

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	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	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
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	20
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
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	21
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	21
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	21
6.1 资产负债表	21
6.2 利润表	22
6.3 净资产变动表	24
6.4 报表附注	25
§ 7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
7.3 期末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	53
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 市场中性策略执行情况.....	63
7.13 投资组合报告附注.....	63
§ 8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 盈利投资者数量占比.....	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
8.4 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
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	65
§ 9 开放式基金份额变动.....	65
§ 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.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	66
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.....	66
10.8 其他重大事件	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	汇添富绝对收益定开混合	
基金主代码	000762	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 03 月 15 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	1,626,130,080.47	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
下属分级基金的交易代码	000762	008140
报告期末下属分级基金的份 额总额(份)	1,376,199,328.02	249,930,752.45

2.2 基金产品说明

投资目标	基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。
投资策略	本基金采用包括市场中性投资策略在内的多种绝对收益策略，力争实现基金资产长期持续稳定的绝对回报。绝对收益策略包括：市场中性投资策略、其他绝对收益策略。其他投资策略包括：债券投资策略、中小企业私募债投资策略、衍生品投资策略。
业绩比较基准	一年期定期存款税后利率
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，采用多种绝对收益策略，其中市场中性策略采用股指期货对冲市场风险，使得多空组合的收益波动与市场相关性较低。本基金属于中低风险水平追求绝对收益的投资品种，其预期风险低于股票型基金和一般的混合型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	张姗
	联系电话	021-28932888	400-61-95555
	电子邮箱	service@99fund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	400-888-9918	400-61-95555
传真	021-28932998	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	鲁伟铭	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 – 2026 年 06 月 30 日)	
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
本期已实现收益	270,096,729.02	43,875,926.16
本期利润	117,764,273.99	18,771,287.30
加权平均基金份额本期利润	0.0763	0.0691
本期加权平均净值利润率	6.00%	5.71%
本期基金份额净值增长率	6.55%	6.12%
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	349,421,396.93	43,334,134.49
期末可供分配基金份额利润	0.2539	0.1734
期末基金资产净值	1,835,428,715.72	316,142,378.42
期末基金份额净值	1.334	1.265
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	33.40%	-0.78%

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

汇添富绝对收益定开混合 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	6.55%	0.44%	0.37%	0.00%	6.18%	0.44%
过去六个月	6.55%	0.42%	0.74%	0.01%	5.81%	0.41%
过去一年	11.26%	0.36%	1.50%	0.00%	9.76%	0.36%
过去三年	7.23%	0.30%	4.50%	0.00%	2.73%	0.30%
过去五年	-7.62%	0.30%	7.50%	0.00%	-15.12%	0.30%
过去七年	9.98%	0.31%	10.50%	0.00%	-0.52%	0.31%
自基金合 同生效起 至今	33.40%	0.32%	13.94%	0.00%	19.46%	0.32%
汇添富绝对收益定开混合 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	6.39%	0.45%	0.37%	0.00%	6.02%	0.45%
过去六个月	6.12%	0.42%	0.74%	0.01%	5.38%	0.41%
过去一年	10.29%	0.36%	1.50%	0.00%	8.79%	0.36%
过去三年	4.63%	0.30%	4.50%	0.00%	0.13%	0.30%
过去五年	-11.23%	0.30%	7.50%	0.00%	-18.73%	0.30%
自基金合	-0.78%	0.31%	9.95%	0.00%	-10.73%	0.31%

同生效起 至今						
------------	--	--	--	--	--	--

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

汇添富绝对收益定开混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富绝对收益定开混合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（2017 年 03 月 15 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。

本基金于 2019 年 11 月 11 日新增 C 类份额。

§ 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		
陈思行	本基金的基金经理助理	2023 年 08 月 29 日	—	15	国籍：中国。学历：复旦大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 7 月至 2012 年 9 月任方正证券投资经理；2012 年 10 月至 2016 年 7 月任光大证券高级投资经理；2016 年 9 月至 2019 年 4 月任银华基金投资经理；2019 年 5 月至 2021 年 12 月任平安养

					老投资经 理；2021 年 12 月至 2022 年 7 月任国 寿养老高级 投资经理。 2022 年 7 月 加入汇添富 基金。2022 年 8 月 23 日 至 2024 年 3 月 29 日任汇 添富双利债 券型证券投 资基金的基 金经理助 理。2022 年 8 月 23 日至 2024 年 6 月 13 日任汇添 富鑫福债券 型证券投资 基金的基金 经理助理。 2023 年 2 月 1 日至 2024 年 5 月 9 日 任汇添富添 乐双盈债 券型证券投 资基金的基 金经理助 理。2023 年 8 月 29 日至 今任汇添富 绝对收益策 略定期开放 混合型发起 式证券投资 基金的基金 经理助理。 2023 年 11 月 24 日至 2025 年 8 月
--	--	--	--	--	---

					26 日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助理。2024 年 4 月 9 日至 2025 年 8 月 26 日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助理。2022 年 11 月 3 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 25 日至 2025 年 6 月 30 日任汇添富稳健欣享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 22 日至今任汇添富添添乐双鑫债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 29 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2024
--	--	--	--	--	---

					年 5 月 9 日至今任汇添富添乐双盈债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 10 月 29 日至 2026 年 2 月 24 日任汇添富弘悦回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。 2025 年 1 月 24 日至 2026 年 2 月 24 日任汇添富弘瑞回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 2 月 21 日至今任汇添富鑫享添利六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。 2025 年 5 月 15 日至 2026 年 5 月 29 日任汇添富弘达回报混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 15 日至 2026 年 5 月 29 日任汇添富弘盛回报
--	--	--	--	--	--

