

# 汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 .....	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 .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	14
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 .....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
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 .....	16
§ 5 托管人报告 .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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 .....	16
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） .....	17
6.1 资产负债表 .....	17
6.2 利润表 .....	18
6.3 净资产变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	21
§ 7 投资组合报告 .....	45
7.1 期末基金资产组合情况 .....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	68
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
7.12 投资组合报告附注.....	70
§ 8 基金份额持有人信息 .....	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	72
§ 9 开放式基金份额变动 .....	72
§ 10 重大事件揭示 .....	72
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
10.8 其他重大事件.....	80
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
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.....	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
§ 12 备查文件目录 .....	81
12.1 备查文件目录.....	81
12.2 存放地点 .....	81
12.3 查阅方式 .....	81

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金	
基金简称	汇添富中证 500 基本面增强指数	
基金主代码	012498	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 09 月 16 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	85,897,012.41	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C
下属分级基金的交易代码	012498	012499
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	64,104,165.91	21,792,846.50

### 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，通过基本面选股方法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。
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，立足于深入的基本面分析，精选高质量证券组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。</p> <p>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。</p> <p>本基金的投资策略还包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、国债期货投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	王小飞
	联系电话	021-28932888	021-60637103
	电子邮箱	service@99fund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	021-60637228
传真		021-28932998	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200010	100033
法定代表人		鲁伟铭	张金良

## 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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路 728 号

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日)	
	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C
本期已实现收益	325,719.88	50,051.30
本期利润	2,599,018.47	733,677.00
加权平均基金份额本	0.0384	0.0316

期利润		
本期加权平均净值利 润率	4.85%	4.11%
本期基金份额净值增 长率	4.77%	4.35%
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	-13,213,616.44	-4,992,311.12
期末可供分配基金份 额利润	-0.2061	-0.2291
期末基金资产净值	52,628,136.49	17,358,308.07
期末基金份额净值	0.8210	0.7965
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	-17.90%	-20.35%

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

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 500 基本面增强指数 A						
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去一 个月	4.39%	0.73%	4.09%	0.75%	0.30%	-0.02%
过去三 个月	2.68%	1.24%	0.97%	1.43%	1.71%	-0.19%
过去六 个月	4.77%	1.15%	3.21%	1.29%	1.56%	-0.14%
过去一 年	9.55%	1.47%	18.83%	1.64%	-9.28%	-0.17%

过去三年	-13.43%	1.22%	-7.61%	1.29%	-5.82%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-17.90%	1.23%	-20.74%	1.30%	2.84%	-0.07%
汇添富中证 500 基本面增强指数 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.31%	0.72%	4.09%	0.75%	0.22%	-0.03%
过去三个月	2.47%	1.24%	0.97%	1.43%	1.50%	-0.19%
过去六个月	4.35%	1.15%	3.21%	1.29%	1.14%	-0.14%
过去一年	8.68%	1.47%	18.83%	1.64%	-10.15%	-0.17%
过去三年	-15.48%	1.22%	-7.61%	1.29%	-7.87%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-20.35%	1.23%	-20.74%	1.30%	0.39%	-0.07%

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基本面增强指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500基本面增强指数C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2021 年 09 月 16 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。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		
顾耀强	本基金的基金经理, 增强收益部总监	2021 年 09 月 16 日	—	21	国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金

					<p>金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，现任增强收益部总监。</p> <p>2009 年 12 月 22 日至今任汇添富策略回报混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>经理。2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 8 月 24 日至 2024 年 10 月 18 日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 1 月 20 日至今任汇添富沪深 300 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 2 月 5 日至 2022 年 9 月 22 日任汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 16 日至今任汇添富中证</p>
--	--	--	--	--	---

					500 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。
温琪	本基金的基金经理	2024 年 06 月 05 日	-	15	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 6 月起加入汇添富基金管理股份有限公司。2024 年 6 月 5 日至今任汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月 27 日至今任汇添富红利智选混合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

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

2025 年上半年 A 股市场整体呈现“N 型”走势：年初受海外利空等因素影响，指数震荡调整，随后在 DeepSeek 带动以及春节国内消费数据相对强劲的带动下，市场热度提升，尤其是机器人和 AI 板块表现活跃，带动上证指数在 3 月份突破 3400 点。4 月份受美国关税政策等外部事件冲击，指数再次深度调整，之后在中国官方扩内需政策与金融政策利好支撑下，6 月份上证指数重回 3400 点上方。上半年上证指数上涨 2.76%，万得全 A 指数上涨 5.83%，中证 500 指数上涨 3.31%。行业方面，有色金属、银行、国防军工等行业上半年上涨较多，而煤炭、食品饮料、房地产跌幅靠前。

