汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 16
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 17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 19
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 19
§5 托管人报告 19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 19
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 19
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 19
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 19
6.1 资产负债表 19
6.2 利润表 21
6.3 净资产变动表 22
6.4 报表附注 24
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
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 50
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 50
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 50
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 50

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....51
7.12 投资组合报告附注.....51
§8 基金份额持有人信息.....52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....52
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.....52
§9 开放式基金份额变动.....52
§10 重大事件揭示.....53
10.1 基金份额持有人大会决议.....53
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.....53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....53
10.4 基金投资策略的改变.....53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....53
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.....54
10.8 其他重大事件.....56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....58
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.....58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....58
§12 备查文件目录.....58
12.1 备查文件目录.....59
12.2 存放地点.....59
12.3 查阅方式.....59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证油气资源 ETF
场内简称	油气 ETF 汇添富
基金主代码	159309
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 05 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	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	658,371,736.00
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	2024 年 06 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。具体的投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证油气资源指数收益率
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，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	方圆
	联系电话	021-28932888	95559
	电子邮箱	service@99fund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-9918	95559
传真		021-28932998	021-62701216
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200010	200336
法定代表人		鲁伟铭	任德奇

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	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)
本期已实现收益	-257,336,594.59
本期利润	-456,858,147.69
加权平均基金份额本期利润	-0.5590
本期加权平均净值利润率	-36.74%
本期基金份额净值增长率	10.15%
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	-138,029,160.88
期末可供分配基金份额利润	-0.2097
期末基金资产净值	834,613,122.18
期末基金份额净值	1.2677
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	26.77%

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

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	-14.78%	1.39%	-14.81%	1.41%	0.03%	-0.02%
过去六个月	10.15%	2.13%	10.51%	2.14%	-0.36%	-0.01%
过去一年	30.61%	1.64%	30.63%	1.65%	-0.02%	-0.01%
自基金合同生效起至今	26.77%	1.52%	19.02%	1.54%	7.75%	-0.02%

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



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2024 年 05 月 31 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
晏阳	本基金的基金经理	2024 年 05 月 31 日	-	10	国籍：中国。学历：哥伦比亚大学统计学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 9 月至 2021 年 8 月任中证指数有限公司研究员、高级研究员。2021 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。2022 年 7 月 13 日至今任汇添富中证上海环交所碳中和

					交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 27 日至今任汇添富北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月 16 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月 14 日至 2026 年 3 月 14 日任汇添富中证上海环交所碳中和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。2023 年 4 月 13 日至今任中证金融地产交易型开

					放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2023 年 5 月 22 日至 2025 年 5 月 16 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 22 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今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 20 日至 2026 年 6 月 29 日任汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券

					投资基金的基金经理。2023 年 7 月 11 日至 2025 年 1 月 22 日任汇添富华证专精特新 100 指数型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 26 日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 21 日至 2026 年 6 月 29 日任汇添富中证 800 价值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。2023 年 11 月 28 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证细分有色金属产业主题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。2023 年 12 月 5 日至 2025 年 8 月

					18 日任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月 2 日至今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联接基金的基金经理。2024 年 4 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 5 月 31 日至今任汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月 12 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2025 年 5 月

					13 日至 2025 年 7 月 28 日任汇添富国证自由现金流指数型证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月 4 日至今任汇添富中证油气资源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。2025 年 7 月 29 日至 2026 年 6 月 22 日任汇添富国证自由现金流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 5 日至今任汇添富中证 800 自由现金流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 11 月 19 日至今任汇添富恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

					2025 年 11 月 25 日至今任汇添富标普港股通低波红利指数型证券投资基金的基金经理。2026 年 3 月 11 日至今任汇添富沪深 300 自由现金流指数型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月 11 日至今任汇添富中证红利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。2026 年 6 月 11 日至今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。2026 年 6 月 30 日至今任汇添富沪深 300 自由现金流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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，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。