					混合型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月 13 日至今任汇添富双颐债券型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月 16 日至今任汇添富稳恒 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。 2025 年 9 月 29 日至今任汇添富双盈回报一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。
杨涛	本基金的基金经理	2026 年 03 月 06 日	-	17	国籍：中国。学历：上海财经大学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。 从业经历：之前曾在华泰柏瑞基金管理有限公司、上海泓湖投资管理有限公司、太平资产管理有限公司工作。2020 年 10 月加入汇添富基金

					管理股份有限公司。 2026 年 3 月 6 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。
顾耀强	本基金的基金经理, 增强收益部总监	2017 年 03 月 15 日	2026 年 03 月 06 日	22	国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，现任增强收益部总监。2009 年 12 月 22 日至今任汇添富策略回报混合

					型证券投资基金的基金经理。2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至 2026 年 3 月 6 日任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 24 日至 2024 年 10 月 18 日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年
--	--	--	--	--	---

					1 月 20 日至 今任汇添富 沪深 300 基 本面增强指 数型证券投 资基金的基 金经理。 2021 年 2 月 5 日至 2022 年 9 月 22 日 任汇添富价 值成长均衡 投资混合型 证券投资基金 的基金经 理。2021 年 9 月 16 日至 今任汇添富 中证 500 基 本面增强指 数型证券投 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

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
杨涛	公募基金	1	2,151,571,094.14	2026 年 3 月 6 日
	私募资产管理计划	8	1,624,925,536.62	2021 年 1 月 8 日

	其他组合	-	-	
	合计	9	3,776,496,630.76	

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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

2026 年上半年,A 股整体呈现“先扬后抑再修复”走势,主要宽基指数悉数收红,但结构性分化极致。年初在增量资金入场与风险偏好回暖推动下,AI、半导体等科技题材引领春季行情走高;随后中东地缘局势升级,避险情绪骤升,资金从高位成长股流向高股息防御板块,指数一度集体触底;此后随着外部扰动缓和、政策托底与盈利改善验证,市场重新走强,行情驱动力由估值修复切换至业绩兑现,半年整体收涨。风格上,成长显著优于价值,超额收益高度集中于 AI、算力等科技硬制造方向,而红利、金融、消费等传统板块成交低迷,走势较弱,映射出中国经济“新动能强劲、传统内需偏弱”的 K 型复苏格局。运作上,一季度动态调整组合配置,灵活管理风险敞口,积极应对板块轮动与期指基差扰动,维持净值平稳运行;二季度增配科技成长方向,保持价值板块核心持仓,优化股指期货对冲结构,带动净值稳健上涨。回顾上半年,产品权益净敞口保持较低水平,主要依靠行业和个股选择获得了超额收益。管理人坚持绝对收益导向,以前瞻性研究驱动决策,致力于为持有人创造经风险调整后的持续回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富绝对收益定开混合 A 类份额净值增长率为 6.55%,同期业绩比较基准收益率为 0.74%。本报告期汇添富绝对收益定开混合 C 类份额净值增长率为 6.12%,同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

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,市场核心驱动力将由估值修复切换至盈利兑现,既是去伪求真的过程,也是再平衡的起点。随着中报密集披露,市场进入景气与业绩验证期,前期靠叙事推动、缺乏业绩支撑的品种将面临证伪压力,而盈利能真正兑现的方向才具备持续性,企业盈利周期延续上行、全 A 非金融业绩增速可观为这一切换提供了基本面支撑。当前行业分化程度已逼近

历史极值，少数科技板块贡献了绝大部分涨幅，历史上此类极端分化后大概率走向收敛，风格再平衡动力较强，行情有望从极度集中的算力硬件端向性价比更高、盈利改善的领域扩散，呈现“高低切换、多点开花”格局，优质蓝筹与业绩确定性标的相对受益。对 AI 中长期产业趋势仍持积极看法，北美大厂资本开支维持高位为需求端提供支撑，但当前算力板块交易拥挤度处于历史极端水平，市场共识高度一致下微观结构脆弱性上升，业绩稍有不达预期或资本开支增速放缓都可能触发剧烈调整，需审慎评估，耐心等待更加具有性价比的位置。

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，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；封闭期，基金收益分配采用现金分红；开放期，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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	115,540,250.11	6,080,646.86
结算备付金		184,235,073.38	85,958,161.68
存出保证金		130,455,060.92	155,816,081.57
交易性金融资产	6.4.7.2	1,514,561,719.89	2,007,322,964.76
其中：股票投资		1,139,095,614.89	1,549,676,831.54
基金投资		-	-
债券投资		375,466,105.00	457,646,133.22
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	-	69,967,896.10
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		230,155,156.84	70,040,129.88
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,174,947,261.14	2,395,185,880.85
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		19,657,896.61	7,398,403.63
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,105,798.36	2,420,371.00
应付托管费		350,966.38	403,395.16
应付销售服务费		206,337.26	228,796.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		754.97	6,079.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,054,413.42	705,118.17
负债合计		23,376,167.00	11,162,164.32
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,626,130,080.47	1,918,239,310.75
未分配利润	6.4.7.9	525,441,013.67	465,784,405.78
净资产合计		2,151,571,094.14	2,384,023,716.53
负债和净资产总计		2,174,947,261.14	2,395,185,880.85