报告期内，我们积极调整了行业板块配置，增加了小市值暴露，同时在股指期货贴水较多时，加仓了部分中证 500 股指期货头寸来获取确定性的超额收益，取得了较好的表现。本基金管理人将继续采用基本面与量化选股相结合的方式，在投资实践中不断总结反思，持续优化投资框架，力争在控制跟踪误差的基础上获取稳健的超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 500 基本面增强指数 A 类份额净值增长率为 4.77%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。本报告期汇添富中证 500 基本面增强指数 C 类份额净值增长率为 4.35%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

考虑到下半年出口面临美国关税政策和抢出口效应消退的双重不利影响，以及房地产投资拖累，预计下半年国内经济增长压力加大，但相对充裕的流动性、上市公司预期盈利可能提升以及政策支持等因素有望为市场带来积极影响。预计下半年流动性将保持适度充裕，这主要得益于（1）美元资产安全性下降推动全球资金回流本土，人民币资产相对吸引力提升；

（2）居民“资产荒”加剧，权益资产相对优势凸显；（3）公募基金发行回暖、保险资金配置比例上升等因素。相对充裕的流动性环境将为市场估值提供支撑，预计下半年交易继续维持活跃，市场保持震荡偏强的运行态势。

#### 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：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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

本托管人复核审查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。

§ 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 基本面增强指数型证券投资基金

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	6,831,226.95	6,864,807.56
结算备付金		1,889,813.54	1,302,715.90
存出保证金		700,080.72	11,785.82
交易性金融资产	6.4.7.2	60,736,806.57	67,807,048.90
其中：股票投资		59,631,045.28	67,807,048.90
基金投资		-	-
债券投资		1,105,761.29	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,985.14	720.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		70,160,912.92	75,987,078.32
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		0.60	8,775.01

应付赎回款		10,338.46	5,523.54
应付管理人报酬		67,610.52	79,636.99
应付托管费		11,268.41	13,272.81
应付销售服务费		11,324.42	12,734.16
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,360.43	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	71,565.52	195,709.12
负债合计		174,468.36	315,651.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	85,897,012.41	97,183,225.14
未分配利润	6.4.7.9	-15,910,567.85	-21,511,798.45
净资产合计		69,986,444.56	75,671,426.69
负债和净资产总计		70,160,912.92	75,987,078.32

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 85,897,012.41 份。本基金下属汇添富中证 500 基本面增强指数 A 基金份额净值 0.8210 元，基金份额总额 64,104,165.91 份；本基金下属汇添富中证 500 基本面增强指数 C 基金份额净值 0.7965 元，基金份额总额 21,792,846.50 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金

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		3,969,477.98	-3,409,978.83
1. 利息收入		16,973.58	24,761.49
其中：存款利息收入	6.4.7.10	16,890.04	24,761.49
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		83.54	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		991,553.55	-3,068,971.84
其中：股票投资收益	6.4.7.11	93,247.90	-4,965,340.31
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,776.45	46,356.35
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	298,902.81	1,075,769.64

股利收益	6.4.7.17	595,626.39	774,242.48
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	2,956,924.29	-367,831.65
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	4,026.56	2,063.17
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>636,782.51</b>	<b>786,435.36</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	424,527.72	462,700.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,754.61	77,116.77
3. 销售服务费		70,661.95	70,253.42
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		1,080.16	3,984.46
8. 其他费用	6.4.7.21	69,758.07	172,380.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,332,695.47</b>	<b>-4,196,414.19</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,332,695.47</b>	<b>-4,196,414.19</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>3,332,695.47</b>	<b>-4,196,414.19</b>

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金

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	97,183,225.14	-21,511,798.45	75,671,426.69
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	97,183,225.14	-21,511,798.45	75,671,426.69
三、本期增减变	-11,286,212.73	5,601,230.60	-5,684,982.13