4.3.2 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

今年上半年，国民经济运行总体平稳，新动能快速成长。初步核算，上半年国内生产总值同比增长 4.7%，其中一季度同比增长 5.0%，二季度增长 4.3%。生产端，上半年全国规模以上工业增加值同比增长 5.4%，装备制造业和高技术制造业保持较快增长，工业生产总体延续韧性；投资端，上半年全国固定资产投资（不含农户）同比下降 5.7%，其中基础设施投资同比下降 2.4%、制造业投资同比下降 1.2%、房地产开发投资同比下降 18.0%；消费端，社会消费商品和服务零售总额同比增长 2.7%，其中服务零售额增长 5.3%，商品零售额增长 1.1%。物价方面，上半年全国居民消费价格（CPI）同比上涨 1.0%、扣除食品和能源价格后的核心 CPI 同比上涨 1.2%；全国工业生产者出厂价格同比上涨 1.5%，其中 6 月份同比上涨 4.1%。总体来看，上半年经济呈现“外需强于内需、新动能强于传统动能”的结构性特征，出口与先进制造、AI 相关产业景气度较高，但国内有效需求依然不足，房地产延续调整，经济回升向好基础仍需加力巩固。

资本市场方面，上半年 A 股呈现“K 型”结构性行情，行业极致分化、盈利明显分层。分阶段看，年初春季躁动与风险偏好修复推动市场普涨企稳；一季度末受海外流动性收紧预期及地缘冲突扰动市场出现回撤，4 月初美国关税政策冲击一度引发大幅调整；随后随着外部冲击缓和、美伊达成和平协议、盈利修复确认，市场逐步回升并回归科技景气主线，6 月中东地缘风险缓释后市场重回上行。从核心宽基指数看，科创 50 涨幅居前，创业板指和中证 1000 等涨幅明显。分行业来看，上半年电子、通信、建筑材料涨幅居前，机械设备、基础化工等亦表现较好；商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料、钢铁等板块表现靠后。风格方面，成长显著优于价值，中盘成长表现最优、大盘价值表现最弱，超额收益高度集中于 AI 与硬科技制造赛道。受地缘政治冲突影响，国际油价大幅波动，中证油气资源指数也随着时局变化呈现从冲高到回落再到修复的走势过程。

报告期内，本基金按照被动投资的原则，采用完全复制法，实现了对标的指数的良好跟

踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 10.15%，同期业绩比较基准收益率为 10.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中国经济机遇与挑战并存，稳增长政策有望适度加力。财政政策方面，下半年具备加快落地条件，超长期特别国债、8000 亿元新型政策性金融工具及地方专项债资金有望加快形成实物工作量，重点投向“两重”“两新”、城市更新、能源电网、算力网及民生服务等领域，不排除四季度增发政府债券的可能；货币政策方面，随着国际油价趋于回落、人民币升值约束减弱，年内仍有降准降息空间，预计将择机实施，引导融资成本下行；房地产政策方面，更大力度推动市场止跌回稳的措施有望逐步落实，但地产短期难成增长弹性来源，仍需关注地产进一步走弱、外部经贸环境反复及全球 AI 投资持续性等风险。

资本市场方面，从整体上看，当前市场成交活跃、宽基指数估值总体处于合理区间，企业盈利结构性修复过程中 A 股仍具备配置价值，下半年市场有望在风格再平衡中延续震荡上行态势；从风格上看，上半年行业与风格分化已处于历史高位，后续存在向均衡收敛的动力，成长与价值有望适度再平衡；从行业主题上看，一方面 AI 产业链、先进制造、半导体等科技成长方向景气度仍高、有望继续贡献盈利增长，另一方面有色、贵金属等周期资源品及银行、电力、公用事业等高股息防御板块值得均衡配置。展望油气板块，尽管下半年地缘政治冲突或有反复，但对于相关股票的定价将逐步回归中长期基本面，在当前较高的股息率水平下，油气板块的中长期投资性价比较高。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法严格控制偏离，实现对标的指数的紧密跟踪。

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：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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

本报告期内，基金托管人在汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，汇添富基金管理股份有限公司在汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金

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	8,803,346.07	573,826.19
结算备付金		2,467,613.99	177,348.88
存出保证金		1,629,643.87	37,793.75
交易性金融资产	6.4.7.2	825,935,841.71	58,542,090.68
其中：股票投资		825,935,841.71	58,542,090.68
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		1,781,281.72	2,400,893.28
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		840,617,727.36	61,731,952.78
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		5,270,327.85	2,450,398.99
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		355,795.81	26,339.06
应付托管费		71,159.16	5,267.81
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	6.4.7.7	307,322.36	124,817.76

