

汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数 证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 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，并由董事长签发。

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 2025 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 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末上市基金前十名持有人	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
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	73
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
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	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证 500 增强策略 ETF
场内简称	500 增
基金主代码	560950
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 07 月 19 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
报告期末基金份额总额（份）	47,483,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 07 月 31 日

注：扩位证券简称：500ETF 增强。

2.2 基金产品说明

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，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%，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；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等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	(010) 66105799

	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	(010) 66105798
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		鲁伟铭	廖林

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	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(2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	1,878,344.42
本期利润	2,690,096.35
加权平均基金份额本期利润	0.0627
本期加权平均净值利润率	6.02%
本期基金份额净值增长率	4.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	4,463,602.64
期末可供分配基金份额利润	0.0940
期末基金资产净值	51,946,602.64
期末基金份额净值	1.0940

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	9.40%

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。

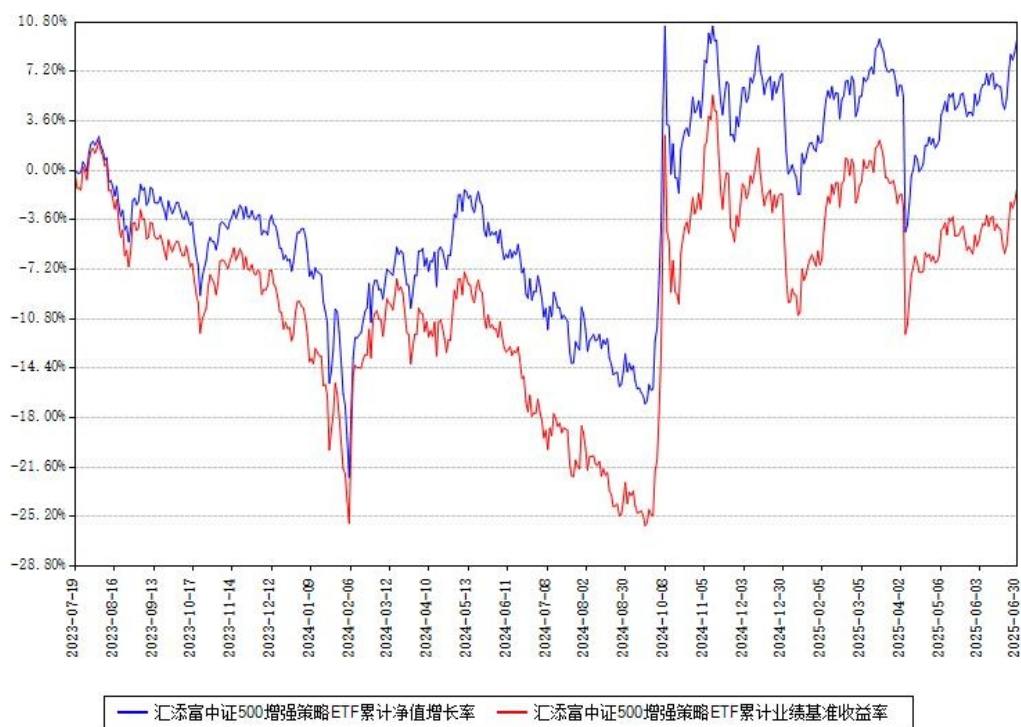
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	4.45%	0.74%	4.31%	0.79%	0.14%	-0.05%
过去三个月	3.77%	1.45%	0.98%	1.50%	2.79%	-0.05%
过去六个月	4.69%	1.25%	3.31%	1.36%	1.38%	-0.11%
过去一年	20.00%	1.53%	19.68%	1.72%	0.32%	-0.19%
自基金合同生效起至今	9.40%	1.37%	-1.44%	1.53%	10.84%	-0.16%

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

汇添富中证500增强策略ETF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 07 月 19 日）起 6 个月，建仓期结束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。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、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、

国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得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。

2025 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 363 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		
许一尊	本基金的基金经理	2023 年 07 月 19 日	-	15	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任

					汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 2 日至 2024 年 7 月 11 日任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至 2025 年 3 月 8 日任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经
--	--	--	--	--	--

					理。2023 年 7 月 19 日至 今任汇添富 中证 500 增 强策略交易 型开放式指 数证券投资 基金的基金 经理。2023 年 11 月 14 日至今任汇 添富稳荣回 报债券型发 起式证券投 资基金的基 金经理。 2024 年 1 月 31 日至今任 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。
--	--	--	--	--	---

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
----	------	-------------	---------	------

许一尊	公募基金	8	6,933,148,142.60	2018 年 3 月 23 日
	私募资产管理计划	1	10,512,840.91	2025 年 3 月 11 日
	其他组合	-	-	
	合计	9	6,943,660,983.51	

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，离任产品情况如下：

许一尊—离任产品类型：公募基金，离任数量：1 只，离任时间：2025 年 3 月 8 日；离任产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0 只，离任时间：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 4 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

报告期内，中国经济在复杂外部环境下呈现复苏态势，整体保持韧性，但内生动能仍显不足。一季度经济稳中有进，制造业 PMI 持续扩张，工业、消费和投资表现良好，工业生产偏强，消费逐步回暖，制造业与高技术产业投资保持高增长，基建托底作用延续，房地产边际改善。二季度经济修复呈现分化态势，生产端维持较强韧性，外需好于预期，但内需仍显疲软，企业内生融资需求不足，呈现弱修复特征。政策层面，财政政策聚焦科技创新、消费提振及稳定传统行业，同时防范房地产下行风险；货币政策维持适度宽松，通过降准、降息及公开市场操作保持流动性合理充裕。外部环境方面，中美贸易政策反复波动，关税加码与阶段性缓和交替出现，对市场预期形成扰动。

权益市场方面，上半年整体呈现震荡上行格局，结构性行情突出。科技成长板块持续领涨，半导体、AI 等新兴领域表现亮眼，带动市场情绪回暖；银行等高股息板块在二季度因避险需求走强，而地产链和传统消费相对疲弱。市场风格整体表现为小盘优于大盘、成长优于价值、高 Beta 优于低 Beta。选股因子方面，短期交易、盈利质量类因子有效性较高，而低估值等逆向类因子相对弱势。

