汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介 18
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 18
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 18
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 19
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 21
4.9 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 21
§5 托管人报告 21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 21
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 22
6.1 资产负债表 22
6.2 利润表 23
6.3 净资产变动表 24
6.4 报表附注 26
§7 投资组合报告 49
7.1 期末基金资产组合情况 49
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 50
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 50
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细 51
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 62
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 64
7.7 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 64

7.8 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.....64
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....64
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....65
7.11 投资组合报告附注.....65
§8 基金份额持有人信息.....66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....66
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.....66
§9 开放式基金份额变动.....67
§10 重大事件揭示.....67
10.1 基金份额持有人大会决议.....67
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.....67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....67
10.4 基金投资策略的改变.....67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....67
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....68
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.....68
10.8 其他重大事件.....71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....72
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....72
§12 备查文件目录.....72
12.1 备查文件目录.....72
12.2 存放地点.....73
12.3 查阅方式.....73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）	
基金简称	汇添富恒生指数（QDII-LOF）	
基金主代码	164705	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 01 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	337,632,068.05	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2020 年 12 月 02 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
下属分级基金场内简称	恒生 LOF	-
下属分级基金的交易代码	164705	010789
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	251,129,996.51	86,502,071.54

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 5%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、境内融资投资策略、参与境内转融通证券出借业务策略、境内存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的恒生指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	任航
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200010	100031
法定代表人		鲁伟铭	谷澍

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	香港上海汇丰银行有限公司
	英文	The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号,汇丰中心一座六楼
邮政编码		999077

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 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

2.6 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 06 月 30 日)	
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
本期已实现收益	9,772,399.79	3,401,913.26
本期利润	-38,815,227.07	-13,868,939.87
加权平均基金份额本期利润	-0.1443	-0.1442

本期加权平均净值利润率	-12.37%	-12.40%
本期基金份额净值增长率	-12.80%	-12.89%
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	36,691,641.41	13,304,031.16
期末可供分配基金份额利润	0.1461	0.1538
期末基金资产净值	259,373,975.36	88,962,410.60
期末基金份额净值	1.0328	1.0284
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	-3.11%	-4.72%

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。

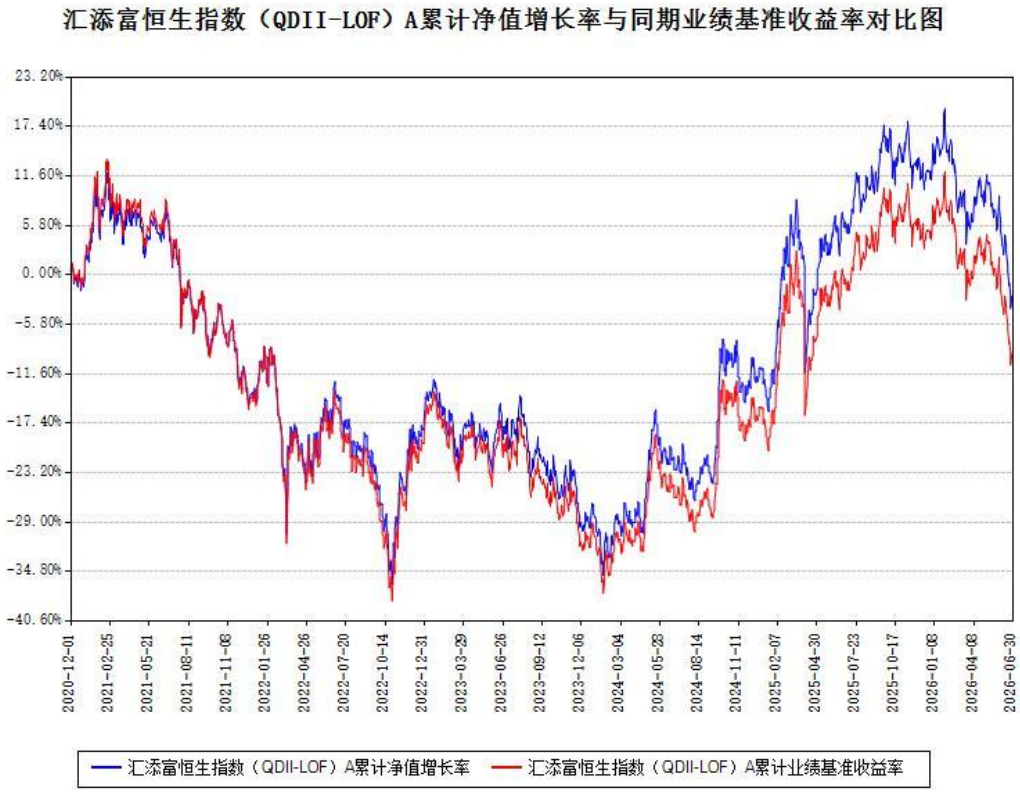
3.2 基金净值表现

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

汇添富恒生指数（QDII-LOF）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	-8.09%	1.08%	-8.74%	1.08%	0.65%	0.00%
过去六个月	-12.80%	1.15%	-13.45%	1.15%	0.65%	0.00%
过去一年	-8.27%	1.07%	-8.94%	1.07%	0.67%	0.00%
过去三年	19.08%	1.33%	13.67%	1.34%	5.41%	-0.01%
过去五年	-8.77%	1.41%	-15.73%	1.45%	6.96%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-3.11%	1.38%	-9.85%	1.41%	6.74%	-0.03%
汇添富恒生指数（QDII-LOF）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	①－③	②－④