负债合计		6,004,605.18	2,606,823.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	658,371,736.00	51,371,736.00
未分配利润	6.4.7.9	176,241,386.18	7,753,393.16
净资产合计		834,613,122.18	59,125,129.16
负债和净资产总计		840,617,727.36	61,731,952.78

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2677 元，基金份额总额 658,371,736.00 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金

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		**-453,205,526.47**	**-3,719,449.62**
1.利息收入		111,288.85	1,628.79
其中：存款利息收入	6.4.7.10	111,288.85	1,628.79
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）		-267,864,263.51	-789,872.00
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-274,392,282.33	-1,980,869.44
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	-	-
股利收益	6.4.7.17	6,528,018.82	1,190,997.44
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	-199,521,553.10	-3,282,187.14
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	14,069,001.29	350,980.73
减：二、营业总支出		**3,652,621.22**	**260,832.12**
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,974,603.52	167,254.50
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	594,920.70	33,450.92

3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.21	83,097.00	60,126.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-456,858,147.69**	**-3,980,281.74**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-456,858,147.69**	**-3,980,281.74**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**-456,858,147.69**	**-3,980,281.74**

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金

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	51,371,736.00	7,753,393.16	59,125,129.16
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	51,371,736.00	7,753,393.16	59,125,129.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	607,000,000.00	168,487,993.02	775,487,993.02
（一）、综合收益总额	-	-456,858,147.69	-456,858,147.69
（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）	607,000,000.00	625,346,140.71	1,232,346,140.71
其中：1.基金申购款	3,775,000,000.00	2,459,933,290.89	6,234,933,290.89
2.基金赎回款	-3,168,000,000.00	-1,834,587,150.18	-5,002,587,150.18

（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	658,371,736.00	176,241,386.18	834,613,122.18
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	64,371,736.00	-536,713.85	63,835,022.15
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	64,371,736.00	-536,713.85	63,835,022.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	60,000,000.00	-3,118,605.76	56,881,394.24
（一）、综合收益总额	-	-3,980,281.74	-3,980,281.74
（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）	60,000,000.00	861,675.98	60,861,675.98
其中：1.基金申购款	119,000,000.00	-641,647.84	118,358,352.16
2.基金赎回款	-59,000,000.00	1,503,323.82	-57,496,676.18
（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	124,371,736.00	-3,655,319.61	120,716,416.39

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

汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金（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〔2024〕304 号文《关于准予汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2024 年 5 月 31 日生效。首次设立基金募集规模为 441,371,736.00 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（2024）验字第 70015647_B18 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花税

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

2.增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 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。

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	8,803,346.07
等于：本金	8,802,601.91
加：应计利息	744.16
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	8,803,346.07

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		1,021,961,741.03	-	825,935,841.71	-196,025,899.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,021,961,741.03	-	825,935,841.71	-196,025,899.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	252,774.39
其中：交易所市场	252,774.39
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	14,876.39
应付信息披露费	39,671.58
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	307,322.36

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,371,736.00	51,371,736.00
本期申购	3,775,000,000.00	3,775,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,168,000,000.00	-3,168,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	658,371,736.00	658,371,736.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	958,826.52	6,794,566.64	7,753,393.16
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	958,826.52	6,794,566.64	7,753,393.16
本期利润	-257,336,594.59	-199,521,553.10	-456,858,147.69
本期基金份额交易产生的变动数	118,348,607.19	506,997,533.52	625,346,140.71
其中：基金申购款	140,401,321.41	2,319,531,969.48	2,459,933,290.89
基金赎回款	-22,052,714.22	-1,812,534,435.96	-1,834,587,150.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-138,029,160.88	314,270,547.06	176,241,386.18

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	95,177.57
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	14,702.65
其他	1,408.63
合计	111,288.85

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
股票投资收益——买卖股票差价收入	-194,597,681.80
股票投资收益——赎回差价收入	-79,794,600.53
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-274,392,282.33

6.4.7.11.2 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	3,757,932,223.01
减：卖出股票成本总额	3,948,575,122.88
减：交易费用	3,954,781.93
买卖股票差价收入	-194,597,681.80

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	5,002,587,150.18
减：现金支付赎回款总额	3,542,192,369.18
减：赎回股票成本总额	1,540,189,381.53
减：交易费用	-
赎回差价收入	-79,794,600.53

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。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无赎回差价收入。

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

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,528,018.82
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	6,528,018.82

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	-199,521,553.10
——股票投资	-199,521,553.10
——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	-
——权证投资	-
——期货投资	-