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,626,130,080.47 份。本基金下属汇添富绝对收益定开混合 A 基金份额净值 1.334 元，基金份额总额 1,376,199,328.02 份；本基金下属汇添富绝对收益定开混合 C 基金份额净值 1.265 元，基金份额总额 249,930,752.45 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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		153,901,344.15	30,778,239.86
1. 利息收入		1,822,906.75	3,333,917.62
其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,370,479.98	2,712,542.93
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		452,426.77	621,374.69
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		329,513,030.70	29,011,762.30
其中：股票投资收益	6.4.7.11	432,281,646.01	37,153,018.74
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	14,013,844.07	965,990.31
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	-128,418,339.11	-31,110,672.75
股利收益	6.4.7.17	11,635,879.73	22,003,426.00
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	-177,437,093.89	-1,568,654.76
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	2,500.59	1,214.70
减：二、营业总支出		17,365,782.86	23,039,097.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,647,740.92	18,070,543.38
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,274,623.46	3,011,757.18
3. 销售服务费		1,303,526.22	1,709,535.76
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		2,251.10	112,843.66
8. 其他费用	6.4.7.21	137,641.16	134,417.63
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		136,535,561.29	7,739,142.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填 列）		136,535,561.29	7,739,142.25

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		136, 535, 561. 29	7, 739, 142. 25

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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	1, 918, 239, 310. 75	465, 784, 405. 78	2, 384, 023, 716. 53
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 918, 239, 310. 75	465, 784, 405. 78	2, 384, 023, 716. 53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-292, 109, 230. 28	59, 656, 607. 89	-232, 452, 622. 39
（一）、综合收益总额	-	136, 535, 561. 29	136, 535, 561. 29
（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）	-292, 109, 230. 28	-76, 878, 953. 40	-368, 988, 183. 68
其中：1. 基金申购款	682, 701. 86	180, 308. 01	863, 009. 87
2. 基金赎回款	-292, 791, 932. 14	-77, 059, 261. 41	-369, 851, 193. 55
（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	1, 626, 130, 080. 47	525, 441, 013. 67	2, 151, 571, 094. 14
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	2, 783, 627, 283. 26	523, 307, 485. 46	3, 306, 934, 768. 72

资产			
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2,783,627,283.26	523,307,485.46	3,306,934,768.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-433,925,533.69	-73,092,853.23	-507,018,386.92
（一）、综合收益总额	-	7,739,142.25	7,739,142.25
（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）	-433,925,533.69	-80,831,995.48	-514,757,529.17
其中：1. 基金申购款	226,991.10	42,604.58	269,595.68
2. 基金赎回款	-434,152,524.79	-80,874,600.06	-515,027,124.85
（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	2,349,701,749.57	450,214,632.23	2,799,916,381.80

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

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（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〔2014〕741 号文《关于核准汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》以及中国证监会机构部函〔2016〕2980 号文《关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金延

期募集备案的回函》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 2017 年 3 月 15 日生效。首次设立基金募集规模为 493,313,864.49 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（2017）验字第 60466941_B11 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

自 2019 年 11 月 11 日起，本基金增设 C 类基金基金份额，原基金份额变更为 A 类基金份额。

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	115,540,250.11
等于：本金	115,505,947.49
加：应计利息	34,302.62
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	115,540,250.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		986,746,311.93	-	1,139,095,614.89	152,349,302.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,147,422.34	148,169.15	18,273,152.15	977,560.66
	银行间市场	354,112,065.85	2,564,952.85	357,192,952.85	515,934.15
	其他	-	-	-	-
	合计	371,259,488.19	2,713,122.00	375,466,105.00	1,493,494.81
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,358,005,800.12	2,713,122.00	1,514,561,719.89	153,842,797.77

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	- 1, 068, 118, 280. 00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	- 1, 068, 118, 280. 00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	- 1, 068, 118, 280. 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
IF2607	IF2607	-50	-73, 830, 000. 00	-1, 159, 920. 00
IF2609	IF2609	-313	- 455, 396, 220. 00	-5, 672, 760. 00
IH2607	IH2607	-70	-62, 046, 600. 00	-1, 530, 180. 00
IH2609	IH2609	-476	- 418, 518, 240. 00	-6, 991, 920. 00
IM2609	IM2609	-44	-74, 668, 000. 00	-986, 000. 00
合计				-16, 340, 780. 00
减：可抵销期货暂收款				-16, 340, 780. 00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金

融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	945,934.47
其中：交易所市场	943,671.97
银行间市场	2,262.50
应付利息	-
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	9,300.00
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-

应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	1,054,413.42

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富绝对收益定开混合 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	1,634,693,165.68	1,634,693,165.68
本期申购	619,416.84	619,416.84
本期赎回（以“-”号填列）	-259,113,254.50	-259,113,254.50
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	1,376,199,328.02	1,376,199,328.02
汇添富绝对收益定开混合 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	283,546,145.07	283,546,145.07
本期申购	63,285.02	63,285.02
本期赎回（以“-”号填列）	-33,678,677.64	-33,678,677.64
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	249,930,752.45	249,930,752.45

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

汇添富绝对收益定开混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	128,336,391.65	283,054,597.24	411,390,988.89

加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	128,336,391.65	283,054,597.24	411,390,988.89
本期利润	270,096,729.02	-152,332,455.03	117,764,273.99
本期基金份额交易产生的变动数	-49,011,723.74	-20,914,151.44	-69,925,875.18
其中：基金申购款	116,177.44	51,062.59	167,240.03
基金赎回款	-49,127,901.18	-20,965,214.03	-70,093,115.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	349,421,396.93	109,807,990.77	459,229,387.70
汇添富绝对收益定开混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,278,927.44	51,114,489.45	54,393,416.89
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	3,278,927.44	51,114,489.45	54,393,416.89
本期利润	43,875,926.16	-25,104,638.86	18,771,287.30
本期基金份额交易产生的变动数	-3,820,719.11	-3,132,359.11	-6,953,078.22
其中：基金申购款	7,263.26	5,804.72	13,067.98
基金赎回款	-3,827,982.37	-3,138,163.83	-6,966,146.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,334,134.49	22,877,491.48	66,211,625.97