报告期内，本基金使用规则化的多因子选股策略构建组合，保持了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。由于质量、估值等稳健因子配置较多，而区间内高 Beta 风格相对更加强势，区间内超额收益比较一般。未来将继续努力保持对量化选股模型和风险控制模型的迭代更新，提高对市场风格变化的应对能力，提升超额收益的稳定性。

4.4.2 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 4.69%。同期业绩比较基准收益率为 3.31%。

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，中国宏观经济预计在内外复杂环境下延续弱修复态势，呈现“财政托底、外需韧性、内需磨底”的特征。增长节奏或呈“N 型”：7-8 月受高基数、地产二次探底及出口脉冲回落影响，经济可能再度承压；9 月后随着基建投资、公共消费等财政增量工具逐步落地，四季度经济有望温和回升。物价方面，CPI 中枢维持低位，核心通胀疲软；PPI 同比跌幅因能源与黑色系低基数收窄，但难回正区间。政策层面，财政与货币协同发力，财政扩张窗口大概率延后至三季度末，重点支持城市更新、民生等领域，货币政策保持灵活宽松，可能通过降准、降息及国债买卖缓解流动性压力。外部环境方面，全球补库周期支撑外需韧性，但美国关税政策反复可能阶段性扰动出口，国际经贸磋商推进或部分对冲风险。

权益市场方面，随着经济基本面逐步企稳，叠加政策托底，市场下方风险有限。同时，利率处于低位，资金面有所好转，市场参与者对权益市场的信心提升，带动风险偏好回暖，有利于结构性行情的演绎。成长风格受益于流动性维持宽松、AI 产业链景气度提升、政策与地缘因素驱动，可能保持相对强势；同时，高股息资产如银行、公用事业等防御性板块在低利率环境下仍具吸引力，尤其是具备稳定盈利能力和分红能力的龙头个股。选股因子方面，随着上市公司治理水平的提升，长期资金逐步入市，理性投资、价值投资、长期投资得到进一步重视，高质量风格可能存在长期超额收益；在市场风险偏好回暖、交易活跃的背景下，景气度、预期及短期交易类因子也可能有较好表现。

本基金使用量化选股模型挑选个股，保持风格和行业的相对均衡，具有较鲜明的中盘均衡风格。随着投资者信心企稳，基本面质地优良，估值合理，成长空间大的中盘公司可能有所表现。未来将继续努力提升风险管理和组合精细化管理能力，提升对市场风格变动的适应能力，力争获得较为稳定的超额收益。

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：《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；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

自 2025 年 2 月 18 日起至 2025 年 5 月 13 日，本基金连续 57 个工作日基金资产净值低于五千万元。自 2025 年 5 月 15 日起至 2025 年 6 月 27 日，本基金连续 31 个工作日基金资产净值低于五千万元。自 2025 年 6 月 30 日起至报告期末，本基金未再出现基金资产净值预警情形。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,130,134.37	1,216,333.71
结算备付金		327,485.21	323,090.07
存出保证金		17,773.29	22,776.42
交易性金融资产	6.4.7.2	50,387,541.18	48,406,534.61
其中：股票投资		50,387,541.18	48,406,534.61
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		5,927,214.74	1,500,030.07
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		57,790,148.79	51,468,764.88
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 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		5,733,145.91	1,654,463.58
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		25,161.87	39,143.83
应付托管费		3,145.23	4,892.97
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	82,093.14	148,396.03
负债合计		5,843,546.15	1,846,896.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	47,483,000.00	47,483,000.00
未分配利润	6.4.7.9	4,463,602.64	2,138,868.47
净资产合计		51,946,602.64	49,621,868.47
负债和净资产总计		57,790,148.79	51,468,764.88

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0940 元，基金份额总额 47,483,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		2,947,378.95	-1,157,021.17
1. 利息收入		3,093.44	5,713.83
其中：存款利息收入	6.4.7.10	3,093.44	5,713.83
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）		2,083,223.13	364,906.31
其中：股票投资收益	6.4.7.11	1,638,580.72	-312,580.55
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	444,642.41	677,486.86
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	811,751.93	-1,464,469.56
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	49,310.45	-63,171.75
减：二、营业总支出		257,282.60	272,189.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	177,897.70	186,640.97
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	22,237.23	23,330.10
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	57,147.67	62,218.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,690,096.35	-1,429,210.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,690,096.35	-1,429,210.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,690,096.35	-1,429,210.70

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	47,483,000.00	2,138,868.47	49,621,868.47

加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	47,483,000.00	2,138,868.47	49,621,868.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	2,324,734.17	2,324,734.17
（一）、综合收益总额	-	2,690,096.35	2,690,096.35
（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）	-	-365,362.18	-365,362.18
其中：1. 基金申购款	48,000,000.00	2,064,511.01	50,064,511.01
2. 基金赎回款	-48,000,000.00	-2,429,873.19	-50,429,873.19
（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	47,483,000.00	4,463,602.64	51,946,602.64
项目	上年度可比期间		
	2024 年 01 月 01 日至 2024 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	59,483,000.00	-2,684,521.35	56,798,478.65
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	59,483,000.00	-2,684,521.35	56,798,478.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,000,000.00	-2,742,615.32	-742,615.32
（一）、综合收益总额	-	-1,429,210.70	-1,429,210.70
（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）	2,000,000.00	-1,313,404.62	686,595.38

其中：1. 基金申购款	46,000,000.00	-4,644,332.37	41,355,667.63
2. 基金赎回款	-44,000,000.00	3,330,927.75	-40,669,072.25
（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	61,483,000.00	-5,427,136.67	56,055,863.33

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 500 增强策略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[2022]2598 号文《关于准予汇添富中证 500 增强策略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 2023 年 7 月 19 日生效。首次设立基金募集规模为 961,483,000.00 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（2023）验字第 60466941_B35 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格

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》、《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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 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‰；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；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策

