

# 汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告

2026 年 03 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 04 月 22 日



## § 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|               |   |
|---------------|---|
| 基金简称          | 汇添富中证 500 指数增强  |
| 基金主代码         | 001050  |
| 基金运作方式        | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日       | 2023 年 04 月 25 日  |
| 报告期末基金份额总额(份) | 856,674,341.55  |
| 投资目标          | 本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略          | 本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调                |

|                    |  |                             |                             |
|--------------------|--|-----------------------------|-----------------------------|
|                    | <p>整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；股票投资策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；可转债及可交换债投资策略；股指期货投资策略；股票期权投资策略；融资及转融通证券出借业务投资策略；国债期货投资策略等。</p> |                             |                             |
| 业绩比较基准             | <p>中证 500 指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%</p>  |                             |                             |
| 风险收益特征             | <p>本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。<br/>本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特定风险。</p>  |                             |                             |
| 基金管理人              | <p>汇添富基金管理股份有限公司</p>   |                             |                             |
| 基金托管人              | <p>中国工商银行股份有限公司</p>  |                             |                             |
| 下属分级基金的基金简称        | <p>汇添富中证 500 指数增强<br/>A</p>  | <p>汇添富中证 500 指数增强<br/>C</p> | <p>汇添富中证 500 指数增强<br/>Y</p> |
| 下属分级基金的交易代码        | <p>001050</p>  | <p>016854</p>               | <p>022893</p>               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | <p>628,297,592.87</p>  | <p>203,750,160.92</p>       | <p>24,626,587.76</p>        |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标    | 报告期(2026 年 01 月 01 日 - 2026 年 03 月 31 日) |                  |                  |
|-----------|--|------------------|------------------|
|           | 汇添富中证 500 指数增强 A                         | 汇添富中证 500 指数增强 C | 汇添富中证 500 指数增强 Y |
| 1.本期已实现收益 | 109,008,348.75                           | 33,299,718.21    | 3,566,801.04     |

|                |                  |                |               |
|----------------|------------------|----------------|---------------|
| 2.本期利润         | 16,783,074.83    | -447,884.80    | -1,332,759.04 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0276           | -0.0023        | -0.0650       |
| 4.期末基金资产净值     | 1,303,423,323.85 | 416,585,244.86 | 51,431,534.64 |
| 5.期末基金份额净值     | 2.0745           | 2.0446         | 2.0885        |

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 汇添富中证 500 指数增强 A |          |             |            |               |        |        |
|------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 阶段               | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ① - ③  | ② - ④  |
| 过去三个月            | 1.00%    | 1.43%       | 1.97%      | 1.59%         | -0.97% | -0.16% |
| 过去六个月            | 2.98%    | 1.22%       | 2.69%      | 1.39%         | 0.29%  | -0.17% |
| 过去一年             | 26.27%   | 1.19%       | 28.51%     | 1.31%         | -2.24% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今       | 37.84%   | 1.23%       | 21.93%     | 1.37%         | 15.91% | -0.14% |
| 汇添富中证 500 指数增强 C |          |             |            |               |        |        |
| 阶段               | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ① - ③  | ② - ④  |
| 过去三个月            | 0.90%    | 1.43%       | 1.97%      | 1.59%         | -1.07% | -0.16% |
| 过去六              | 2.77%    | 1.22%       | 2.69%      | 1.39%         | 0.08%  | -0.17% |

| 个月               |          |             |            |               |        |        |
|------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一年             | 25.77%   | 1.19%       | 28.51%     | 1.31%         | -2.74% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今       | 36.22%   | 1.23%       | 21.93%     | 1.37%         | 14.29% | -0.14% |
| 汇添富中证 500 指数增强 Y |          |             |            |               |        |        |
| 阶段               | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ① - ③  | ② - ④  |
| 过去三个月            | 1.13%    | 1.43%       | 1.97%      | 1.59%         | -0.84% | -0.16% |
| 过去六个月            | 3.24%    | 1.22%       | 2.69%      | 1.39%         | 0.55%  | -0.17% |
| 过去一年             | 26.91%   | 1.19%       | 28.51%     | 1.31%         | -1.60% | -0.12% |
| 自基金合同生效起至今       | 25.35%   | 1.14%       | 25.88%     | 1.28%         | -0.53% | -0.14% |

### 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

汇添富中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数增强Y累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023年04月25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。