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	421,403.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	948,510.52
其他	565.71
合计	1,370,479.98

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	2,667,852,341.19
减：卖出股票成本总额	2,231,899,372.87
减：交易费用	3,671,322.31

买卖股票差价收入	432,281,646.01
----------	----------------

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	4,491,650.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,522,193.64
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	14,013,844.07

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	302,471,643.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	290,614,463.06
减：应计利息总额	2,328,651.80
减：交易费用	6,334.68
买卖债券差价收入	9,522,193.64

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
外汇远期投资收益	-
股指期货投资收益	-128,418,339.11
外汇期货投资收益	-
国债期货投资收益	-

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	11,635,879.73
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	11,635,879.73

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	-196,591,953.89
——股票投资	-187,838,054.04
——债券投资	-8,753,899.85
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	19,154,860.00
——权证投资	-
——期货投资	19,154,860.00
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	-177,437,093.89

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	2,500.59
替代损益	-
其他	-
合计	2,500.59

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	27,900.00
银行费用	10,562.21
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	137,641.16

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, 基金发起人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人, 基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

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	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至
----	-------------------------	------------------------------

	2026 年 06 月 30 日	2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,647,740.92	18,070,543.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,661,479.35	7,423,547.23
应支付基金管理人的净管理费	7,986,261.57	10,646,996.15

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.20%/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,由基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

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	2,274,623.46	3,011,757.18

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.2%/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,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

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		
	汇添富绝对收益定开 混合 A	汇添富绝对收益定开 混合 C	合计
汇添富基金管理股份	-	17,208.88	17,208.88

有限公司			
东方证券股份有限公司	-	12,475.38	12,475.38
招商银行股份有限公司	-	488,823.06	488,823.06
合计	-	518,507.32	518,507.32
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		
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	22,050.29	22,050.29
东方证券股份有限公司	-	18,316.69	18,316.69
招商银行股份有限公司	-	710,620.07	710,620.07
合计	-	750,987.05	750,987.05

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 0.80%。
本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值的 0.80%年费率计提。
计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

单位：人民币元

本期						
2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行股份有限公司	-	30,297,374.75	-	-	-	-
上年度可比期间						
2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日						
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

各关联方名称	基金买 入	基金卖 出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
	-	-	-	-	-	-

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
招商银行	115,540,250.11	421,403.75	74,123,597.67	162,831.14

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

于本报告期末，本基金持有基金托管人招商银行发行的股票 1,251,872.00 股，占本基金净值比例为 2.07%。（于上期末，本基金持有基金托管人招商银行发行的股票 1,251,872.00 股，占本基金净值比例为 2.05%。）

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
001220	世盟股份	2026 年 01 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	
30153	春光	2026	6 个月	新股	13.30	51.56	290	3,857	14,95	

1	集团	年 04 月 28 日	月	流通 受限				. 00	2. 40	
30159 9	理奇 智能	2026 年 04 月 22 日	6 个 月	新股 流通 受限	13. 91	32. 47	433	6, 023 . 03	14, 05 9. 51	
30166 6	大普 微	2026 年 04 月 08 日	6 个 月	新股 流通 受限	46. 08	463. 3 3	1, 220	56, 21 7. 60	565, 2 62. 60	
30166 9	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, 50 6. 40	
30168 0	固德 电材	2026 年 02 月 27 日	6 个 月	新股 流通 受限	58. 00	112. 1 6	117	6, 786 . 00	13, 12 2. 72	
30168 2	宏明 电子	2026 年 03 月 18 日	6 个 月	新股 流通 受限	69. 66	160. 0 6	714	49, 73 7. 24	114, 2 82. 84	
30168 3	慧谷 新材	2026 年 03 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	78. 38	121. 7 7	96	7, 524 . 48	11, 68 9. 92	
30168 7	新广 益	2025 年 12 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	21. 93	77. 78	195	4, 276 . 35	15, 16 7. 10	
30169 6	三瑞 智能	2026 年 03 月 31 日	6 个 月	新股 流通 受限	24. 68	86. 80	216	5, 330 . 88	18, 74 8. 80	
60111 2	振石 股份	2026 年 01 月 21 日	6 个 月	新股 流通 受限	11. 18	17. 59	775	8, 664 . 50	13, 63 2. 25	
60328 4	林平 发展	2026 年 02 月 03 日	6 个 月	新股 流通 受限	37. 88	34. 87	46	1, 742 . 48	1, 604 . 02	
60329	埃泰	2026	6 个	新股	33. 49	33. 93	72	2, 411	2, 442	

3	克汽车电子	年 04 月 09 日	月	流通受限				. 28	. 96	
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	新股流通受限	21. 88	25. 52	112	2, 450 . 56	2, 858 . 24	
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13. 86	73. 46	137	1, 898 . 82	10, 06 4. 02	
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15. 76	46. 71	104	1, 639 . 04	4, 857 . 84	
603459	红板科技	2026 年 03 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17. 70	84. 32	330	5, 841 . 00	27, 82 5. 60	
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17. 52	35. 92	1, 500	26, 28 0. 00	53, 88 0. 00	
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22. 68	47. 61	217	4, 921 . 56	10, 33 1. 37	
688785	恒运昌股份	2026 年 01 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92. 18	463. 1 5	116	10, 69 2. 88	53, 72 5. 40	
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114. 2 8	676. 9 4	8, 417	961, 8 94. 76	5, 697 , 803. 98	
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44. 56	468. 6 7	207	9, 223 . 92	97, 01 4. 69	
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 09 日	9 个月	新股流通受限	104. 6 6	768. 8 9	3, 994	418, 0 12. 04	3, 070 , 946. 66	
68881	有研	2026	6 个	新股	6. 41	24. 13	834	5, 345	20, 12	