3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-199,521,553.10

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	-
替代损益	14,069,001.29
其他	-
合计	14,069,001.29

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	28,549.03
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	83,097.00

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
交通银行股份有限公司（"交通银行"）	基金托管人
东方证券股份有限公司（"东方证券"）	基金管理人的股东
汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

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	333,441,987.96	3.83	-	-

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	58,652.65	3.86	50,644.29	20.04
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（%）
	-	-	-	-

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	2,974,603.52	167,254.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	254,448.76	54,167.59
应支付基金管理人的净管理费	2,720,154.76	113,086.91

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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	594,920.70	33,450.92

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

H＝E×0.10%÷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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	289,437,900.00	43.96	26,810,300.00	52.19

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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
交通银行	8,803,346.07	95,177.57	4,216,378.08	1,526.58

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。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共

同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	8,803,346.07	-	-	-	-	-	8,803,346.07
结算备付金	2,467,613.99	-	-	-	-	-	2,467,613.99
存出保证金	1,629,643.87	-	-	-	-	-	1,629,643.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	825,935,841.71	825,935,841.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,781,281.72	1,781,281.72
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,900,603.93	-	-	-	-	827,717,123.43	840,617,727.36
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	-	-	-	-	-	5,270,327.85	5,270,327.85
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	355,795.81	355,795.81
应付托管费	-	-	-	-	-	71,159.16	71,159.16
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	-	-	-	-	-	307,322.36	307,322.36
负债总计	-	-	-	-	-	6,004,605.18	6,004,605.18
利率敏感度缺口	12,900,603.93	-	-	-	-	821,712,518.25	834,613,122.18
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	573,826.19	-	-	-	-	-	573,826.19
结算备付金	177,348.88	-	-	-	-	-	177,348.88
存出保证金	37,793.75	-	-	-	-	-	37,793.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	58,542,090.68	58,542,090.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,400,893.28	2,400,893.28
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	788,968.82	-	-	-	-	60,942,983.96	61,731,952.78
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	-	-	-	-	-	2,450,398.99	2,450,398.99
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,339.06	26,339.06
应付托管费	-	-	-	-	-	5,267.81	5,267.81
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	-	-	-	-	-	124,817.76	124,817.76
负债总计	-	-	-	-	-	2,606,823.62	2,606,823.62
利率敏感	788,968.	-	-	-	-	58,336,1	59,125,1

度缺口	82					60.34	29.16

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	825,935,841.71	98.96	58,542,090.68	99.01
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	825,935,841.71	98.96	58,542,090.68	99.01

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
	油气资源上涨 5%	41,478,479.45	2,921,954.18
	油气资源下跌 5%	-41,478,479.45	-2,921,954.18

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	825,935,841.71
第二层次	-
第三层次	-
合计	825,935,841.71

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	825,935,841.71	98.25
	其中：股票	825,935,841.71	98.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,270,960.06	1.34
8	其他各项资产	3,410,925.59	0.41
9	合计	840,617,727.36	100.00

注：此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”章

节的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	406,171,919.98	48.67
C	制造业	161,194,228.44	19.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	55,344,037.03	6.63
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,394,854.00	2.92
G	交通运输、仓储和邮政业	178,832,285.26	21.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	825,937,324.71	98.96

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例

					（%）
1	601872	招商轮船	5,764,196	101,276,923.72	12.13
2	002353	杰瑞股份	608,411	92,782,677.50	11.12
3	600028	中国石化	18,300,000	81,618,000.00	9.78
4	601857	中国石油	8,189,500	71,084,860.00	8.52
5	600938	中国海油	2,452,100	66,574,515.00	7.98
6	600026	中远海能	2,976,183	53,392,723.02	6.40
7	600256	广汇能源	7,985,400	39,447,876.00	4.73
8	605090	九丰能源	755,309	28,074,835.53	3.36
9	601975	招商南油	5,846,124	21,806,042.52	2.61
10	600583	海油工程	3,946,300	19,849,889.00	2.38
11	603619	中曼石油	824,300	15,422,653.00	1.85
12	002639	雪人集团	1,096,100	15,246,751.00	1.83
13	600871	石化油服	7,250,400	14,718,312.00	1.76
14	300483	首华燃气	692,082	12,166,801.56	1.46
15	600968	海油发展	3,627,300	12,078,909.00	1.45
16	600688	上海石化	3,922,500	11,492,925.00	1.38
17	601808	中海油服	1,056,802	11,424,029.62	1.37
18	001331	胜通能源	194,675	10,975,776.50	1.32
19	603393	新天然气	454,000	9,720,140.00	1.16
20	300191	潜能恒信	343,000	9,483,950.00	1.14
21	600339	中油工程	2,989,100	9,176,537.00	1.10