的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 号文《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 号文《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 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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 2025 年 06 月 30 日
活期存款	1,130,134.37
等于：本金	1,130,025.96
加：应计利息	108.41
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	1,130,134.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		49,690,535.01	-	50,387,541.18	697,006.17
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		49,690,535.01	-	50,387,541.18	697,006.17

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 2025 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	25,065.47
其中：交易所市场	25,065.47
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	17,356.09
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	82,093.14

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,483,000.00	47,483,000.00
本期申购	48,000,000.00	48,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-48,000,000.00	-48,000,000.00
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	47,483,000.00	47,483,000.00

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	4,178,954.80	-2,040,086.33	2,138,868.47
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	4,178,954.80	-2,040,086.33	2,138,868.47
本期利润	1,878,344.42	811,751.93	2,690,096.35
本期基金份额交易产生的变动数	364,306.38	-729,668.56	-365,362.18
其中：基金申购款	5,598,384.66	-3,533,873.65	2,064,511.01

基金赎回款	-5,234,078.28	2,804,205.09	-2,429,873.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,421,605.60	-1,958,002.96	4,463,602.64

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	2,063.19
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	996.28
其他	33.97
合计	3,093.44

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
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,713,629.79
股票投资收益——赎回差价收入	-75,049.07
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	1,638,580.72

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
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	133,604,217.46
减：卖出股票成本总额	131,759,631.92
减：交易费用	130,955.75
买卖股票差价收入	1,713,629.79

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
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

赎回基金份额对价总额	50,429,873.19
减：现金支付赎回款总额	26,704,047.19
减：赎回股票成本总额	23,800,875.07
减：交易费用	—
赎回差价收入	-75,049.07

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

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	444,642.41
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	444,642.41

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	811,751.93
——股票投资	811,751.93
——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	811,751.93

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	—
替代损益	49,310.45
其他	—
合计	49,310.45

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	—
账户维护费	—
银行费用	120.00
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	57,147.67

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人

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 2025 年 01 月 01 日至	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至
-------	----------------------	---------------------------

	2025 年 06 月 30 日		2024 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	-	-	242,134,840.12	85.18

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 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 (%)
	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	178,186.78	92.64	99,736.15	94.41

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。截至 2024 年 6 月 30 日止，该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	177,897.70	186,640.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	28,223.81	5,909.63
应支付基金管理人的净管理费	149,673.89	180,731.34

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：

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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。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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,237.23	23,330.10

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：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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
工商银行	1,130,134.37	2,063.19	2,127,754.41	2,540.81

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：本基金本报告期末未进行利润分配。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（2025 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 2025 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 2025 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 2025 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 2025 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	1,130,134.37	-	-	-	-	-	1,130,134.37
结算备付金	327,485.21	-	-	-	-	-	327,485.21
存出保证金	17,773.29	-	-	-	-	-	17,773.29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	50,387,541.18	50,387,541.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	5,927,214.74	5,927,214.74
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-

递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	1,475,392.87	-	-	-	-	56,314,755.92	57,790,148.79
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	-	-	-	-	-	5,733,145.91	5,733,145.91
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	25,161.87	25,161.87
应付 托管 费	-	-	-	-	-	3,145.23	3,145.23
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	-	-	-	-	-	82,093.14	82,093.14
负债总计	-	-	-	-	-	5,843,546.15	5,843,546.15
利率敏感 度缺口	1,475,392.87	-	-	-	-	50,471,209.77	51,946,602.64
上年度末 2024 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	1,216,333.71	-	-	-	-	-	1,216,333.71
结算备付金	323,090.07	-	-	-	-	-	323,090.07
存出保证金	22,776.42	-	-	-	-	-	22,776.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-	48,406,534.61	48,406,534.61
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-	1,500,030.07	1,500,030.07
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,562,200.20	-	-	-	-	49,906,564.68	51,468,764.88
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	-	-	-	-	-	1,654,463.58	1,654,463.58
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	39,143.83	39,143.83
应付托管费	-	-	-	-	-	4,892.97	4,892.97

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	-	-	-	-	-	148,396.03	148,396.03
负债 总计	-	-	-	-	-	1,846,896.41	1,846,896.41
利率 敏感 度缺 口	1,562,200.20	-	-	-	-	48,059,668.27	49,621,868.47

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 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 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	50,387,541.18	97.00	48,406,534.61	97.55
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	50,387,541.18	97.00	48,406,534.61	97.55

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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上涨 5%	2,358,194.75	2,184,081.33
	中证 500 指数下跌 5%	-2,358,194.75	-2,184,081.33

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 2025 年 06 月 30 日
第一层次	50,387,541.18
第二层次	—
第三层次	—
合计	50,387,541.18

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	50,387,541.18	87.19
	其中：股票	50,387,541.18	87.19
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	1,457,619.58	2.52
8	其他各项资产	5,944,988.03	10.29
9	合计	57,790,148.79	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	250,838.00	0.48
B	采矿业	1,524,533.00	2.93
C	制造业	27,348,552.17	52.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,482,049.00	2.85
E	建筑业	153,462.00	0.30
F	批发和零售业	1,044,982.66	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	377,615.20	0.73
H	住宿和餐饮业	202,137.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,346,035.63	6.44
J	金融业	3,940,104.27	7.58
K	房地产业	505,638.00	0.97
L	租赁和商务服务业	74,664.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	260,155.00	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	105,084.00	0.20

O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	59,772.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	911,474.00	1.75
S	综合	117,463.00	0.23
	合计	41,704,558.93	80.28

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

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	—	—
C	制造业	6,627,656.25	12.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	319,932.00	0.62
E	建筑业	168,245.00	0.32
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	860,980.00	1.66
J	金融业	264,556.00	0.51
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	164,542.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	6,375.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	71,108.00	0.14
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	199,588.00	0.38
S	综合	—	—
	合计	8,682,982.25	16.72