本基金由原汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金于2023年04月25日转型而来。

本基金于2024年12月13日新增Y类份额。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限<br>(年) | 说明   |
|-----|----------|-------------|------|---------------|--|
|     |          | 任职日期        | 离任日期 |               |  |
| 许一尊 | 本基金的基金经理 | 2023年04月25日 | -    | 16            | 国籍：中国。<br>学历：上海财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年7月加入汇添富基金 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 2 日至 2024 年 7 月 11 日任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至 2025 年 3 月 8 日任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5</p> |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | <p>月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月 19 日至今任汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 14 日至今任汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 31 日至 2025 年 11 月 13 日任汇添富稳元回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 28 日至今任汇添富稳兴回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2026 年 3 月 3 日至今任汇添富中证 A500 指数量化增强型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 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。

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

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

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成

交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，中国经济开局良好，稳中向好态势进一步巩固。生产端保持强势，规模以上工业增加值同比增长加快；出口保持强劲增长，对一带一路国家出口占比持续提升，外贸韧性超出预期。投资端温和改善，基建和制造业投资在政策支持下边际向好，房地产投资仍是主要拖累。消费端温和复苏，社会消费品零售总额同比增速回升，商品消费有所回暖，服务消费保持相对稳定。物价方面，核心 CPI 回暖，PPI 同比降幅持续收窄，“促进物价合理回升”的政策效果逐步显现。货币政策维持稳健偏宽松基调，企业端融资需求恢复好于居民端，中长期贷款余额增速触底回升，M1 与 M2 剪刀差收窄显示货币活化度有所改善。政策方面，财政政策与货币政策继续协同发力，财政赤字率维持较高水平，增量与存量工具并举支持有效投资；央行保持流动性合理充裕，推动社会融资成本低位运行并加强结构性支持；产业政策聚焦“新质生产力”，持续引导金融资源向科技创新领域倾斜。海外方面，美联储降息节奏放缓，美债收益率有所上行，国际地缘政治风险边际有所上升。

报告期内，权益市场整体呈现震荡分化格局。一季度初市场延续了去年四季度的活跃态势，一月份成长动量风格涨幅较大，科技板块表现突出。进入二、三月份，市场成交逐步缩量，行情趋于震荡，风格出现阶段性再均衡，红利、价值风格有所表现。整体来看，一季度市场呈现小盘强于大盘的特征，中小盘指数相对抗跌，大盘蓝筹指数表现承压。选股因子方面，全市场看，价值、质量、盈利能力、低波动等因子表现较好；成长、动量、反转等因子波动较大。

报告期内，本基金使用规则化的多因子选股策略构建组合，努力保持相对均衡的因子配置，结合风险控制模型控制组合相对基准在风格、行业、个股上的偏离，净值收益率落后于业绩比较基准，主要原因是一月份成长动量风格涨幅较大，组合超配的质量、估值类风格整体表现一般，造成一定的超额回撤。当前中证 500 指数具有较鲜明的中盘成长风格，具备较高的成长弹性，是投资者布局中国经济结构转型升级，挖掘细分行业龙头潜力的重要工具。

未来我们将继续保持对量化选股模型和风险控制模型的迭代更新,提高对市场风格变化的应对能力,力争提升超额收益的稳定性。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 500 指数增强 A 类份额净值增长率为 1.00%,同期业绩比较基准收益率为 1.97%。本报告期汇添富中证 500 指数增强 C 类份额净值增长率为 0.90%,同期业绩比较基准收益率为 1.97%。本报告期汇添富中证 500 指数增强 Y 类份额净值增长率为 1.13%,同期业绩比较基准收益率为 1.97%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 1,654,327,305.18 | 92.82        |
|    | 其中:股票             | 1,654,327,305.18 | 92.82        |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 16,006,372.14    | 0.90         |
|    | 其中:债券             | 16,006,372.14    | 0.90         |
|    | 资产支持证券            | —                | —            |
| 4  | 贵金属投资             | —                | —            |
| 5  | 金融衍生品投资           | —                | —            |
| 6  | 买入返售金融资产          | —                | —            |
|    | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | —                | —            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 99,014,888.42    | 5.56         |
| 8  | 其他资产              | 12,905,853.16    | 0.72         |
| 9  | 合计                | 1,782,254,418.90 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 2,010,680.00     | 0.11         |
| B  | 采矿业              | 71,478,236.00    | 4.04         |
| C  | 制造业              | 967,563,069.73   | 54.62        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 33,520,573.41    | 1.89         |
| E  | 建筑业              | 7,722,384.47     | 0.44         |
| F  | 批发和零售业           | 17,735,459.97    | 1.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 12,861,932.80    | 0.73         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 106,808,183.82   | 6.03         |
| J  | 金融业              | 92,004,423.84    | 5.19         |
| K  | 房地产业             | 5,531,129.68     | 0.31         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 5,845,053.00     | 0.33         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 8,657,253.00     | 0.49         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 5,026,296.00     | 0.28         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 3,431,418.00     | 0.19         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 6,143,659.00     | 0.35         |
| S  | 综合               | 2,696,700.00     | 0.15         |
|    | 合计               | 1,349,036,452.72 | 76.15        |