				④		
过去三个月	-8.12%	1.08%	-8.74%	1.08%	0.62%	0.00%
过去六个月	-12.89%	1.15%	-13.45%	1.15%	0.56%	0.00%
过去一年	-8.41%	1.07%	-8.94%	1.07%	0.53%	0.00%
过去三年	18.77%	1.33%	13.67%	1.34%	5.10%	-0.01%
过去五年	-9.17%	1.41%	-15.73%	1.45%	6.56%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-4.72%	1.38%	-9.85%	1.41%	5.13%	-0.03%

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 12 月 01 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。

本基金由原汇添富恒生指数分级证券投资基金于 2020 年 12 月 01 日转型而来。

§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		
乐无穹	本基金的基金经理	2023 年 04 月 13 日	-	12	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7

					月 26 日至 2024 年 4 月 19 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至 2025 年 5 月 16 日任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任

					汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2024 年 9 月 29 日任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 28 日至 2025 年 8 月 6 日任

					汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 7 月 29 日至 2024 年 2 月 7 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基

					金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至 2024 年 7 月 5 日任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023

					年 6 月 19 日至 2024 年 7 月 9 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 23 日至 2025 年 5 月 9 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 28 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月 5 日至今任汇添富 MSCI 美国 50 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年 3 月 1 日至今任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024

					年 4 月 1 日至 2025 年 5 月 9 日任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 10 月 28 日至今任汇添富中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月 18 日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 10 日至今任汇添富国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 6

					日至今任汇添富国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 7 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 8 月 27 日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026 年 6 月 17 日至今任汇添富中证港股通信息技术综合交易型开放式指数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。

乐无穹 2026 年 08 月 03 日离任本基金基金经理。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，资本市场受地缘因素影响出现较大波动，二季度开始地缘冲突逐步缓解，市场对相关事件的敏感性也有所淡化。A 股和港股市场从二季度开始均表现出较强结构化特征，高度聚焦于人工智能产业相关的细分领域，以信息技术相关的芯片设计、半导体材料设备、通信设备等为主。

2 月 28 日，美以突然对伊朗发动联合军事打击，伊朗最高领袖在首轮空袭中身亡。伊朗随后关闭霍尔木兹海峡并进行军事反击。中东地区多方势力被卷入地缘冲突，局部冲突或有升级态势。霍尔木兹海峡承担全球约 20%的原油运输量，关闭霍尔木兹海峡，使得全球能源市场遭受剧烈冲击。布伦特原油在 3 月一度突破 110 美元/桶。全球各国陆续紧急释放战略石油储备。

3 月下旬开始，围绕霍尔木兹海峡的地缘冲突开始出现缓和迹象，4 月初双方达成临时停火，但局势在大方向缓和的背景下依然有多次拉扯。6 月中旬，以双方签署谅解备忘录为标志，霍尔木兹海峡通行量逐步提升，显示出较为实质的改善效果，油价也已回落到接近 3 月初的水平。但当前距离冲突彻底解决依然存在一定的不确定性，美国与其盟友的利益不完全一致是其中的重要原因之一。

全球经济方面，二季度美联储依然维持基准利率不变。5 月新任联储主席就任，6 月议息会议对外发布的信息大幅缩减，且明确放弃前瞻指引，表明联储对市场引导的淡化，希望让市场根据经济数据自行定价。随后市场预期在原本 2026 年内加息不足一次的基础上跳升，达到年内一到两次加息的预期，对市场带来一定的冲击。

国内方面，二季度我国经济延续温和修复态势，结构上依然体现出“内需疲软、外需强劲，且生产强于消费”的特点，投资分项中的地产仍然是主要拖累项。

资本市场角度，不管是 A 股还是港股，都体现出极强的结构化特征。与 AI 产业相关的资产表现强势，而其他行业更多体现为震荡乃至下行。

中证 800 指数上半年小幅上涨 11.1%。主要宽基指数的行业构成中，电子、计算机、通信等 AI 相关的信息技术类上市公司权重占比出现显著提升，也一定程度上反映了资本市场对整体产业转型趋势的动态表征。

港股方面，2026 年以来科技类资产在港股的 IPO 加速，已有 AI 产业链核心的大模型公司在港股上市并陆续入通。头部互联网公司主要受到传统消费类业务拖累，业绩表现不及预期。尽管在 AI 相关的云业务方面依然有突出表现，但股价是公司整体价值的反映，很难剥离出其中的 AI 相关贡献。当前此类公司估值进一步进入性价比较高的区间。而与 AI 更为相关的资产则在 4 月以来表现强劲，与 A 股同类资产表现趋同。港股整体受到全球流动性预期收缩的影响，同时资金面有 IPO 和解禁等压力存在，或难以出现 2025 年前三季度那样普遍的强势行情，需要寻找结构性机会。

恒生指数是综合覆盖港股的代表性指数，是整体投资港股市场的优质工具。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富恒生指数（QDII-LOF）A 类份额净值增长率为-12.80%，同期业绩比较基准收益率为-13.45%。本报告期汇添富恒生指数(QDII-LOF)C 类份额净值增长率为-12.89%，同期业绩比较基准收益率为-13.45%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月开始，上半年强势的 A 股科技板块迎来较大幅度的调整，而港股则有一定的修复迹象。板块之间、区域之间的结构分化差异过大，使得市场逐渐出现“再平衡”的冲动。但长期来看，国际竞争加剧、地缘冲突难以彻底解决，我国对科技领域的投入或将进一步加强，从而加快国产化进度、保障供应链安全。市场整体也容易因为科技板块行情上涨、IPO 增加而出现结构性变化，一定程度上也代表了市场逐渐在这个方向上形成了一定的共识。