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	300207	欣旺达	22,800	457,368.00	0.88
2	600487	亨通光电	29,400	449,820.00	0.87
3	601168	西部矿业	26,900	447,347.00	0.86
4	002410	广联达	30,100	403,641.00	0.78
5	002532	天山铝业	48,500	403,035.00	0.78
6	600096	云天化	18,300	402,051.00	0.77
7	300339	润和软件	7,800	396,474.00	0.76
8	000423	东阿阿胶	7,500	392,250.00	0.76
9	002414	高德红外	38,063	390,145.75	0.75
10	601717	郑煤机	22,600	375,612.00	0.72
11	300017	网宿科技	34,900	374,128.00	0.72
12	600885	宏发股份	16,260	362,760.60	0.70
13	601555	东吴证券	41,300	361,375.00	0.70
14	600497	驰宏锌锗	67,800	358,662.00	0.69
15	002223	鱼跃医疗	10,000	356,000.00	0.69
16	002673	西部证券	45,000	354,600.00	0.68
17	002152	广电运通	26,100	350,784.00	0.68
18	600862	中航高科	13,200	344,256.00	0.66
19	601933	永辉超市	69,200	339,080.00	0.65
20	002056	横店东磁	23,700	335,355.00	0.65
21	000738	航发控制	15,800	327,850.00	0.63
22	688469	芯联集成	67,900	323,883.00	0.62

23	000050	深天马 A	37,300	317,796.00	0.61
24	601456	国联民生	30,600	316,710.00	0.61
25	300373	扬杰科技	6,100	316,590.00	0.61
26	600663	陆家嘴	35,600	315,416.00	0.61
27	600873	梅花生物	29,500	315,355.00	0.61
28	002273	水晶光电	15,600	311,532.00	0.60
29	002202	金风科技	30,200	309,550.00	0.60
30	601958	金钼股份	28,200	308,508.00	0.59
31	600498	烽火通信	14,600	307,038.00	0.59
32	000027	深圳能源	46,600	297,308.00	0.57
33	000988	华工科技	6,300	296,163.00	0.57
34	688099	晶晨半导体	4,085	290,075.85	0.56
35	601098	中南传媒	22,100	289,952.00	0.56
36	600959	江苏有线	83,900	288,616.00	0.56
37	688249	晶合集成	14,100	285,807.00	0.55
38	688122	西部超导	5,420	281,189.60	0.54
39	000729	燕京啤酒	21,600	279,288.00	0.54
40	600637	东方明珠	37,374	279,183.78	0.54
41	002939	长城证券	33,300	279,054.00	0.54
42	600062	华润双鹤	14,900	278,034.00	0.54
43	300595	欧普康视	18,100	276,387.00	0.53
44	002500	山西证券	44,500	259,880.00	0.50

45	600298	安琪酵母	7,300	256,741.00	0.49
46	601991	大唐发电	80,800	256,136.00	0.49
47	600380	健康元	23,100	254,793.00	0.49
48	300496	中科创达	4,400	251,768.00	0.48
49	003022	联泓新科	15,700	248,531.00	0.48
50	000825	太钢不锈	69,200	248,428.00	0.48
51	601019	山东出版	26,200	248,114.00	0.48
52	300054	鼎龙股份	8,600	246,648.00	0.47
53	002155	湖南黄金	13,760	245,616.00	0.47
54	000060	中金岭南	53,000	242,740.00	0.47
55	300458	全志科技	6,100	242,109.00	0.47
56	002299	圣农发展	16,800	240,072.00	0.46
57	300346	南大光电	7,500	237,300.00	0.46
58	603529	爱玛科技	6,800	233,920.00	0.45
59	000021	深科技	12,300	230,502.00	0.44
60	603596	伯特利	4,200	221,298.00	0.43
61	000066	中国长城	14,800	219,040.00	0.42
62	600060	海信视像	9,500	218,690.00	0.42
63	000933	神火股份	13,100	217,984.00	0.42
64	600299	安迪苏	22,400	216,160.00	0.42
65	688002	睿创微纳	3,100	216,132.00	0.42
66	600352	浙江龙盛	21,200	215,392.00	0.41
67	002841	视源股份	6,200	214,520.00	0.41
68	300285	国瓷材	11,500	199,525.00	0.38

		料			
69	300395	菲利华	3,900	199,290.00	0.38
70	300529	健帆生物	9,200	198,444.00	0.38
71	000636	风华高科	14,300	196,482.00	0.38
72	600536	中国软件	4,200	196,434.00	0.38
73	000598	兴蓉环境	27,100	195,391.00	0.38
74	600598	北大荒	13,500	194,670.00	0.37
75	601568	北元集团	46,800	194,220.00	0.37
76	000528	柳工	20,100	193,161.00	0.37
77	600079	人福医药	9,100	190,918.00	0.37
78	600879	航天电子	18,200	190,554.00	0.37
79	600038	中直股份	4,900	190,169.00	0.37
80	002294	信立泰	4,000	189,320.00	0.36
81	000959	首钢股份	55,440	188,496.00	0.36
82	002078	太阳纸业	14,000	188,440.00	0.36
83	002340	格林美	29,600	187,960.00	0.36
84	600988	赤峰黄金	7,500	186,600.00	0.36
85	002138	顺络电子	6,600	185,592.00	0.36
86	002353	杰瑞股份	5,300	185,500.00	0.36
87	002185	华天科技	18,100	182,810.00	0.35
88	601231	环旭电子	12,100	177,023.00	0.34
89	300140	节能环保	28,500	175,845.00	0.34
90	002064	华峰化学	26,200	173,182.00	0.33
91	000739	普洛药业	11,600	162,400.00	0.31
92	000034	神州数	4,300	161,852.00	0.31

		码			
93	601179	中国西电	26,300	161,482.00	0.31
94	000783	长江证券	23,200	160,776.00	0.31
95	688728	格科微有限公司	10,400	160,160.00	0.31
96	002595	豪迈科技	2,700	159,894.00	0.31
97	600704	物产中大	30,300	159,681.00	0.31
98	600109	国金证券	18,101	158,745.77	0.31
99	600765	中航重机	9,400	158,672.00	0.31
100	600906	财达证券	23,000	156,860.00	0.30
101	688521	芯原微电子	1,600	154,400.00	0.30
102	600118	中国卫星	5,400	154,278.00	0.30
103	002472	双环传动	4,600	154,054.00	0.30
104	002065	东华软件	15,700	150,720.00	0.29
105	600143	金发科技	14,600	150,526.00	0.29
106	600909	华安证券	25,800	150,414.00	0.29
107	002507	涪陵榨菜	11,690	149,515.10	0.29
108	601965	中国汽研	8,400	149,100.00	0.29
109	300223	北京君正	2,100	145,320.00	0.28
110	002624	完美世界	9,400	142,598.00	0.27
111	000728	国元证券	18,000	142,020.00	0.27
112	688387	中信科移动	24,800	140,120.00	0.27
113	002773	康弘药业	4,800	139,056.00	0.27