22	002221	东华能源	1,689,800	8,888,348.00	1.06
23	300164	通源石油	1,051,121	8,408,968.00	1.01
24	601969	海南矿业	1,062,900	8,407,539.00	1.01
25	300228	富瑞特装	1,065,547	7,885,047.80	0.94
26	300084	海默科技	587,960	7,073,158.80	0.85
27	688377	迪威尔高端制造	291,717	6,878,686.86	0.82
28	603223	恒通股份	503,700	6,573,285.00	0.79
29	000059	华锦股份	1,711,300	6,417,375.00	0.77
30	002554	惠博普	1,662,700	5,187,624.00	0.62
31	000968	蓝焰控股	863,200	5,170,568.00	0.62
32	603727	博迈科	301,300	5,140,178.00	0.62
33	603353	和顺石油	122,600	4,710,292.00	0.56
34	603036	如通股份	294,300	4,255,578.00	0.51
35	000852	石化机械	853,416	4,232,943.36	0.51
36	000554	泰山石油	682,400	3,828,264.00	0.46
37	002828	贝肯能源	353,600	3,737,552.00	0.45
38	002490	山东墨龙	580,700	3,710,673.00	0.44
39	000159	国际实业	684,700	3,683,686.00	0.44
40	002278	神开股份	485,700	3,662,178.00	0.44
41	000096	广聚能源	471,200	3,284,264.00	0.39
42	301158	德石股份	208,196	2,746,105.24	0.33
43	002492	恒基达鑫	435,600	2,356,596.00	0.28

44	301063	海锅股份	112,368	1,883,287.68	0.23

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	600938	中国海油	602,747,661.83	1019.44
2	601872	招商轮船	561,151,806.62	949.09
3	601857	中国石油	539,166,129.19	911.91
4	600028	中国石化	524,964,193.65	887.89
5	600026	中远海能	385,818,461.65	652.55
6	600759	ST 洲际	310,133,492.90	524.54
7	600256	广汇能源	299,976,869.66	507.36
8	601975	招商南油	186,195,515.13	314.92
9	002353	杰瑞股份	179,541,933.00	303.66
10	600583	海油工程	174,079,173.86	294.43
11	603619	中曼石油	160,123,311.90	270.82
12	600871	石化油服	153,265,293.95	259.22
13	601808	中海油服	113,988,835.45	192.79
14	600968	海油发展	106,605,831.61	180.31
15	600339	中油工程	80,625,274.80	136.36
16	601969	海南矿业	78,661,390.69	133.04
17	600688	上海石化	78,171,392.38	132.21
18	300164	通源石油	49,963,971.12	84.51
19	603727	博迈科	38,694,594.65	65.45
20	603353	和顺石油	34,924,161.00	59.07
21	603036	如通股份	33,775,575.00	57.13
22	605090	九丰能源	31,062,690.59	52.54
23	603223	恒通股份	30,996,624.52	52.43
24	600724	宁波富达	30,294,647.48	51.24
25	300483	首华燃气	20,967,941.00	35.46
26	002490	山东墨龙	17,878,998.00	30.24
27	603393	新天然气	13,400,129.00	22.66
28	300191	潜能恒信	12,716,401.07	21.51
29	000968	蓝焰控股	10,262,678.00	17.36

30	000554	泰山石油	9,400,085.00	15.90
31	688377	迪威尔高端制造	8,588,092.74	14.53
32	002639	雪人集团	7,989,021.00	13.51
33	002828	贝肯能源	6,880,133.00	11.64
34	002554	惠博普	6,314,232.00	10.68
35	001331	胜通能源	5,223,699.76	8.83
36	002221	东华能源	4,478,203.00	7.57
37	002094	青岛金王	4,442,621.00	7.51
38	301158	德石股份	3,819,435.80	6.46
39	300228	富瑞特装	3,299,910.00	5.58
40	002492	恒基达鑫	3,128,230.95	5.29
41	300084	海默科技	3,073,454.07	5.20
42	000059	华锦股份	3,031,938.00	5.13
43	002278	神开股份	2,601,807.00	4.40
44	301063	海锅股份	2,514,669.00	4.25
45	000096	广聚能源	1,979,790.00	3.35
46	000159	国际实业	1,906,768.00	3.22
47	000852	石化机械	1,791,468.00	3.03