当前港股的头部互联网企业仍然具有稀缺性、低估值、高性价比等优势，在经济温和修复的预期下，基本面有望企稳。但海外流动性依然是限制港股快速上涨的重要制约因素。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的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。登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中

的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、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：汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）

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	28,882,505.58	30,752,891.86
结算备付金		1,264,718.25	5,441,541.42
存出保证金		572,573.10	612,427.80
交易性金融资产	6.4.7.2	323,953,416.86	420,193,234.68
其中：股票投资		323,953,416.86	420,193,234.68
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		3,041,284.33	-
应收股利		1,571,199.26	891,283.68
应收申购款		1,269,037.11	1,298,558.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		360,554,734.49	459,189,938.21
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 06 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	1,944,935.24
应付赎回款		11,807,569.90	5,867,621.35
应付管理人报酬		249,022.33	308,034.64
应付托管费		62,255.55	77,008.63
应付销售服务费		7,949.92	10,291.15
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	91,550.83	173,975.76
负债合计		12,218,348.53	8,381,866.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	295,307,324.61	333,186,855.79
未分配利润	6.4.7.9	53,029,061.35	117,621,215.65
净资产合计		348,336,385.96	450,808,071.44
负债和净资产总计		360,554,734.49	459,189,938.21

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 337,632,068.05 份。本基金下属汇添富恒生指数（QDII-LOF）A 基金份额净值 1.0328 元，基金份额总额 251,129,996.51 份；本基金下属汇添富恒生指数(QDII-LOF)C 基金份额净值 1.0284 元，基金份额总额 86,502,071.54 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）

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		**-50,415,723.93**	**79,161,195.04**
1.利息收入		57,508.88	100,621.07
其中：存款利息收入	6.4.7.10	57,508.88	100,621.07
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）		15,483,969.77	33,848,262.04
其中：股票投资收益	6.4.7.11	11,094,924.63	25,752,609.15
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	-642,155.57	946,642.36
股利收益	6.4.7.17	5,031,200.71	7,149,010.53
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	-65,858,479.99	44,819,191.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-124,105.42	371,661.98
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	25,382.83	21,458.29
减：二、营业总支出		**2,268,443.01**	**2,223,256.46**
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,692,110.47	1,628,099.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	423,027.52	422,263.57
3．销售服务费		55,680.82	34,764.36
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		712.81	1,955.60
8．其他费用	6.4.7.21	96,911.39	136,173.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-52,684,166.94**	**76,937,938.58**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-52,684,166.94**	**76,937,938.58**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**-52,684,166.94**	**76,937,938.58**

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）

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	333,186,855.79	117,621,215.65	450,808,071.44
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净	333,186,855.79	117,621,215.65	450,808,071.44

资产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-37,879,531.18	-64,592,154.30	-102,471,685.48
（一）、综合收益总额	-	-52,684,166.94	-52,684,166.94
（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）	-37,879,531.18	-11,907,987.36	-49,787,518.54
其中：1.基金申购款	127,074,786.57	43,455,663.55	170,530,450.12
2.基金赎回款	-164,954,317.75	-55,363,650.91	-220,317,968.66
（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	295,307,324.61	53,029,061.35	348,336,385.96
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	404,914,436.66	34,029,310.06	438,943,746.72
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	404,914,436.66	34,029,310.06	438,943,746.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-104,316,404.23	52,147,698.42	-52,168,705.81
（一）、综合收益总额	-	76,937,938.58	76,937,938.58
（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）	-104,316,404.23	-24,790,240.16	-129,106,644.39
其中：1.基金申购款	139,785,934.55	27,027,704.37	166,813,638.92
2.基金赎回款	-244,102,338.78	-51,817,944.53	-295,920,283.31

（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	300,598,032.43	86,177,008.48	386,775,040.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）（以下简称“本基金”），是由汇添富恒生指数分级证券投资基金变更而来。原汇添富恒生指数分级证券投资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〔2013〕1247 号文《关于核准汇添富恒生指数分级证券投资基金募集的批复》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 2014 年 3 月 6 日生效。首次设立基金募集规模为 1,270,631,138.98 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（2014）验字第 60466941_B03 号验资报告予以验证。

2020 年 10 月 29 日，汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会表决通过了《关于汇添富恒生指数分级证券投资基金转型的议案》，持有人大会决议生效公告日为 2020 年 10 月 30 日。根据转型安排，本基金以 2020 年 11 月 30 日为基金份额转换基准日，将该基准日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的添富恒生份额、恒生 A 份额与恒生 B 份额将转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的添富恒生份额将转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的 A 类基金份额的场外份额。

根据 2020 年 12 月 2 日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富恒生指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告》，本基金以 2020 年 11 月 30 日为基金份额转换基准

日，将恒生 A 份额与恒生 B 份额转换为 136,179,383.00 份添富恒生份额的场内份额，之后将添富恒生份额的场内份额和场外份额分别转换为汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）A 类基金份额的场内份额和场外份额，分别为 143,224,278.00 份和 255,897,879.12 份。

自 2020 年 12 月 1 日起，《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》生效。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，境外托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31

日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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

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。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

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	28,882,505.58
等于：本金	28,879,845.43
加：应计利息	2,660.15
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	28,882,505.58