114	002966	苏州银行	15,800	138,724.00	0.27
115	600582	天地科技	23,000	137,770.00	0.27
116	600258	首旅酒店	9,700	137,061.00	0.26
117	601615	明阳智能	11,900	136,731.00	0.26
118	000887	中鼎股份	7,700	135,443.00	0.26
119	603160	汇顶科技	1,900	134,957.00	0.26
120	002430	杭氧股份	6,900	133,998.00	0.26
121	300037	新宙邦	3,800	133,760.00	0.26
122	600312	平高电气	8,600	132,354.00	0.25
123	600839	四川长虹	13,400	130,248.00	0.25
124	000960	锡业股份	8,500	130,050.00	0.25
125	601665	齐鲁银行	20,400	128,928.00	0.25
126	000009	中国宝安	14,500	128,760.00	0.25
127	603345	安井食品	1,600	128,672.00	0.25
128	300919	中伟股份	3,900	128,232.00	0.25
129	300699	光威复材	4,000	126,680.00	0.24
130	601928	凤凰传媒	11,300	126,221.00	0.24
131	300604	长川科技	2,800	125,748.00	0.24
132	002444	巨星科技	4,900	124,999.00	0.24
133	002436	兴森科技	9,400	124,456.00	0.24
134	000932	华菱钢铁	28,000	123,200.00	0.24
135	601696	中银证券	11,400	121,866.00	0.23

136	600901	江苏金租	20,000	121,200.00	0.23
137	600699	均胜电子	6,900	120,336.00	0.23
138	002085	万丰奥威	7,500	119,175.00	0.23
139	600673	东阳光	10,100	117,463.00	0.23
140	600177	雅戈尔	15,900	116,070.00	0.22
141	000878	云南铜业	9,100	115,752.00	0.22
142	688278	特宝生物	1,600	115,376.00	0.22
143	605358	立昂微	4,900	114,170.00	0.22
144	002385	大北农	28,200	113,928.00	0.22
145	600398	海澜之家	16,300	113,448.00	0.22
146	300012	华测检测	9,500	111,055.00	0.21
147	688220	翱捷科技	1,400	109,620.00	0.21
148	600369	西南证券	25,100	109,185.00	0.21
149	600578	京能电力	24,300	109,107.00	0.21
150	688180	君实生物	3,200	108,736.00	0.21
151	000750	国海证券	26,200	107,944.00	0.21
152	600007	中国国贸	5,200	107,016.00	0.21
153	600316	洪都航空	2,800	105,560.00	0.20
154	603939	益丰药房	4,300	105,221.00	0.20
155	601233	桐昆股份	9,900	104,940.00	0.20
156	603228	景旺电子	2,500	104,600.00	0.20
157	000400	许继电气	4,800	104,496.00	0.20
158	601216	君正集团	18,800	103,776.00	0.20
159	600098	广州发	16,600	103,750.00	0.20

		展			
160	002739	万达电 影	9,000	102,870.00	0.20
161	002025	航天电 器	2,000	102,820.00	0.20
162	600141	兴发集 团	4,900	100,597.00	0.19
163	600535	天士力	6,400	100,160.00	0.19
164	002156	通富微 电	3,900	99,918.00	0.19
165	603156	养元饮 品	4,700	99,452.00	0.19
166	600132	重庆啤 酒	1,800	99,180.00	0.19
167	000039	中集集 团	12,400	97,464.00	0.19
168	002653	海思科	2,300	97,106.00	0.19
169	600863	内蒙华 电	23,200	95,352.00	0.18
170	600995	南网储 能	9,400	91,932.00	0.18
171	600707	彩虹股 份	14,200	91,732.00	0.18
172	603568	伟明环 保	4,800	91,584.00	0.18
173	601108	财通证 券	11,500	90,965.00	0.18
174	000513	丽珠集 团	2,500	90,100.00	0.17
175	001696	宗申动 力	4,000	89,800.00	0.17
176	601990	南京证 券	11,100	89,688.00	0.17
177	300623	捷捷微 电	3,000	89,400.00	0.17
178	603786	科博达	1,600	88,656.00	0.17
179	300573	兴齐眼 药	1,700	88,043.00	0.17
180	600998	九州通	16,769	86,192.66	0.17
181	600583	海油工 程	15,700	85,722.00	0.17
182	601128	常熟银 行	11,500	84,755.00	0.16

183	601000	唐山港	20,720	84,123.20	0.16
184	002262	恩华药业	4,000	83,120.00	0.16
185	000987	越秀资本	12,100	83,006.00	0.16
186	688213	思特威电子科技	800	81,776.00	0.16
187	600021	上海电力	9,200	80,868.00	0.16
188	603000	人民网	4,000	80,840.00	0.16
189	002423	中粮资本	6,600	80,718.00	0.16
190	603338	浙江鼎力	1,700	80,580.00	0.16
191	000683	博源化工	16,700	79,993.00	0.15
192	603298	杭叉集团	3,800	79,610.00	0.15
193	000830	鲁西化工	7,600	78,280.00	0.15
194	000921	海信家电	3,000	77,100.00	0.15
195	600499	科达制造	7,800	76,440.00	0.15
196	600685	中船防务	2,800	76,132.00	0.15
197	600373	中文传媒	7,400	75,998.00	0.15
198	600511	国药股份	2,600	75,816.00	0.15
199	001286	陕西能源	8,700	75,690.00	0.15
200	600153	建发股份	7,200	74,664.00	0.14
201	688578	艾力斯医药科技	800	74,432.00	0.14
202	300888	稳健医疗	1,800	73,980.00	0.14
203	300001	特锐德	3,000	71,910.00	0.14
204	301358	湖南裕能	2,300	71,737.00	0.14