1	金属 复材	年 04 月 01 日	月	流通 受限				. 94	4. 42	
68881 3	泰金 新能	2026 年 03 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	26. 28	172. 0 9	234	6, 149 . 52	40, 26 9. 06	
68881 8	中电 科蓝 天科 技	2026 年 02 月 03 日	6 个 月	新股 流通 受限	9. 47	70. 14	1, 717	16, 25 9. 99	120, 4 30. 38	
68882 0	盛合 晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个 月	新股 流通 受限	19. 68	141. 4 9	2, 391	47, 05 4. 88	338, 3 02. 59	
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
11807 2	鼎通 转债	2026 年 06 月 25 日	16 个 交易 日	新债 流通 受限	100. 0 0	100. 0 0	870	87, 00 0. 00	87, 00 2. 67	

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于约定开放日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	115,540,250.11	-	-	-	-	-	115,540,250.11
结算备付金	184,235,073.38	-	-	-	-	-	184,235,073.38
存出保证金	319,973.72	-	-	-	-	130,135,087.20	130,455,060.92
交易性金融资产	18,186,149.48	-	146,162,930.23	22,136,668.49	188,980,356.80	1,139,095,614.89	1,514,561,719.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	230,155,156.84	230,155,156.84
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	318,281,446.69	-	146,162,930.23	22,136,668.49	188,980,356.80	1,499,385,858.93	2,174,947,261.14
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	-	-	-	-	-	19,657,896.61	19,657,896.61
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,105,798.36	2,105,798.36
应付托管费	-	-	-	-	-	350,966.38	350,966.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	206,337.26	206,337.26
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	754.97	754.97
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,054,413.42	1,054,413.42
负债总计	-	-	-	-	-	23,376,167.00	23,376,167.00
利率敏感度缺口	318,281,446.69	-	146,162,930.23	22,136,668.49	188,980,356.80	1,476,009,691.93	2,151,571,094.14

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	6,080,64 6.86	-	-	-	-	-	6,080,64 6.86
结算备付 金	85,958,1 61.68	-	-	-	-	-	85,958,1 61.68
存出保证 金	316,212. 77	-	-	-	-	155,499, 868.80	155,816, 081.57
交易性金 融资产	142,360, 089.26	-	2,658,39 4.68	12,332,9 49.43	300,294, 699.85	1,549,67 6,831.54	2,007,32 2,964.76
衍生金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售 金融资产	69,967,8 96.10	-	-	-	-	-	69,967,8 96.10
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算 款	-	-	-	-	-	70,040,1 29.88	70,040,1 29.88
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得 税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	304,683, 006.67	-	2,658,39 4.68	12,332,9 49.43	300,294, 699.85	1,775,21 6,830.22	2,395,18 5,880.85
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	-	-	-	-	-	7,398,40 3.63	7,398,40 3.63
应付赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	2,420,37 1.00	2,420,37 1.00

应付托管费	-	-	-	-	-	403,395.16	403,395.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	228,796.62	228,796.62
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	6,079.74	6,079.74
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	705,118.17	705,118.17
负债总计	-	-	-	-	-	11,162,164.32	11,162,164.32
利率敏感度缺口	304,683,006.67	-	2,658,394.68	12,332,949.43	300,294,699.85	1,764,054,665.90	2,384,023,716.53

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

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
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
	基准利率减少 25 个基点	5,761,381.21	8,287,344.95
	基准利率增加 25 个基点	-5,513,639.96	-7,928,896.08

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	1,139,095,614.89	52.94	1,549,676,831.54	65.00
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	375,466,105.00	17.45	457,646,133.22	19.20
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	1,514,561,719.89	70.39	2,007,322,964.76	84.20

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	14, 195, 748. 34	14, 599, 628. 07
	沪深 300 指数下跌	-14, 195, 748. 34	-14, 599, 628. 07

	5%		
--	----	--	--

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	1,146,687,739.98
第二层次	357,295,122.62
第三层次	10,578,857.29
合计	1,514,561,719.89

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。
--

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,139,095,614.89	52.37
	其中：股票	1,139,095,614.89	52.37
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	375,466,105.00	17.26
	其中：债券	375,466,105.00	17.26
	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	299,775,323.49	13.78
8	其他各项资产	360,610,217.76	16.58
9	合计	2,174,947,261.14	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	45,864,597.76	2.13
C	制造业	857,250,925.20	39.84

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,387,130.00	0.81
E	建筑业	22,460,080.00	1.04
F	批发和零售业	2,756,904.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	13,731,863.46	0.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,657,242.77	2.54
J	金融业	121,539,984.50	5.65
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	46,462.20	0.00
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	3,400,425.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	1,139,095,614.89	52.94

7.2.2 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	61,800	78,486,000.00	3.65
2	688498	源杰科技	33,228	62,668,008.00	2.91
3	002384	东山精密	225,699	59,212,132.65	2.75
4	600036	招商银行	1,251,872	44,441,456.00	2.07
5	000333	美的集团	581,417	43,914,426.01	2.04
6	000651	格力电器	1,084,000	40,650,000.00	1.89
7	600150	中国船舶	957,500	32,353,925.00	1.50
8	601398	工商银行	3,315,100	23,437,757.	1.09