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		340,242,211.13	-	323,953,416.86	-16,288,794.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	境外 OTC 市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		340,242,211.13	-	323,953,416.86	-16,288,794.27

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	4,970,256.79	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	4,970,256.79	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,970,256.79	-	-	-

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
HSI2607	HANG SENG IDX FUT Jul26	5	4,965,914.04	-4,342.75
合计				-4,342.75
减：可抵销期货暂收款				-4,342.75
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	11,959.70
其中：交易所市场	11,959.70
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	20,083.76
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	91,550.83

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富恒生指数（QDII-LOF）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	280,673,219.58	245,488,700.99
本期申购	68,536,144.62	59,944,618.65
本期赎回（以“-”号填列）	-98,079,367.69	-85,784,374.47

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	251,129,996.51	219,648,945.17

汇添富恒生指数（QDII-LOF）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	100,267,440.41	87,698,154.80
本期申购	76,751,559.23	67,130,167.92
本期赎回（以“-”号填列）	-90,516,928.10	-79,169,943.28
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	86,502,071.54	75,658,379.44

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

汇添富恒生指数（QDII-LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,828,919.16	56,118,908.48	86,947,827.64
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	30,828,919.16	56,118,908.48	86,947,827.64
本期利润	9,772,399.79	-48,587,626.86	-38,815,227.07
本期基金份额交易产生的变动数	-3,909,677.54	-4,497,892.84	-8,407,570.38
其中：基金申购款	8,756,002.32	11,823,214.16	20,579,216.48
基金赎回款	-12,665,679.86	-16,321,107.00	-28,986,786.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,691,641.41	3,033,388.78	39,725,030.19
汇添富恒生指数（QDII-LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	38,357,908.43	-7,684,520.42	30,673,388.01
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	38,357,908.43	-7,684,520.42	30,673,388.01
本期利润	3,401,913.26	-17,270,853.13	-13,868,939.87
本期基金份额交易产生的变动数	-5,592,512.10	2,092,095.12	-3,500,416.98
其中：基金申购款	30,653,422.12	-7,776,975.05	22,876,447.07

基金赎回款	-36,245,934.22	9,869,070.17	-26,376,864.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,167,309.59	-22,863,278.43	13,304,031.16

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	55,247.31
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	1,934.58
其他	326.99
合计	57,508.88

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	96,021,694.92
减：卖出股票成本总额	84,719,789.89
减：交易费用	206,980.40
买卖股票差价收入	11,094,924.63

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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 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
国债期货投资收益	-
外汇期货投资收益	-
股指期货投资收益	-642,155.57
外汇远期投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,031,200.71
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	5,031,200.71

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	-65,853,008.21
——股票投资	-65,853,008.21
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-5,471.78
——权证投资	-
——期货投资	-5,471.78
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	-65,858,479.99

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	25,382.83
替代损益	-
其他	-
合计	25,382.83

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	20,083.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	2,353.06
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	14,967.20
合计	96,911.39

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
中国农业银行股份有限公司（"农业银行"）	基金托管人,基金销售机构
香港上海汇丰银行有限公司（The Hong Kong and Shanghai Banking Co. Ltd.）（"汇丰银行"）	境外资产托管人
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（%）
东方证券	144,266,317.19	95.95	257,243,760.44	82.09

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	34,623.85	94.99	11,959.70	100.00
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（%）
东方证券	61,737.77	78.57	37,250.17	100.00

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	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	1,692,110.47	1,628,099.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	675,958.00	595,999.87
应支付基金管理人的净管理费	1,016,152.47	1,032,099.86

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.80%÷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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。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	423,027.52	422,263.57

注：2025 年 1 月 27 日前，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。经与托管人协商一致，决定自 2025 年 1 月 27 日起，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。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		
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	2,877.79	2,877.79
合计	-	2,877.79	2,877.79
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		
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	合计
东方证券股份有限公司	-	0.64	0.64
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,175.04	1,175.04
合计	-	1,175.68	1,175.68

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 0.10%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.10%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%÷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，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。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
农业银行	27,377,207.14	55,241.36	24,391,085.60	96,183.96
汇丰银行	1,505,298.44	5.95	768,608.01	940.51

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。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，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	28,882,505.58	-	-	-	-	-	28,882,505.58
结算备付金	102.72	-	-	-	-	1,264,615.53	1,264,718.25
存出保证金	7,318.81	-	-	-	-	565,254.29	572,573.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-	323,953,416.86	323,953,416.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	3,041,284.33	3,041,284.33
应收股利	-	-	-	-	-	1,571,19	1,571,19

						9.26	9.26
应收申购款	37,133.20	-	-	-	-	1,231,903.91	1,269,037.11
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	28,927,060.31	-	-	-	-	331,627,674.18	360,554,734.49
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	-	-	-	-	-	11,807,569.90	11,807,569.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	249,022.33	249,022.33
应付托管费	-	-	-	-	-	62,255.55	62,255.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,949.92	7,949.92
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	-	-	-	-	-	91,550.83	91,550.83
负债总计	-	-	-	-	-	12,218,348.53	12,218,348.53
利率敏感度缺口	28,927,060.31	-	-	-	-	319,409,325.65	348,336,385.96
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	30,752,891.86	-	-	-	-	-	30,752,891.86
结算备付金	4,280,721.95	-	-	-	-	1,160,819.47	5,441,541.42
存出保证金	14,939.87	-	-	-	-	597,487.93	612,427.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	420,193,234.68	420,193,234.68
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	-	-	-	-	-	891,283.68	891,283.68
应收申购款	26,767.42	-	-	-	-	1,271,791.35	1,298,558.77
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	35,075,321.10	-	-	-	-	424,114,617.11	459,189,938.21
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	1,944,935.24	1,944,935.24
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,867,621.35	5,867,621.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	308,034.64	308,034.64
应付托管费	-	-	-	-	-	77,008.63	77,008.63
应付销售	-	-	-	-	-	10,291.1	10,291.1

