汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富沪深 300 指数增强
基金主代码	005530
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 03 日
报告期末基金份额总额(份)	843,192,887.70
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以沪深 300 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力求实现超越标的指数的业绩表现和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的投资策略主要包

	括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、国债期货投资策略。		
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 * 95% + 活期存款利率（税后） *5%		
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C	汇添富沪深 300 指数增强 Y
下属分级基金的交易代码	005530	010556	022949
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	528,714,156.37	303,790,186.97	10,688,544.36

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026 年 07 月 01 日 - 2026 年 09 月 30 日)		
	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C	汇添富沪深 300 指数增强 Y
1.本期已实现收益	-6,610,015.33	-3,309,193.44	-85,235.43
2.本期利润	-71,984,154.66	-38,685,469.73	-1,203,712.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1179	-0.1249	-0.1197
4.期末基金资产净值	818,921,145.66	459,049,268.44	16,708,638.75
5.期末基金份额净值	1.5489	1.5111	1.5632

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富沪深 300 指数增强 A						
阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①－③	②－④

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	-7.32%	1.17%	-11.88%	1.22%	4.56%	-0.05%
过去六个月	0.98%	1.14%	-1.92%	1.22%	2.90%	-0.08%
过去一年	-0.05%	1.01%	-5.72%	1.08%	5.67%	-0.07%
过去三年	27.33%	1.01%	17.46%	1.09%	9.87%	-0.08%
过去五年	7.60%	1.00%	-9.55%	1.07%	17.15%	-0.07%
自基金合同生效起至今	15.76%	1.03%	-6.81%	1.08%	22.57%	-0.05%
汇添富沪深 300 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	-7.41%	1.17%	-11.88%	1.22%	4.47%	-0.05%
过去六个月	0.79%	1.14%	-1.92%	1.22%	2.71%	-0.08%
过去一年	-0.44%	1.01%	-5.72%	1.08%	5.28%	-0.07%
过去三年	25.82%	1.01%	17.46%	1.09%	8.36%	-0.08%
过去五年	5.47%	1.00%	-9.55%	1.07%	15.02%	-0.07%
自基金合同生效起至今	11.80%	1.03%	-7.87%	1.08%	19.67%	-0.05%
汇添富沪深 300 指数增强 Y						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-7.20%	1.16%	-11.88%	1.22%	4.68%	-0.06%
过去六个月	1.24%	1.14%	-1.92%	1.22%	3.16%	-0.08%
过去一年	0.46%	1.01%	-5.72%	1.08%	6.18%	-0.07%
自基金合同生效起至今	15.81%	0.94%	10.39%	1.00%	5.42%	-0.06%

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







注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2020 年 11 月 03 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。

本基金由原汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金于 2020 年 11 月 03 日转型而来。

本基金于 2024 年 12 月 13 日新增 Y 类份额。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基金经理	2018 年 03 月 23 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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，力争在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理

活动相关的各个环节。

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的次数为 0。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，中国经济运行总体平稳，但"生产强、需求弱"的结构性分化特征仍在持续。生产端保持较强韧性，工业生产有所加快，制造业景气度逐月改善并在季末重返扩张区间。出口在外需支撑下延续强劲增长，继续显著快于整体经济，是本季经济运行的主要支撑。投资端整体承压，固定资产投资同比延续下降，其中房地产开发投资延续下滑、仍是主要拖累，基础设施和制造业投资整体偏弱。消费端复苏相对乏力，社会消费品零售总额增速处于低位，内需不足仍是主要约束。物价方面，走势分化明显：CPI 与核心 CPI 继续低位运行；PPI 同比延续正增长、维持高位运行，上游价格回升态势明显。货币政策延续适度宽松取向，公开市场操作保持流动性合理充裕，资金利率平稳运行，但实体信贷需求依然偏弱，新增信贷处于低位，政府债券发行对社会融资形成主要支撑；财政政策方面，政府债券保持较大供给规

模，房地产需求端支持政策进一步加码，季末市场对增量政策的预期升温。海外方面，主要经济体货币政策转向收紧，美联储于季内重启加息，利率路径预期明显上移；美债收益率大幅上行并维持高位；人民币汇率逆势走强；外部通胀扰动与地缘政治因素仍对全球风险偏好和国内资产定价形成阶段性影响。