205	000155	川能动力	7,300	71,686.00	0.14
206	600739	辽宁成大	6,500	71,500.00	0.14
207	300677	英科医疗	3,000	71,040.00	0.14
208	000709	河钢股份	32,700	70,632.00	0.14
209	000559	万向钱潮	9,200	70,380.00	0.14
210	002429	兆驰股份	15,800	69,204.00	0.13
211	002261	拓维信息	2,200	68,090.00	0.13
212	002797	第一创业	9,600	67,968.00	0.13
213	688772	珠海冠宇电池	4,700	67,163.00	0.13
214	002958	青农商行	18,500	66,785.00	0.13
215	603858	步长制药	4,100	66,584.00	0.13
216	002120	韵达股份	9,900	66,330.00	0.13
217	600517	国网英大	13,000	66,300.00	0.13
218	603605	珀莱雅	800	66,232.00	0.13
219	688065	凯赛生物	1,400	65,940.00	0.13
220	300735	光弘科技	2,600	65,260.00	0.13
221	600754	锦江酒店	2,900	65,076.00	0.13
222	002603	以岭药业	4,600	64,860.00	0.12
223	600970	中材国际	7,400	63,492.00	0.12
224	600282	南钢股份	14,700	61,740.00	0.12
225	000032	深桑达 A	3,000	60,690.00	0.12
226	688425	铁建重工	14,500	59,160.00	0.11

227	002831	裕同科技	2,500	58,550.00	0.11
228	603650	彤程新材	1,800	57,870.00	0.11
229	600529	山东药玻	2,600	57,564.00	0.11
230	601118	海南橡胶	11,900	56,168.00	0.11
231	300136	信维通信	2,500	56,000.00	0.11
232	600968	海油发展	13,700	55,896.00	0.11
233	002508	老板电器	2,900	55,129.00	0.11
234	300627	华测导航	1,560	54,600.00	0.11
235	600801	华新水泥	4,600	54,464.00	0.10
236	600528	中铁工业	7,300	53,874.00	0.10
237	300476	胜宏科技	400	53,752.00	0.10
238	601228	广州港	16,400	52,972.00	0.10
239	603658	安图生物	1,400	52,500.00	0.10
240	000429	粤高速 A	3,900	51,987.00	0.10
241	603225	新凤鸣	4,700	50,055.00	0.10
242	601598	中国外运	10,100	49,793.00	0.10
243	603565	中谷物流	5,200	49,660.00	0.10
244	600483	福能股份	5,100	49,164.00	0.09
245	600848	上海临港	5,200	47,164.00	0.09
246	002372	伟星新材	4,500	46,620.00	0.09
247	603233	大参林	2,800	45,640.00	0.09
248	688114	华大智造	700	45,381.00	0.09
249	300115	长盈精密	2,100	44,940.00	0.09

250	300383	光环新网	3,100	44,330.00	0.09
251	600131	国网信通	2,500	44,250.00	0.09
252	600348	华阳股份	6,600	43,956.00	0.08
253	002409	雅克科技	800	43,752.00	0.08
254	601921	浙版传媒	5,400	43,524.00	0.08
255	002572	索菲亚	3,100	43,431.00	0.08
256	002203	海亮股份	4,100	42,312.00	0.08
257	600435	北方导航	2,700	42,093.00	0.08
258	300024	机器人	2,400	41,232.00	0.08
259	688563	航空材料股份	700	39,641.00	0.08
260	300803	指南针	475	38,313.50	0.07
261	000898	鞍钢股份	16,500	38,280.00	0.07
262	600925	苏能股份	7,200	37,656.00	0.07
263	000937	冀中能源	6,500	37,375.00	0.07
264	600271	航天信息	4,000	36,960.00	0.07
265	688702	盛科通信	600	36,648.00	0.07
266	600549	厦门钨业	1,700	35,564.00	0.07
267	300751	迈为股份	500	34,780.00	0.07
268	301267	华夏眼科	1,800	34,506.00	0.07
269	301301	川宁生物	2,800	33,712.00	0.06
270	000563	陕国投 A	9,400	33,558.00	0.06
271	002608	江苏国信	4,500	32,985.00	0.06
272	603707	健友股份	2,900	32,335.00	0.06

273	600325	华发股份	6,600	32,142.00	0.06
274	002080	中材科技	1,600	31,200.00	0.06
275	000733	振华科技	600	30,030.00	0.06
276	600820	隧道股份	4,800	29,280.00	0.06
277	002563	森马服饰	5,400	28,404.00	0.05
278	688475	萤石网络	900	28,368.00	0.05
279	301165	锐捷网络	460	28,271.60	0.05
280	688819	天能电池集团股份	1,002	27,815.52	0.05
281	600985	淮北矿业	2,400	27,216.00	0.05
282	002683	广东宏大	800	27,152.00	0.05
283	002670	国盛金控	1,800	27,090.00	0.05
284	002517	恺英网络	1,300	25,103.00	0.05
285	300144	宋城演艺	2,900	24,795.00	0.05
286	600004	白云机场	2,500	22,750.00	0.04
287	300679	电连技术	500	22,690.00	0.04
288	600032	浙江新能	3,000	22,680.00	0.04
289	601666	平煤股份	2,900	21,489.00	0.04
290	000893	亚钾国际	700	21,098.00	0.04
291	600763	通策医疗	500	20,640.00	0.04
292	603556	海兴电力	800	20,376.00	0.04
293	688385	复旦微电	400	19,708.00	0.04
294	688349	三一重	700	17,458.00	0.03

		能			
295	300724	捷佳伟创	300	16,290.00	0.03
296	002008	大族激光	600	14,622.00	0.03
297	601577	长沙银行	1,400	13,916.00	0.03
298	300070	碧水源	3,000	13,500.00	0.03
299	600295	鄂尔多斯	800	6,968.00	0.01
300	601212	白银有色	1,800	5,634.00	0.01
301	002044	美年健康	900	4,626.00	0.01
302	002244	滨江集团	400	3,900.00	0.01

