0.73
20	603799	华友钴业	1,231,672.00	0.72

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	300750	宁德时代	5,179,178.00	3.02
2	601318	中国平安	4,226,700.00	2.47
3	601899	紫金矿业	4,141,691.00	2.42
4	002475	立讯精密	2,979,258.00	1.74
5	300433	蓝思科技	2,827,101.00	1.65
6	603259	药明康德	2,569,219.00	1.50
7	600519	贵州茅台	2,544,029.00	1.49
8	601166	兴业银行	2,428,673.00	1.42
9	603993	洛阳钼业	2,401,296.00	1.40
10	000333	美的集团	2,368,306.00	1.38
11	300308	中际旭创	2,359,368.00	1.38
12	600660	福耀玻璃	2,332,669.20	1.36
13	300373	扬杰科技	2,294,864.00	1.34
14	300033	同花顺	2,274,234.60	1.33
15	600406	国电南瑞	2,163,435.00	1.26
16	000425	徐工机械	2,097,112.00	1.22
17	600036	招商银行	2,075,800.00	1.21
18	300502	新易盛	2,057,246.00	1.20
19	000021	深科技	2,036,190.00	1.19
20	601168	西部矿业	2,022,348.00	1.18

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	226,456,830.48
卖出股票收入（成交）总额	291,175,389.25

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）	9,404.60	0.01
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	9,404.60	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	113704	春风转债	50	5,000.23	0.00
2	123272	中汽转债	28	4,404.37	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,841,269.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,841,269.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富中证 800 指数增强 A	1,461	18,709.42	7,843,634.73	28.70	19,490,829.49	71.30

汇添富中证 800 指数增强 C	3,867	13,492.92	1,359,557.72	2.61	50,817,578.32	97.39
合计	5,328	14,923.35	9,203,192.45	11.57	70,308,407.81	88.43

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富中证 800 指数增强 A	296,426.63	1.08
	汇添富中证 800 指数增强 C	0.00	0.00
	合计	296,426.63	0.37

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证 800 指数增强 A	0
	汇添富中证 800 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 800 指数增强 A	10~50
	汇添富中证 800 指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 05 月 19 日）基金份额总额	82,755,143.11	295,301,659.92
本报告期期初基金份额总额	56,649,262.34	75,935,708.13
本报告期基金总申购份额	19,745,074.45	303,322,553.91
减：本报告期基金总赎回份额	49,059,872.57	327,081,126.00
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	27,334,464.22	52,177,136.04

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内无其他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，基金托管人未受到调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

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 (%)	
中信证券	2	273,735,605.31	52.90	49,469.54	53.21	
中信证券华南	3	131,532,937.43	25.42	23,772.34	25.57	
国泰海通	3	112,166,009.24	21.68	19,730.45	21.22	

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 (%)
中信证券	13,473.70	74.46	-	-	-	-	-	-
中信证券华南	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	4,622.40	25.54	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

- (2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。
- (6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2026 年 01 月 22 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 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
3	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
4	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
5	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
6	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 05 月 22 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗	中国证监会基金电子	2026 年 05 月 22 日

	下部分基金更新基金产品资料概要	披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所	
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
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上交所, 上证报	2026 年 06 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 08 月 31 日