报告期内，权益市场整体呈现震荡调整态势，主要指数普遍下跌，交投活跃度较上季度明显收缩，市场情绪趋于谨慎。季内节奏上，季初市场出现明显调整，季中在超跌后展开反弹，季末再度走弱、缩量震荡。风格与结构上，前期占优的成长风格发生显著反转：科创板、创业板指数深度回调、跌幅居前，前期涨幅较大的高波动板块回吐明显；而大盘价值与红利风格显著占优，红利指数逆势收涨并领涨主要指数，大盘蓝筹相对抗跌。整体来看，市场由上季度"成长强、价值弱"的极致分化转向价值、红利的修复与再平衡，市值加权指数表现明显弱于市场个股整体，权重股集中调整对指数的拖累显著。选股因子方面，基于可观察的市场风格，价值、低波动、红利等因子显著占优，低流动性因子亦表现较好；动量、高 Beta、成长等前期强势因子整体回撤明显；质量因子表现相对平稳。

报告期内，本基金使用规则化的多因子选股策略构建组合，努力保持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。报告期内，提升了选股因子的均衡性，组合相对于基准的风格偏离进一步降低，净值收益率领先于业绩比较基准。市场风格发生显著反转，组合超配的低估值、高质量、低波动风格整体表现较强，同时相对低配深度回调的科技成长股票，风格配置与选股共同贡献超额收益。沪深 300 指数作为中国 A 股市场核心蓝筹的代表，是投资者分享中国经济稳健增长红利、获取市场收益的工具。其成分股涵盖各行业龙头，盈利相对稳定，流动性好，估值合理，适合作为权益资产长期持有的底仓配置。未来我们将保持对量化选股模型和风险控制模型的迭代更新，提高对市场风格变化的应对能力，提升超额收益的稳定性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富沪深 300 指数增强 A 类份额净值增长率为-7.32%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%。本报告期汇添富沪深 300 指数增强 C 类份额净值增长率为-7.41%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%。本报告期汇添富沪深 300 指数增强 Y 类份额净值增长率为-7.20%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,200,892,529.06	87.29
	其中：股票	1,200,892,529.06	87.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	99,972,034.01	7.27
8	其他资产	74,843,209.08	5.44
9	合计	1,375,707,772.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	70,573,307.49	5.45
C	制造业	545,699,211.08	42.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,099,639.46	1.48
E	建筑业	4,235,406.00	0.33
F	批发和零售业	16.22	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	53,153,918.69	4.11

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,459,747.16	1.12
J	金融业	256,516,385.99	19.81
K	房地产业	830,775.00	0.06
L	租赁和商务服务业	9,657,762.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	14,792,856.00	1.14
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	798.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	989,019,823.09	76.39

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,854,916.75	0.30
C	制造业	158,558,005.35	12.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,088,854.08	0.55
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,359,780.20	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	3,228,610.40	0.25
H	住宿和餐饮业	5,502,490.00	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,834,800.25	1.07
J	金融业	5,586,890.00	0.43
K	房地产业	362.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	2,009,735.10	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	10,848,134.16	0.84
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	127.68	0.00
S	综合	-	-
	合计	211,872,705.97	16.36

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	69,850	56,469,534.00	4.36
2	300750	宁德时代	140,936	41,027,878.96	3.17
3	300502	新易盛	93,220	36,262,580.00	2.80
4	601899	紫金矿业	995,400	29,652,966.00	2.29
5	600519	贵州茅台	21,722	27,339,743.64	2.11

6	603986	兆易创新	57,300	20,278,470.00	1.57
7	688981	中芯国际	162,863	18,239,027.37	1.41
8	601328	交通银行	2,320,500	17,983,875.00	1.39
9	300408	三环集团	150,554	17,664,500.82	1.36
10	601318	中国平安	317,856	16,938,546.24	1.31

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688825	长鑫科技	172,784	6,678,101.60	0.52
2	688498	源杰科技	2,923	4,714,799.00	0.36
3	000729	燕京啤酒	400,100	4,401,100.00	0.34
4	300548	长芯博创	19,800	4,352,634.00	0.34
5	600754	锦江酒店	240,800	4,346,440.00	0.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	267,081.81
2	应收证券清算款	73,970,832.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	605,294.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	74,843,209.08

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	6,678,101.60	0.52	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C	汇添富沪深 300 指数增强 Y
本报告期期初基金份额总额	574,043,311.76	350,336,474.72	9,382,967.39
本报告期基金总申购份额	82,380,368.55	25,431,081.41	1,830,957.47
减：本报告期基金总赎回份额	127,709,523.94	71,977,369.16	525,380.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	528,714,156.37	303,790,186.97	10,688,544.36

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富沪深 300 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、报告期内汇添富沪深 300 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。

9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号　汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 10 月 27 日