## 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | 1,537,832.00   | 0.09         |
| B  | 采矿业      | 2,321,184.00   | 0.13         |
| C  | 制造业      | 197,723,619.71 | 11.16        |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 8,718,549.00   | 0.49  |
| E | 建筑业              | 4,215,028.40   | 0.24  |
| F | 批发和零售业           | 6,751,027.00   | 0.38  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 8,308,207.66   | 0.47  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 41,397,197.99  | 2.34  |
| J | 金融业              | 14,075,850.56  | 0.79  |
| K | 房地产业             | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业         | 9,002,096.00   | 0.51  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 7,250,188.14   | 0.41  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 1,502,948.00   | 0.08  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -     |
| P | 教育               | 111,804.00     | 0.01  |
| Q | 卫生和社会工作          | 430,110.00     | 0.02  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 1,945,210.00   | 0.11  |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 305,290,852.46 | 17.23 |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

##### 投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 1  | 002156 | 通富微电 | 342,000 | 14,134,860.00 | 0.80 |
| 2  | 000933 | 神火股份 | 439,800 | 13,545,840.00 | 0.76 |
| 3  | 002532 | 天山铝业 | 744,400 | 13,242,876.00 | 0.75 |
| 4  | 601168 | 西部矿业 | 509,600 | 12,740,000.00 | 0.72 |
| 5  | 688002 | 睿创微纳 | 119,238 | 12,066,885.60 | 0.68 |
| 6  | 600988 | 赤峰黄金 | 278,400 | 12,012,960.00 | 0.68 |
| 7  | 300054 | 鼎龙股份 | 236,900 | 11,679,170.00 | 0.66 |
| 8  | 600885 | 宏发股份 | 419,020 | 11,631,995.20 | 0.66 |
| 9  | 600487 | 亨通光电 | 214,300 | 11,285,038.00 | 0.64 |
| 10 | 002273 | 水晶光电 | 493,553 | 10,877,908.12 | 0.61 |

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 300407 | 凯发电气 | 394,400 | 5,111,424.00 | 0.29         |

|   |        |      |         |              |      |
|---|--------|------|---------|--------------|------|
| 2 | 600061 | 国投资本 | 720,292 | 4,991,623.56 | 0.28 |
| 3 | 000597 | 东北制药 | 935,000 | 4,983,550.00 | 0.28 |
| 4 | 000795 | 英洛华  | 569,300 | 4,981,375.00 | 0.28 |
| 5 | 002027 | 分众传媒 | 760,200 | 4,979,310.00 | 0.28 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 15,909,716.08 | 0.90         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 96,656.06     | 0.01         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 地方政府债     | -             | -            |
| 10 | 其他        | -             | -            |
| 11 | 合计        | 16,006,372.14 | 0.90         |

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称        | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019792 | 25 国债<br>19 | 78,000 | 7,858,903.89 | 0.44         |
| 2  | 019827 | 26 国债<br>01 | 45,000 | 4,511,881.23 | 0.25         |
| 3  | 019785 | 25 国债<br>13 | 20,000 | 2,019,019.18 | 0.11         |
| 4  | 019773 | 25 国债<br>08 | 15,000 | 1,519,911.78 | 0.09         |
| 5  | 118063 | 金 05 转      | 680    | 96,656.06    | 0.01         |

|  |  |   |  |  |  |
|--|--|---|--|--|--|
|  |  | 债 |  |  |  |
|--|--|---|--|--|--|

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称     | 持仓量(买/卖) | 合约市值(元)      | 公允价值变动(元)     | 风险说明 |
|-------------------|--------|----------|--------------|---------------|------|
| IC2606            | IC2606 | 6.00     | 8,926,080.00 | -404,040.00   |      |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        |          |              | -404,040.00   |      |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        |          |              | 3,246,346.00  |      |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        |          |              | -1,437,280.00 |      |

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金按照风险管理的原则,以套期保值为目的,参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以

达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时,基金管理人股指期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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

### 5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,694,372.98  |
| 2  | 应收证券清算款 | 6,392,469.94  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 4,819,010.24  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 12,905,853.16 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目            | 汇添富中证 500 指数增强 A | 汇添富中证 500 指数增强 C | 汇添富中证 500 指数增强 Y |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 642,680,439.46   | 165,194,244.96   | 11,943,090.25    |
| 本报告期基金总申购份额   | 347,142,653.23   | 159,338,053.34   | 15,415,165.94    |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 361,525,499.82   | 120,782,137.38   | 2,731,668.43     |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                | -                | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 628,297,592.87   | 203,750,160.92   | 24,626,587.76    |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://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 04 月 22 日