服务费						5	5
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	-	-	-	-	-	173,975.76	173,975.76
负债总计	-	-	-	-	-	8,381,866.77	8,381,866.77
利率敏感度缺口	35,075,321.10	-	-	-	-	415,732,750.34	450,808,071.44

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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	1,505,298.44	-	1,505,298.44
结算备付金	-	1,264,615.53	-	1,264,615.53
存出保证金	-	565,254.29	-	565,254.29
交易性金融资产	-	323,953,416.86	-	323,953,416.86
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-

应收清算款	-	181,798.22	-	181,798.22
应收股利	-	73,197.44	-	73,197.44
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	327,543,580.78	-	327,543,580.78
以外币计价的负债				
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	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	327,543,580.78	-	327,543,580.78
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	406,411.98	-	406,411.98
结算备付金	-	1,160,819.47	-	1,160,819.47
存出保证金	-	597,487.93	-	597,487.93
交易性金融资产	-	420,193,234.68	-	420,193,234.68
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	422,357,954.06	-	422,357,954.06
以外币计价的负债				
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	-	120,271.21	-	120,271.21
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	-	120,271.21	-	120,271.21
资产负债表外汇风险敞口净额	-	422,237,682.85	-	422,237,682.85

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1.除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
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
	港币相对人民币升值 5%	16,377,179.04	21,111,884.14
	港币相对人民币贬值 5%	-16,377,179.04	-21,111,884.14

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	323,953,416.86	93.00	420,193,234.68	93.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	323,953,416.86	93.00	420,193,234.68	93.21

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
	恒生指数(汇率调整)上涨 5%	16,474,273.43	21,217,680.68
	恒生指数(汇率调整)下跌 5%	-16,474,273.43	-21,217,680.68

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	323,953,416.86
第二层次	-
第三层次	-
合计	323,953,416.86

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	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	323,953,416.86	89.85
	其中：普通股	321,895,952.19	89.28
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	2,057,464.67	0.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	30,147,223.83	8.36
8	其他各项资产	6,454,093.80	1.79
9	合计	360,554,734.49	100.00

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 305,475,401.25 元，占期末净值比例为 87.7%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	323,953,416.86	93.00
合计	323,953,416.86	93.00

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	15,486,732.88	4.45

15 原材料	6,860,224.81	1.97
20 工业	17,500,130.80	5.02
25 可选消费	56,208,122.04	16.14
30 日常消费	7,241,054.45	2.08
35 医疗保健	15,451,446.30	4.44
40 金融	110,437,448.36	31.70
45 信息技术	21,524,305.36	6.18
50 电信服务	51,975,391.28	14.92
55 公用事业	8,127,096.61	2.33
60 房地产	13,141,463.97	3.77
合计	323,953,416.86	93.00

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本报告期末未持有积极投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	HSBC Holdings PLC	汇丰控股有限公司	5 HK	香港联合交易所	中国香港	231,200	29,699,615.60	8.53
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	70,600	26,355,176.97	7.57
3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	260,000	20,967,665.55	6.02
4	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港联合交易所	中国香港	2,403,000	16,843,104.00	4.84
5	AIA Group Ltd	友邦保险控股有限公	1299 HK	香港联合交易所	中国香港	262,600	16,296,403.88	4.68

		司						
6	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港联合交易所	中国香港	2,060,000	11,504,639.59	3.30
7	China Mobile Ltd	中国移动有限公司	941 HK	香港联合交易所	中国香港	155,500	10,284,782.83	2.95
8	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	香港交易及结算所有限公司	388 HK	香港联合交易所	中国香港	30,000	9,458,509.50	2.72
9	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	453,600	8,525,603.42	2.45
10	Meituan	美团	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	138,850	8,260,974.47	2.37
11	Semiconductor Manufacturing International Corp	中芯国际集成电路制造有限公司	981 HK	香港联合交易所	中国香港	104,500	8,114,254.67	2.33
12	Bank of China Ltd	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港联合交易所	中国香港	1,776,000	7,697,298.55	2.21
13	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安保险（集团）股份有限公司	2318 HK	香港联合交易所	中国香港	167,500	7,426,862.48	2.13
14	NetEas	网易股	9999 HK	香港联	中国香	39,500	6,943,	1.99

	e Inc	份有限公司		合交易所	港		883.54	
15	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港联合交易所	中国香港	389,000	6,865,436.10	1.97
16	BYD Co Ltd	比亚迪股份有限公司	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	92,000	5,789,233.17	1.66
17	BeOne Medicines Ltd	百济神州有限公司	6160 HK	香港联合交易所	中国香港	30,200	4,469,627.78	1.28
18	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港联合交易所	中国香港	185,000	4,283,775.46	1.23
19	Techtronic Industries Co Ltd	创科实业有限公司	669 HK	香港联合交易所	中国香港	36,500	4,105,418.71	1.18
20	PetroChina Co Ltd	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	香港联合交易所	中国香港	526,000	3,874,149.90	1.11
21	CK Hutchison Holdings Ltd	长江和记实业有限公司	1 HK	香港联合交易所	中国香港	66,608	3,832,720.07	1.10
22	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港联合交易所	中国香港	97,500	3,803,988.44	1.09
23	Baidu Inc	百度集团股份有限公司	9888 HK	香港联合交易所	中国香港	37,750	3,593,538.77	1.03
24	Zijin Mining Group	紫金矿业集团股份有	2899 HK	香港联合交易所	中国香港	148,000	3,522,143.96	1.01