				00	
9	300750	宁德时代	58,600	23,030,386.00	1.07
10	601225	陕西煤业	1,130,700	23,009,745.00	1.07
11	600183	生益科技	128,900	22,351,260.00	1.04
12	600522	中天科技	362,800	22,014,704.00	1.02
13	600690	海尔智家	913,400	18,642,494.00	0.87
14	300037	新宙邦	194,000	18,012,900.00	0.84
15	600160	巨化股份	330,500	17,519,805.00	0.81
16	600741	华域汽车	1,071,800	16,634,336.00	0.77
17	601117	中国化学	2,221,300	16,326,555.00	0.76
18	601728	中国电信	3,078,100	15,975,339.00	0.74
19	002851	麦格米特	95,000	15,882,100.00	0.74
20	601166	兴业银行	899,800	14,900,688.00	0.69
21	600938	中国海油	509,300	13,827,495.00	0.64
22	688396	华润微电子	138,841	13,543,939.55	0.63
23	301308	江波龙	18,500	13,020,300.00	0.61
24	002281	光迅科技	49,400	12,692,836.00	0.59
25	002916	深南电路	27,100	12,409,090.00	0.58
26	600050	中国联通	3,043,900	12,175,600.00	0.57
27	002738	中矿资源	198,700	11,721,313.00	0.54
28	600941	中国移动	134,300	11,567,259.00	0.54
29	688147	微导纳米科技	71,072	11,505,135.36	0.53

30	300394	天孚通信	37,405	11,321,745.40	0.53
31	002466	天齐锂业	182,700	11,203,164.00	0.52
32	301511	德福科技	71,859	10,336,917.15	0.48
33	600900	长江电力	377,300	9,987,131.00	0.46
34	688630	芯碁微装	16,389	9,003,952.71	0.42
35	601766	中国中车	1,724,100	8,965,320.00	0.42
36	688361	中科飞测	20,464	8,799,520.00	0.41
37	301526	国际复材	177,400	8,279,258.00	0.38
38	688702	盛科通信	21,041	8,205,779.59	0.38
39	000001	平安银行	808,000	8,120,400.00	0.38
40	688668	鼎通科技	21,460	8,011,018.00	0.37
41	688652	京仪装备	38,231	7,652,699.27	0.36
42	002364	中恒电气	140,800	7,575,040.00	0.35
43	601869	长飞光纤	13,800	7,533,420.00	0.35
44	688012	中微半导体设备	15,518	7,270,183.00	0.34
45	300438	鹏辉能源	82,400	6,826,840.00	0.32
46	002142	宁波银行	226,130	6,713,799.70	0.31
47	600487	亨通光电	60,700	6,636,938.00	0.31
48	600563	法拉电子	34,200	6,525,360.00	0.30
49	603379	三美股份	85,400	6,481,006.00	0.30
50	301377	鼎泰高科	11,700	6,445,530.00	0.30
51	688351	微创电生理股份	265,957	6,026,585.62	0.28

52	002493	荣盛石化	549,900	5,911,425.0 0	0.27
53	601229	上海银行	676,300	5,870,284.0 0	0.27
54	601009	南京银行	592,700	5,861,803.0 0	0.27
55	600019	宝钢股份	1,075,900	5,842,137.0 0	0.27
56	000708	中信特钢	459,300	5,796,366.0 0	0.27
57	600141	兴发集团	122,600	5,758,522.0 0	0.27
58	688795	摩尔线程	8,417	5,697,803.9 8	0.26
59	000951	中国重汽	274,800	5,361,348.0 0	0.25
60	600398	海澜之家	1,021,800	5,344,014.0 0	0.25
61	300953	震裕科技	39,276	5,251,201.2 0	0.24
62	301217	铜冠铜箔	31,700	5,232,719.0 0	0.24
63	002756	永兴材料	88,500	5,012,640.0 0	0.23
64	000921	海信家电	169,400	4,628,008.0 0	0.22
65	688610	埃科光电	17,349	4,569,726.6 0	0.21
66	688582	芯动联科	70,187	4,562,155.0 0	0.21
67	000811	冰轮环境	78,400	4,407,648.0 0	0.20
68	601156	东航物流	272,300	4,389,476.0 0	0.20
69	688777	中控技术	36,858	4,330,815.0 0	0.20
70	600428	中远海特	553,900	4,325,959.0 0	0.20
71	002635	安洁科技	207,300	4,239,285.0 0	0.20
72	300568	星源材质	224,700	4,206,384.0 0	0.20
73	600015	华夏银行	653,100	4,173,309.0 0	0.19

74	601001	晋控煤业	235,200	4,090,128.0 0	0.19
75	600869	远东股份	122,000	4,083,340.0 0	0.19
76	301536	星宸科技	31,400	4,041,494.0 0	0.19
77	688220	翱捷科技	30,735	3,820,975.2 0	0.18
78	600023	浙能电力	718,900	3,781,414.0 0	0.18
79	688090	瑞松科技	34,679	3,691,579.5 5	0.17
80	601577	长沙银行	420,600	3,663,426.0 0	0.17
81	600642	申能股份	414,500	3,618,585.0 0	0.17
82	002011	盾安环境	334,200	3,545,862.0 0	0.16
83	600585	海螺水泥	208,200	3,528,990.0 0	0.16
84	000719	中原传媒	297,500	3,400,425.0 0	0.16
85	600970	中材国际	469,900	3,350,387.0 0	0.16
86	002487	大金重工	57,000	3,304,290.0 0	0.15
87	603986	兆易创新	3,900	3,178,500.0 0	0.15
88	001339	智微智能	30,680	3,137,950.4 0	0.15
89	300408	三环集团	18,700	3,121,030.0 0	0.15
90	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.6 6	0.14
91	605020	永和股份	74,900	3,049,928.0 0	0.14
92	603816	顾家家居	130,300	2,913,508.0 0	0.14
93	601288	农业银行	469,000	2,846,830.0 0	0.13
94	000408	藏格矿业	41,000	2,842,120.0 0	0.13
95	600039	四川路桥	355,900	2,783,138.0 0	0.13