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	600938	中国海油	507,653,437.93	858.61
2	601872	招商轮船	476,553,007.33	806.01
3	601857	中国石油	435,584,052.28	736.72
4	600028	中国石化	373,534,588.05	631.77
5	600026	中远海能	333,487,622.57	564.04
6	600256	广汇能源	261,303,573.46	441.95
7	600759	ST 洲际	245,031,350.74	414.43
8	601975	招商南油	158,287,929.57	267.72
9	600583	海油工程	134,916,259.51	228.19
10	603619	中曼石油	117,130,685.02	198.11
11	600871	石化油服	111,728,511.43	188.97
12	601808	中海油服	87,928,532.37	148.72
13	600968	海油发展	82,635,894.32	139.76
14	002353	杰瑞股份	72,653,650.00	122.88
15	601969	海南矿业	62,391,695.48	105.52
16	600339	中油工程	62,176,297.00	105.16
17	600688	上海石化	60,405,174.00	102.16

18	603727	博迈科	32,430,747.21	54.85
19	600724	宁波富达	30,315,204.82	51.27
20	603353	和顺石油	28,748,613.20	48.62
21	603036	如通股份	26,302,000.32	44.49
22	603223	恒通股份	24,623,673.70	41.65
23	002094	青岛金王	5,186,554.00	8.77
24	605090	九丰能源	2,962,693.00	5.01
25	301063	海锅股份	2,306,074.00	3.90
26	002639	雪人集团	2,242,819.00	3.79
27	300084	海默科技	2,176,144.00	3.68
28	001331	胜通能源	1,679,454.00	2.84
29	300164	通源石油	1,551,055.00	2.62
30	300191	潜能恒信	1,401,742.00	2.37
31	301158	德石股份	1,370,468.00	2.32

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	4,940,618,538.02
卖出股票收入（成交）总额	3,757,932,223.01

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

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所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,629,643.87
2	应收清算款	1,781,281.72
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	3,410,925.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末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

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		交通银行股份有限公司-汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
11,426	57,620.49	517,830,518.00	78.65	140,541,218.00	21.35	289,437,900.00	43.96

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 05 月 31 日）基金份额总额	441,371,736.00
本报告期期初基金份额总额	51,371,736.00
本报告期基金总申购份额	3,775,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,168,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	658,371,736.00

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的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

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（%）	
华泰证券	2	4,977,032,609.65	57.22	875,456.99	57.67	
国泰海通	2	2,798,569,133.76	32.17	492,297.05	32.43	
东方证券	2	333,441,987.96	3.83	58,652.65	3.86	
广发证券	4	308,922,945.90	3.55	42,368.91	2.79	
银河证券	2	163,270,518.76	1.88	28,715.96	1.89	
招商证券	4	117,313,565.00	1.35	20,635.74	1.36	
财通证券	2	-	-	-	-	
长江证券	3	-	-	-	-	
国联民生	2	-	-	-	-	
华安证券	2	-	-	-	-	
华福证券	2	-	-	-	-	
华金证券	2	-	-	-	-	
摩根大通证券	2	-	-	-	-	
南京证券	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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易

称	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（%）
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加世纪证券为申购赎回代理券商的公告	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 12 日
2	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
3	关于汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	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	关于汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	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 29 日
5	关于汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	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 02 月 02 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金公司为申购赎回代理券商的公告	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 02 月 03 日

7	关于汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	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 02 月 05 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告	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 02 月 26 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加万和证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,上交所,深交所,公司网站,上证报	2026 年 03 月 16 日
10	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
11	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
12	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
13	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
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金新增流动性服务商的公告	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 11 日
15	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2026 年 05 月 22 日
16	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 05 月 22 日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华源证券为申购赎回代理券商的公告	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 06 月 03 日
18	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
交通银行股份有限公司－汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	26,810,300.00	2,265,927,300.00	2,003,299,700.00	289,437,900.00	43.96
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富中证油气资源交易型开放式指数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油气资源交易型开放式指数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