	Co Ltd	限公司						
25	Sun Hung Kai Properties Ltd	新鸿基地产发展有限公司	16 HK	香港联合交易所	中国香港	36,000	3,511,373.94	1.01
26	JD.com Inc	京东集团股份有限公司	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	39,800	3,430,902.78	0.98
27	BOC Hong Kong Holdings Ltd	中银香港（控股）有限公司	2388 HK	香港联合交易所	中国香港	93,000	3,423,250.86	0.98
28	Lenovo Group Ltd	联想集团有限公司	992 HK	香港联合交易所	中国香港	170,000	3,398,983.57	0.98
29	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	宁德时代新能源科技股份有限公司	3750 HK	香港联合交易所	中国香港	5,100	3,109,582.71	0.89
30	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物技术有限公司	2269 HK	香港联合交易所	中国香港	98,000	2,945,079.34	0.85
31	Innovent Biologics Inc	信达生物制药	1801 HK	香港联合交易所	中国香港	41,000	2,834,599.78	0.81
32	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	香港联合交易所	中国香港	80,000	2,787,698.08	0.80
33	Kuaishou Technology	快手科技	1024 HK	香港联合交易所	中国香港	76,800	2,774,913.02	0.80

34	CLP Holdings Ltd	中电控股有限公司	2 HK	香港联合交易所	中国香港	41,000	2,606,692.26	0.75
35	Pop Mart International Group Ltd	泡泡玛特国际集团有限公司	9992 HK	香港联合交易所	中国香港	18,400	2,472,310.20	0.71
36	Geely Automobile Holdings Ltd	吉利汽车控股有限公司	175 HK	香港联合交易所	中国香港	161,000	2,357,644.23	0.68
37	ANTA Sports Products Ltd	安踏体育用品有限公司	2020 HK	香港联合交易所	中国香港	34,800	2,147,524.62	0.62
38	China Resources Land Ltd	华润置地有限公司	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	80,000	2,084,520.00	0.60
39	Link REIT	领展房地产投资信托基金	823 HK	香港联合交易所	中国香港	64,900	2,057,464.67	0.59
40	China Petroleum & Chemical Corp	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港联合交易所	中国香港	564,000	1,959,448.80	0.56
41	Trip.com Group Ltd	携程集团有限公司	9961 HK	香港联合交易所	中国香港	6,850	1,853,885.23	0.53
42	CK Asset Holdings Ltd	长江实业集团有限公司	1113 HK	香港联合交易所	中国香港	47,608	1,826,839.84	0.52
43	Nongfu Spring Co Ltd	农夫山泉股份有限公司	9633 HK	香港联合交易所	中国香港	50,200	1,727,479.94	0.50

44	Power Assets Holdings Ltd	电能实业有限公司	6 HK	香港联合交易所	中国香港	34,500	1,711,000.07	0.49
45	WuXi AppTec Co Ltd	无锡药明康德新药开发股份有限公司	2359 HK	香港联合交易所	中国香港	12,100	1,615,303.23	0.46
46	Hong Kong & China Gas Co Ltd	香港中华煤气有限公司	3 HK	香港联合交易所	中国香港	279,619	1,578,610.04	0.45
47	China Hongqiao Group Ltd	中国宏桥集团有限公司	1378 HK	香港联合交易所	中国香港	87,000	1,515,810.83	0.44
48	WH Group Ltd	万洲国际有限公司	288 HK	香港联合交易所	中国香港	208,000	1,497,658.14	0.43
49	ZTO Express Cayman Inc	中通快递（开曼）有限公司	2057 HK	香港联合交易所	中国香港	9,600	1,430,814.53	0.41
50	Li Auto Inc	理想汽车	2015 HK	香港联合交易所	中国香港	35,000	1,400,797.44	0.40
51	CITIC Ltd	中国中信股份有限公司	267 HK	香港联合交易所	中国香港	145,000	1,336,220.75	0.38
52	Galaxy Entertainment Group Ltd	银河娱乐集团有限公司	27 HK	香港联合交易所	中国香港	49,000	1,252,084.31	0.36
53	MTR Corp Ltd	香港铁路有限公司	66 HK	香港联合交易所	中国香港	46,500	1,231,821.04	0.35
54	CMOC	洛阳栾	3993 HK	香港联	中国香	93,000	1,226,	0.35