96	601877	正泰电器	110,100	2,760,207.0 0	0.13
97	600729	重百集团	146,800	2,756,904.0 0	0.13
98	300236	上海新阳	20,900	2,748,350.0 0	0.13
99	605358	立昂微	35,100	2,723,760.0 0	0.13
100	002233	塔牌集团	388,200	2,705,754.0 0	0.13
101	603565	中谷物流	274,000	2,687,940.0 0	0.12
102	601088	中国神华	68,419	2,671,077.7 6	0.12
103	600060	海信视像	88,800	2,474,856.0 0	0.12
104	688258	江苏卓易信 息科技	20,267	2,402,450.1 8	0.11
105	601000	唐山港	560,700	2,326,905.0 0	0.11
106	600988	赤峰黄金	86,100	2,266,152.0 0	0.11
107	002532	天山铝业	210,900	2,262,957.0 0	0.11
108	600219	南山铝业	528,000	2,106,720.0 0	0.10
109	000915	华特达因	71,300	2,018,503.0 0	0.09
110	000404	长虹华意	247,200	1,942,992.0 0	0.09
111	688700	东威科技	21,516	1,923,530.4 0	0.09
112	002145	钛能化学	403,400	1,900,014.0 0	0.09
113	002222	福晶科技	19,600	1,808,688.0 0	0.08
114	002064	华峰化学	182,800	1,734,772.0 0	0.08
115	002488	金固股份	194,400	1,732,104.0 0	0.08
116	603296	华勤技术	22,400	1,663,648.0 0	0.08
117	601128	常熟银行	259,490	1,510,231.8 0	0.07

118	603876	鼎胜新材	37,800	983,178.00	0.05
119	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.03
120	688813	泰金新能	2,337	481,899.06	0.02
121	600601	方正科技	30,900	427,656.00	0.02
122	600346	恒力石化	20,000	354,200.00	0.02
123	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.02
124	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
125	301680	固德电材	1,168	140,283.21	0.01
126	301656	联合动力	7,395	127,415.85	0.01
127	688818	中电科蓝天科技	1,717	120,430.38	0.01
128	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
129	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
130	688781	视涯科技	1,082	54,472.32	0.00
131	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
132	688785	恒运昌股份	116	53,725.40	0.00
133	688807	优迅芯片股份	131	52,718.33	0.00
134	688796	百奥赛图	423	46,276.20	0.00
135	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
136	001386	马可波罗	1,626	23,024.16	0.00
137	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
138	688811	有研金属复材	834	20,124.42	0.00
139	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
140	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
141	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
142	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
143	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
144	603175	超颖电子	169	15,056.21	0.00
145	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
146	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
147	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
148	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
149	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
150	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
151	601026	道生天合材料科技	451	6,575.58	0.00
152	603418	友升股份	139	6,139.63	0.00
153	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
154	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
155	603293	埃泰克汽车电子	72	2,442.96	0.00

156	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
157	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
158	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
159	688372	伟测科技	1	186.00	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	002384	东山精密	57,297,460.70	2.40
2	000651	格力电器	48,214,956.00	2.02
3	600150	中国船舶	39,175,680.20	1.64
4	300394	天孚通信	37,976,547.70	1.59
5	000338	潍柴动力	30,547,242.00	1.28
6	301308	江波龙	29,597,226.64	1.24
7	000776	广发证券	29,226,695.60	1.23
8	000333	美的集团	28,408,379.00	1.19
9	600487	亨通光电	27,871,220.83	1.17
10	601398	工商银行	26,044,659.00	1.09
11	601225	陕西煤业	25,784,418.00	1.08
12	601138	工业富联	24,132,339.00	1.01
13	601728	中国电信	23,709,512.98	0.99
14	603268	松发股份	23,577,565.60	0.99
15	300308	中际旭创	23,100,344.00	0.97
16	601117	中国化学	22,115,533.00	0.93
17	000408	藏格矿业	22,020,132.00	0.92
18	601288	农业银行	21,636,065.00	0.91
19	600183	生益科技	20,876,031.00	0.88
20	600522	中天科技	20,675,825.00	0.87

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	59,838,473.00	2.51
2	600519	贵州茅台	59,552,997.54	2.50
3	601899	紫金矿业	54,797,807.40	2.30

4	601138	工业富联	48,478,060.00	2.03
5	601318	中国平安	46,776,787.15	1.96
6	000338	潍柴动力	40,481,980.00	1.70
7	600276	恒瑞医药	39,422,284.00	1.65
8	002028	思源电气	38,461,929.72	1.61
9	301308	江波龙	35,614,607.00	1.49
10	603986	兆易创新	34,486,693.86	1.45
11	688498	源杰科技	32,294,117.36	1.35
12	600988	赤峰黄金	31,115,759.35	1.31
13	600487	亨通光电	30,477,706.91	1.28
14	002475	立讯精密	30,295,014.00	1.27
15	002353	杰瑞股份	30,035,606.00	1.26
16	688012	中微半导体设备	29,587,091.35	1.24
17	300308	中际旭创	29,141,556.00	1.22
18	600030	中信证券	27,328,177.32	1.15
19	300394	天孚通信	26,749,162.00	1.12
20	600900	长江电力	26,505,965.00	1.11