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

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	300303	聚飞光电	29,300	185,762.00	0.36
2	600237	铜峰电子	25,500	184,875.00	0.36
3	300686	智动力	18,500	184,815.00	0.36
4	300241	瑞丰光电	31,800	181,260.00	0.35
5	002331	皖通科技	22,500	181,125.00	0.35
6	603987	康德莱	23,500	180,950.00	0.35
7	002367	康力电梯	25,700	180,671.00	0.35
8	300259	新天科技	50,600	179,630.00	0.35
9	002454	松芝股份	23,100	178,332.00	0.34
10	000166	申万宏源	35,400	177,708.00	0.34
10	300150	世纪瑞	35,400	177,708.00	0.34

		尔			
12	000404	长虹华意	25,000	177,500.00	0.34
13	300658	延江股份	27,400	177,278.00	0.34
14	002282	博深股份	23,700	177,039.00	0.34
15	002160	常铝股份	40,900	176,688.00	0.34
16	300509	新美星	20,500	175,480.00	0.34
17	002209	达意隆	13,900	174,445.00	0.34
18	600488	津药药业	41,700	173,889.00	0.33
19	300160	秀强股份	30,900	173,658.00	0.33
20	002228	合兴包装	49,100	173,323.00	0.33
21	000156	华数传媒	21,700	172,298.00	0.33
22	002375	亚厦股份	43,700	168,245.00	0.32
23	601728	中国电信	21,400	165,850.00	0.32
24	600662	外服控股	32,200	164,542.00	0.32
25	300335	迪森股份	29,600	161,616.00	0.31
26	002479	富春环保	31,600	158,316.00	0.30
27	600742	富维股份	15,800	150,258.00	0.29
28	600703	三安光电	11,900	147,798.00	0.28
29	603886	元祖股份	11,100	145,077.00	0.28
30	603115	海星股份	9,500	137,085.00	0.26
31	002950	奥美医疗	15,600	134,160.00	0.26
32	002782	可立克	9,800	127,204.00	0.24
33	300800	力合科技	11,400	126,426.00	0.24

34	000153	丰原药业	20,400	125,868.00	0.24
35	002330	得利斯	24,800	113,584.00	0.22
36	603926	铁流股份	9,800	111,328.00	0.21
37	601126	四方股份	6,800	110,636.00	0.21
38	300155	安居宝	21,600	108,432.00	0.21
39	603339	四方科技	8,900	106,800.00	0.21
40	000586	汇源通信	9,300	103,416.00	0.20
41	688128	中国电器研究院	4,200	102,900.00	0.20
42	600626	申达股份	26,500	96,195.00	0.19
43	002802	洪汇新材	6,700	93,733.00	0.18
44	601811	新华文轩	6,400	93,248.00	0.18
45	603230	内蒙新华	7,100	91,661.00	0.18
46	300193	佳士科技	9,800	88,690.00	0.17
47	002863	今飞凯达	17,100	86,697.00	0.17
48	688586	江航飞机装备	7,701	86,636.25	0.17
49	300232	洲明科技	11,400	82,536.00	0.16
50	300239	东宝生物	13,100	77,683.00	0.15
51	000978	桂林旅游	11,600	71,108.00	0.14
52	605567	春雪食品	6,500	66,495.00	0.13
53	002483	润邦股份	9,500	59,375.00	0.11
54	600268	国电南自	7,500	58,650.00	0.11
55	000895	双汇发展	2,400	58,584.00	0.11

56	002817	黄山胶囊	7,800	57,564.00	0.11
57	603187	海容冷链	4,800	56,448.00	0.11
58	601319	中国人保	6,400	55,744.00	0.11
59	002661	克明食品	5,500	55,055.00	0.11
60	002540	亚太科技	9,100	53,053.00	0.10
61	002871	伟隆股份	4,700	52,311.00	0.10
62	002942	新农股份	2,800	48,664.00	0.09
63	002763	汇洁股份	6,400	44,160.00	0.09
64	603601	再升科技	10,700	43,442.00	0.08
65	002912	中新赛克	1,800	42,930.00	0.08
66	688432	有研硅	3,300	36,432.00	0.07
67	603861	白云电器	3,600	35,532.00	0.07
68	600406	国电南瑞	1,500	33,615.00	0.06
69	601600	中国铝业	4,600	32,384.00	0.06
70	300289	利德曼	6,200	32,240.00	0.06
71	603189	网达软件	1,800	31,266.00	0.06
72	300292	吴通控股	6,400	31,168.00	0.06
73	002736	国信证券	2,700	31,104.00	0.06
74	002249	大洋电机	4,400	28,952.00	0.06
75	002815	崇达技术	2,400	27,192.00	0.05
76	603528	多伦科技	3,000	25,020.00	0.05
77	002107	沃华医药	4,300	24,596.00	0.05
78	300079	数码视	4,000	23,400.00	0.05

		讯			
79	688517	金冠电 气	1,600	23,008.00	0.04
80	688681	科汇电 力自动 化	1,600	22,400.00	0.04
81	301028	东亚机 械	1,800	22,122.00	0.04
82	300626	华瑞股 份	1,700	18,292.00	0.04
83	300939	秋田微	600	18,240.00	0.04
84	601999	出版传 媒	2,100	14,679.00	0.03
85	603609	禾丰股 份	1,700	14,042.00	0.03
86	300414	中光防 雷	900	13,932.00	0.03
87	002363	隆基机 械	1,800	13,698.00	0.03
88	002745	木林森	1,600	12,608.00	0.02
89	600887	伊利股 份	400	11,152.00	0.02
90	000920	沃顿科 技	900	9,720.00	0.02
91	000931	中 关 村	1,600	8,688.00	0.02
92	300319	麦捷科 技	800	8,592.00	0.02
93	688558	国盛智 科股份	300	7,572.00	0.01
94	003008	开普检 测	300	6,375.00	0.01
95	603387	基蛋生 物	800	6,360.00	0.01
96	600784	鲁银投 资	900	5,760.00	0.01
97	002328	新朋股 份	900	5,238.00	0.01
98	300032	金龙机 电	900	4,734.00	0.01
99	603022	新通联	400	4,424.00	0.01
100	603289	泰瑞机 器	400	3,808.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002384	东山精密	910,643.00	1.84
2	002797	第一创业	830,596.00	1.67
3	300339	润和软件	781,952.00	1.58
4	300207	欣旺达	746,523.00	1.50
5	000021	深科技	741,416.00	1.49
6	002410	广联达	738,043.00	1.49
7	000423	东阿阿胶	737,355.00	1.49
8	002152	广电运通	730,925.00	1.47
9	002532	天山铝业	707,455.00	1.43
10	002841	视源股份	705,392.00	1.42
11	300017	网宿科技	698,342.00	1.41
12	000636	风华高科	679,530.00	1.37
13	300803	指南针	666,086.90	1.34
14	002078	太阳纸业	651,575.00	1.31
15	000404	长虹华意	637,816.00	1.29
16	300476	胜宏科技	635,908.00	1.28
17	002625	光启技术	618,524.00	1.25
18	002340	格林美	600,400.00	1.21
19	002673	西部证券	594,670.00	1.20
20	300496	中科创达	591,207.00	1.19