	Group Ltd	川钼业集团股份有限公司		合交易所	港		166.78	
55	China Telecom Corp Ltd	中国电信股份有限公司	728 HK	香港联合交易所	中国香港	328,000	1,216,456.39	0.35
56	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	石药集团有限公司	1093 HK	香港联合交易所	中国香港	200,800	1,215,601.73	0.35
57	Midea Group Co Ltd	美的集团股份有限公司	300 HK	香港联合交易所	中国香港	15,400	1,104,830.34	0.32
58	China Mengniu Dairy Co Ltd	中国蒙牛乳业有限公司	2319 HK	香港联合交易所	中国香港	77,000	1,076,072.65	0.31
59	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家股份有限公司	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	60,600	1,051,629.92	0.30
60	J&T Global Express Ltd	极兔速递环球有限公司	1519 HK	香港联合交易所	中国香港	144,400	1,048,499.66	0.30
61	China Overseas Land & Investment Ltd	中国海外发展有限公司	688 HK	香港联合交易所	中国香港	95,500	1,000,335.09	0.29
62	Sino Biopharmaceutical Ltd	中国生物制药有限公司	1177 HK	香港联合交易所	中国香港	257,500	986,303.67	0.28
63	Sunny Optica	舜宇光学科技	2382 HK	香港联合交易	中国香港	17,500	927,177.13	0.27

	l Technology Group Co Ltd	（集团）有限公司		所				
64	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd	翰森制药集团有限公司	3692 HK	香港联合交易所	中国香港	36,000	926,152.24	0.27
65	China Unicom Hong Kong Ltd	中国联合网络通信（香港）股份有限公司	762 HK	香港联合交易所	中国香港	152,000	806,639.76	0.23
66	CK Infrastructure Holdings Ltd	长江基建集团有限公司	1038 HK	香港联合交易所	中国香港	15,500	803,712.74	0.23
67	JD Health International Inc	京东健康股份有限公司	6618 HK	香港联合交易所	中国香港	28,050	800,075.26	0.23
68	Henderson Land Development Co Ltd	恒基兆业地产有限公司	12 HK	香港联合交易所	中国香港	35,991	775,247.58	0.22
69	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	九龙仓置业地产投资有限公司	1997 HK	香港联合交易所	中国香港	41,000	761,353.56	0.22
70	China Resources	华润啤酒（控股）有	291 HK	香港联合交易所	中国香港	40,500	748,551.13	0.21

	Beer Holdings Co Ltd	限公司						
71	Li Ning Co Ltd	李宁有限公司	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	58,000	741,533.25	0.21
72	China Resources Power Holdings Co Ltd	华润电力控股有限公司	836 HK	香港联合交易所	中国香港	50,000	734,793.30	0.21
73	Shenzhou International Group Holdings Ltd	申洲国际集团控股有限公司	2313 HK	香港联合交易所	中国香港	20,600	704,234.24	0.20
74	ENN Energy Holdings Ltd	新奥能源控股有限公司	2688 HK	香港联合交易所	中国香港	19,700	692,288.20	0.20
75	Sands China Ltd	金沙中国有限公司	1928 HK	香港联合交易所	中国香港	60,400	684,608.48	0.20
76	JD Logistics Inc	京东物流股份有限公司	2618 HK	香港联合交易所	中国香港	66,600	679,683.80	0.20
77	New Oriental Education & Technology Group Inc	新东方教育科技集团	9901 HK	香港联合交易所	中国香港	19,200	598,340.62	0.17
78	Aluminum Corp of	中国铝业股份有限公	2600 HK	香港联合交易所	中国香港	92,000	596,103.24	0.17

	China Ltd	司						
79	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	华润万象生活有限公司	1209 HK	香港联合交易所	中国香港	17,000	541,593.04	0.16
80	Laopu Gold Co Ltd	老铺黄金股份有限公司	6181 HK	香港联合交易所	中国香港	1,600	481,385.15	0.14
81	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	周大福珠宝集团有限公司	1929 HK	香港联合交易所	中国香港	49,200	465,785.99	0.13
82	Sinopharm Group Co Ltd	国药控股股份有限公司	1099 HK	香港联合交易所	中国香港	33,200	458,778.53	0.13
83	Haidilao International Holding Ltd	海底捞国际控股有限公司	6862 HK	香港联合交易所	中国香港	48,000	442,752.05	0.13
84	Alibaba Health Information Technology Ltd	阿里健康信息技术有限公司	241 HK	香港联合交易所	中国香港	160,000	428,021.44	0.12
85	Tingyi Cayman Islands	康师傅控股有限公司	322 HK	香港联合交易所	中国香港	48,000	407,732.11	0.12

	Holding Corp							
86	Xinyi Glass Holdings Ltd	信义玻璃控股有限公司	868 HK	香港联合交易所	中国香港	55,000	407,480.23	0.12
87	BYD Electronic International Co Ltd	比亚迪电子（国际）有限公司	285 HK	香港联合交易所	中国香港	19,500	354,316.29	0.10
88	Longfor Group Holdings Ltd	龙湖集团控股有限公司	960 HK	香港联合交易所	中国香港	61,500	319,426.63	0.09
89	Orient Overseas International Ltd	东方海外（国际）有限公司	316 HK	香港联合交易所	中国香港	3,000	317,889.30	0.09
90	Hengan International Group Co Ltd	恒安国际集团有限公司	1044 HK	香港联合交易所	中国香港	15,500	292,675.29	0.08
91	Hang Lung Properties Ltd	恒隆地产有限公司	101 HK	香港联合交易所	中国香港	44,000	263,309.62	0.08
92	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	百威亚太控股有限公司	1876 HK	香港联合交易所	中国香港	49,600	262,788.49	0.08
93	Xinyi Solar Holdings Ltd	信义光能控股有限公司	968 HK	香港联合交易所	中国香港	114,000	203,970.28	0.06