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	2,009,156,210.26
卖出股票收入（成交）总额	2,667,852,341.19

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	62,664,247.21	2.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	282,349,679.45	13.12
	其中：政策性金融债	282,349,679.45	13.12
4	企业债券	2,067,457.42	0.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,111,568.77	0.47
7	可转债（可交换债）	18,273,152.15	0.85
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	375,466,105.00	17.45

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	170210	17 国开 10	1,300,000	133,896,901.37	6.22
2	220210	22 国开 10	500,000	54,060,753.42	2.51
3	250215	25 国开 15	400,000	39,619,506.85	1.84
4	220205	22 国开 05	300,000	32,635,849.32	1.52
5	210205	21 国开 05	200,000	22,136,668.49	1.03

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

本基金将主要利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。本基金根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

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 市场中性策略执行情况

截止本报告期末，本基金持有的股票资产 1,139,095,614.89 元，占基金资产净值的比例为 52.94%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-1,084,459,060.00 元，占基金资产净值的比例为-50.40%，运用股指期货进行对冲的空头合约市值占股票资产的比例为-95.20%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 303,863,306.90 元，公允价值变动损益为-168,683,194.04 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

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

7.13.2

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。

7.13.3 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	130,455,060.92
2	应收清算款	230,155,156.84
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	-
8	其他	-
9	合计	360,610,217.76

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	18,186,149.48	0.85

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十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（%）
汇添富绝对收益定开混合 A	29,607	46,482.23	21,909,349.77	1.59	1,354,289,978.25	98.41
汇添富绝对收益定开混合 C	4,141	60,355.17	22,321,674.09	8.93	227,609,078.36	91.07
合计	33,748	48,184.49	44,231,023.86	2.72	1,581,899,056.61	97.28

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	99.99%

8.3 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	汇添富绝对收益定开混合 A	4,638,084.22	0.34
	汇添富绝对收益定开混合 C	14,378.26	0.01
	合计	4,652,462.48	0.29

8.4 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	汇添富绝对收益定开混合 A	0

投资和研究部门负责人持有 本开放式基金	汇添富绝对收益定开混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	汇添富绝对收益定开混合 A	0
	汇添富绝对收益定开混合 C	0
	合计	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,001,000.00 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 03 月 15 日起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
基金合同生效日（2017 年 03 月 15 日）基金份额总额	493,313,864.49	—
本报告期初基金份额总额	1,634,693,165.68	283,546,145.07
本报告期基金总申购份额	619,416.84	63,285.02
减：本报告期基金总赎回份 额	259,113,254.50	33,678,677.64
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	1,376,199,328.02	249,930,752.45

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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（%）	
国泰海通	8	1,356,416,253.96	29.02	591,257.51	29.02	
东方财富	2	616,581,281.38	13.19	268,770.01	13.19	
天风证券	2	604,530,325.55	12.93	263,517.27	12.93	
广发证券	4	498,436,808.42	10.66	217,265.69	10.66	

开源证券	2	408,665,210.46	8.74	178,138.86	8.74	
中信建投证券	2	282,822,564.13	6.05	123,282.58	6.05	
东北证券	2	261,162,862.92	5.59	113,842.14	5.59	
申万宏源证券	2	233,607,901.68	5.00	101,832.55	5.00	
国金证券	2	176,092,855.41	3.77	76,762.00	3.77	
国信证券	2	80,315,694.87	1.72	35,010.81	1.72	
招商证券	3	63,965,549.12	1.37	27,881.74	1.37	
华安证券	2	58,293,422.93	1.25	25,410.20	1.25	
国投证券	2	33,750,748.50	0.72	14,712.06	0.72	
中信证券	4	27,753.30	0.00	12.10	0.00	
德邦证券	2	—	—	—	—	
东方证券	3	—	—	—	—	
高盛中国	2	—	—	—	—	
华泰证券	3	—	—	—	—	
平安证券	2	—	—	—	—	
银河证券	2	—	—	—	—	
中金财富	2	—	—	—	—	
中原证券	2	—	—	—	—	

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
国泰海通	26,845,769.5	46.80	960,000,000.	18.75	—	—	—	—

	0		00					
东方财富	3,881,782.31	6.77	920,000,000.00	17.97	-	-	-	-
天风证券	917,850.00	1.60	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	17,095,237.36	29.80	180,000,000.00	3.52	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	730,000,000.00	14.26	-	-	-	-
东北证券	-	-	1,480,000,000.00	28.91	-	-	-	-
申万宏源证券	2,095,927.85	3.65	-	-	-	-	-	-
国金证券	3,274,950.56	5.71	540,000,000.00	10.55	-	-	-	-
国信证券	3,253,816.32	5.67	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	310,000,000.00	6.05	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
中金财 富	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证 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:

本基金本报告期内退租 3 家证券公司的 4 个交易单元:国投证券(上交所单元)、民生证券(上交所单元,深交所单元)、中泰证券(上交所单元)。

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	汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2026 年 03 月 06 日
3	汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2026 年 03 月 10 日

	募说明书（2026 年 3 月 10 日更新）		
4	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 03 月 20 日
5	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 03 月 20 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	关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金第十七次开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上证报	2026 年 04 月 21 日
9	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
10	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
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

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绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式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、报告期内汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式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