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	002384	东山精密	1,093,595.00	2.20
2	002625	光启技术	1,022,116.00	2.06
3	000636	风华高科	810,759.00	1.63
4	000783	长江证券	775,964.00	1.56
5	300476	胜宏科技	753,988.00	1.52
6	002797	第一创业	746,074.00	1.50
7	002152	广电运通	745,206.00	1.50
8	002273	水晶光电	708,729.00	1.43

9	000009	中国宝安	703,888.00	1.42
10	300339	润和软件	696,019.00	1.40
11	002078	太阳纸业	681,128.00	1.37
12	002340	格林美	663,133.00	1.34
13	600418	江淮汽车	653,669.00	1.32
14	002138	顺络电子	651,144.00	1.31
15	000423	东阿阿胶	647,420.00	1.30
16	002558	巨人网络	641,599.00	1.29
17	300803	指南针	640,463.00	1.29
18	002128	电投能源	639,670.00	1.29
19	002841	视源股份	638,879.00	1.29
20	000021	深科技	630,012.00	1.27

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	133,648,313.63
卖出股票收入（成交）总额	133,604,217.46

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：本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

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规定的备选股票库。

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	17,773.29
2	应收清算款	5,927,214.74
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	5,944,988.03

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：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
887	53,532.13	34,797,200.00	73.28	12,685,800.00	26.72

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—分红险—汇添富基金国寿股份成长股票型组合	12,285,000.00	25.87
2	浙江瓊尔德投资管理有限公司—瓊尔德润鑫 23 号私募证券投资基金	6,250,000.00	13.16
3	浙江瓊尔德投资管理有限公司—瓊尔德润禾 17 号私募证券投资基金	4,000,000.00	8.42
4	中信证券股份有限公司	3,929,010.00	8.27
5	广发证券股份有限公司	3,204,790.00	6.75
6	山东健桥药业有限公司	1,999,500.00	4.21
7	平安资管—工商银行—平安资产鑫享 32 号资产管理产品	1,608,200.00	3.39

8	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—万能B—汇添富国寿股份成长股票型组合万	926,500.00	1.95
9	任洪兵	850,000.00	1.79
10	瞿玮	400,000.00	0.84
10	钱树增	400,000.00	0.84

8.3 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。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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（2023 年 07 月 19 日）基金份额总额	961,483,000.00
本报告期期初基金份额总额	47,483,000.00
本报告期基金总申购份额	48,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	48,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	47,483,000.00

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，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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（%）	
银河证券	5	89,009,876.35	33.31	15,657.56	33.31	
光大证券	1	78,344,708.13	29.31	13,779.77	29.31	

华泰 证券	2	52,154,918.55	19.52	9,174.44	19.52	
中金 公司	2	17,407,800.44	6.51	3,062.31	6.51	
国泰 海通	4	14,183,953.35	5.31	2,494.69	5.31	
招商 证券	4	7,277,019.00	2.72	1,279.61	2.72	
国信 证券	2	7,244,254.50	2.71	1,274.01	2.71	
兴业 证券	2	1,630,000.77	0.61	286.85	0.61	
长江 证券	1	—	—	—	—	
东方 证券	4	—	—	—	—	
东吴 证券	2	—	—	—	—	
东兴 证券	1	—	—	—	—	
方正 证券	1	—	—	—	—	
高盛 中国	1	—	—	—	—	
广发 证券	1	—	—	—	—	
国都 证券	1	—	—	—	—	
国金 证券	2	—	—	—	—	
国投 证券	2	—	—	—	—	
国新 证券	2	—	—	—	—	
华鑫 证券	3	—	—	—	—	
上海 证券	1	—	—	—	—	
申万 宏源 证券	1	—	—	—	—	
西南 证券	1	—	—	—	—	
中金	1	—	—	—	—	

财富						
中泰 证券	1	-	-	-	-	
中信 建投 证券	1	-	-	-	-	
中信 证券	1	-	-	-	-	
中银 国际	1	-	-	-	-	

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 (%)
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 海通	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期内新增 2 家证券公司的 4 个交易单元：银河证券（上交所单元，深交所单元）、招商证券（上交所单元，深交所单元）；不再租用 1 家证券公司的 1 个交易单元：长城证券（上交所单元）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东北证券为申购赎回代理券商的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 07 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第四季度报告	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报	2025 年 01 月 22 日
3	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（2024 年度）	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 上证报	2025 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年年报	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 31 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富中证 500 增强策略交易	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会	2025 年 04 月 07 日

	型开放式指数证券投资基金溢价风险的提示性公告	基金电子披露网站	
6	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金溢价风险的提示性公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 10 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 22 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报, 上交所, 深交所	2025 年 04 月 30 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华西证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报	2025 年 06 月 10 日
10	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 16 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 23 日
12	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行(中国)有限公司合作关系的公告	上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 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 (%)

机构	1	2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 6 月 30 日	12,285,000.00	-	-	12,285,000.00	25.87
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 500 增强策略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 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 增强策略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 500 增强策略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

2025 年 08 月 29 日