7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	8,509,282.84	1.89
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	8,413,435.13	1.87
3	BeOne Medicines Ltd	6160 HK	4,342,936.03	0.96
4	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	3750 HK	2,799,768.83	0.62
5	HSBC Holdings PLC	5 HK	2,341,133.19	0.52
6	CMOC Group Ltd	3993 HK	2,091,501.19	0.46
7	AIA Group Ltd	1299 HK	1,752,321.34	0.39
8	Xiaomi Corp	1810 HK	1,225,678.54	0.27
9	Meituan	3690 HK	1,208,778.12	0.27
10	China Construction Bank Corp	939 HK	1,205,477.27	0.27
11	J&T Global Express Ltd	1519 HK	1,149,017.84	0.25
12	Laopu Gold Co Ltd	6181 HK	1,112,761.56	0.25
13	China Mobile Ltd	941 HK	951,353.67	0.21
14	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	904,047.41	0.20
15	Aluminum Corp of China Ltd	2600 HK	878,033.30	0.19
16	Industrial &	1398 HK	818,554.41	0.18

	Commercial Bank of China Ltd			
17	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	388 HK	806,892.93	0.18
18	Baidu Inc	9888 HK	770,167.00	0.17
19	NetEase Inc	9999 HK	637,717.40	0.14
20	CNOOC Ltd	883 HK	570,411.37	0.13

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	HSBC Holdings PLC	5 HK	15,979,069.08	3.54
2	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	6,682,512.27	1.48
3	AIA Group Ltd	1299 HK	4,975,935.55	1.10
4	Tencent Holdings Ltd	700 HK	4,593,269.53	1.02
5	China Construction Bank Corp	939 HK	4,247,849.21	0.94
6	Xiaomi Corp	1810 HK	3,336,880.22	0.74
7	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1398 HK	2,899,110.94	0.64
8	China Mobile Ltd	941 HK	2,861,164.68	0.63
9	Meituan	3690 HK	2,853,650.30	0.63
10	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	388 HK	2,703,055.87	0.60
11	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	2,433,899.47	0.54
12	Semiconductor Manufacturing	981 HK	2,244,807.61	0.50

	International Corp			
13	CNOOC Ltd	883 HK	2,043,581.37	0.45
14	Bank of China Ltd	3988 HK	1,846,673.10	0.41
15	BYD Co Ltd	1211 HK	1,845,511.18	0.41
16	CLP Holdings Ltd	2 HK	1,340,940.95	0.30
17	JD.com Inc	9618 HK	1,323,773.43	0.29
18	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	1,268,893.53	0.28
19	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	1,166,516.91	0.26
20	PetroChina Co Ltd	857 HK	1,140,981.99	0.25

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	54,332,980.28
卖出收入（成交）总额	96,021,694.92

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）

1	期货品种_指数	HANG SENG IDX FUT Jul26	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，公允价值变动金额为-4,342.75 元，已包含在结算备付金中。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司、中国工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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	572,573.10
2	应收清算款	3,041,284.33
3	应收股利	1,571,199.26
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,269,037.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,454,093.80

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 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。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§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（%）
汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	20,370	12,328.42	2,829,380.45	1.13	248,300,616.06	98.87
汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	10,321	8,381.17	0.00	0.00	86,502,071.54	100.00
合计	30,691	11,001.01	2,829,380.45	0.84	334,802,687.60	99.16

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	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	22,389.10	0.01
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	1,825.56	0.00
	合计	24,214.66	0.01

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	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	0
	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	0

	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富恒生指数（QDII-LOF）A	汇添富恒生指数（QDII-LOF）C
基金合同生效日（2020 年 12 月 01 日）基金份额总额	399,122,157.12	-
本报告期期初基金份额总额	280,673,219.58	100,267,440.41
本报告期基金总申购份额	68,536,144.62	76,751,559.23
减：本报告期基金总赎回份额	98,079,367.69	90,516,928.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	251,129,996.51	86,502,071.54

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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊

普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
东方证券	3	144,266,317.19	95.95	34,623.85	94.99	
Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	2,989,470.90	1.99	896.83	2.46	
Jefferies International Limited	-	1,718,432.17	1.14	515.55	1.41	
CLSA Limited	-	1,379,002.27	0.92	413.71	1.14	
财通证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
东方财富	2	-	-	-	-	
东海证券	2	-	-	-	-	

方正证券	2	-	-	-	-	
广发证券	2	-	-	-	-	
国金证券	1	-	-	-	-	
国联民生	1	-	-	-	-	
国泰海通	4	-	-	-	-	
华创证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	4	-	-	-	-	
华西证券	2	-	-	-	-	
兴业证券	2	-	-	-	-	
银河证券	2	-	-	-	-	
招商证券	4	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投证券	2	-	-	-	-	
中信证券	3	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies International	-	-	-	-	-	-	-	-

l Limited								
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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：华宝证券（深交所单元）、民生证券（深交所单元）、兴业证券（上交所单元，深交所单元）。

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	汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）更新招募说明书（2026 年 1 月 27 日更新）	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所	2026 年 01 月 27 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）A 类份额调整场内最低申购金额、场内最低赎回份额的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上证报	2026 年 01 月 27 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,	2026 年 03 月 31 日

	易及佣金支付情况（2025 年度）	深交所,上交所,上证报	
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2026 年 03 月 31 日
6	关于汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上证报	2026 年 04 月 01 日
7	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
8	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
9	关于汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上证报	2026 年 05 月 21 日
10	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	关于汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）因境外主要市场节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上证报	2026 年 06 月 29 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恒生指数分级证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》；

3、《汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）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