动额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	3,332,695.47	3,332,695.47
（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）	-11,286,212.73	2,268,535.13	-9,017,677.60
其中：1. 基金申购款	4,398,489.42	-975,038.88	3,423,450.54
2. 基金赎回款	-15,684,702.15	3,243,574.01	-12,441,128.14
（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	85,897,012.41	-15,910,567.85	69,986,444.56
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	104,169,884.00	-22,270,138.56	81,899,745.44
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	104,169,884.00	-22,270,138.56	81,899,745.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,880,731.68	-2,996,392.86	-7,877,124.54
（一）、综合收益总额	-	-4,196,414.19	-4,196,414.19
（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）	-4,880,731.68	1,200,021.33	-3,680,710.35
其中：1. 基金申购款	2,955,289.34	-740,842.03	2,214,447.31
2. 基金赎回款	-7,836,021.02	1,940,863.36	-5,895,157.66
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	99,289,152.32	-25,266,531.42	74,022,620.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金（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[2020]3468 号文《关于准予汇添富中证 500 基本面增强指数型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 2021 年 9 月 16 日生效。首次设立基金募集规模为 289,726,227.10 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（2021）验字第 60466941\_B73 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

### 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	6,831,226.95
等于：本金	6,830,550.79
加：应计利息	676.16
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	6,831,226.95

##### 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		57,713,682.27	-	59,631,045.28	1,917,363.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,096,979.00	6,591.29	1,105,761.29	2,191.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	1,096,979.00	6,591.29	1,105,761.29	2,191.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-



其他	-	-	-	-
合计	58,810,661.27	6,591.29	60,736,806.57	1,919,554.01

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	5,468,202.67	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	5,468,202.67	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,468,202.67	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	1	1,173,480.00	52,320.00
IC2509	IC2509	4	4,620,640.00	273,597.33

合计	325,917.33
减：可抵销期货暂收款	325,917.33
净额	—

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	20.99
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	14,516.86
其中：交易所市场	14,516.86
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	71,565.52

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 基本面增强指数 A		
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	73,317,028.96	73,317,028.96
本期申购	1,576,238.73	1,576,238.73
本期赎回（以“-”号填列）	-10,789,101.78	-10,789,101.78
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	64,104,165.91	64,104,165.91
汇添富中证 500 基本面增强指数 C		
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	23,866,196.18	23,866,196.18
本期申购	2,822,250.69	2,822,250.69
本期赎回（以“-”号填列）	-4,895,600.37	-4,895,600.37
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	21,792,846.50	21,792,846.50

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 500 基本面增强指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,503,283.39	-359,701.45	-15,862,984.84
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-15,503,283.39	-359,701.45	-15,862,984.84
本期利润	325,719.88	2,273,298.59	2,599,018.47
本期基金份额交易产生的变动数	1,963,947.07	-176,010.12	1,787,936.95
其中：基金申购款	-333,447.10	12,846.69	-320,600.41
基金赎回款	2,297,394.17	-188,856.81	2,108,537.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,213,616.44	1,737,587.02	-11,476,029.42
汇添富中证 500 基本面增强指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,517,946.22	-130,867.39	-5,648,813.61
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-5,517,946.22	-130,867.39	-5,648,813.61
本期利润	50,051.30	683,625.70	733,677.00
本期基金份额交易产生的变动数	475,583.80	5,014.38	480,598.18
其中：基金申购款	-656,346.32	1,907.85	-654,438.47
基金赎回款	1,131,930.12	3,106.53	1,135,036.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,992,311.12	557,772.69	-4,434,538.43

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	8,897.85
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	7,974.53
其他	17.66
合计	16,890.04

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	100,950,846.20
减：卖出股票成本总额	100,761,299.26
减：交易费用	96,299.04
买卖股票差价收入	93,247.90

#### 6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	3,824.45
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-48.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,776.45

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	203,980.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200,048.00

减：应计利息总额	3,980.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-48.00

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
外汇远期投资收益	-
外汇期货投资收益	-
股指期货投资收益	298,902.81
国债期货投资收益	-

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	595,626.39
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	595,626.39

#### 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	2,631,006.96

——股票投资	2,628,815.96
——债券投资	2,191.00
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	325,917.33
——权证投资	—
——期货投资	325,917.33
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	2,956,924.29

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	4,026.56
替代损益	—
其他	—
合计	4,026.56

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	9,000.00
银行费用	1,129.49
指数使用费	2,586.16
登记结算服务费	—
IOPV 计算与发布费	—
持有人大会-公证费	—

持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	14.75
合计	69,758.07

#### 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, 基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易



注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 基金交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

**6.4.10.1.5 权证交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 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	424,527.72	462,700.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	137,420.49	132,550.64
应支付基金管理人的净管理费	287,107.23	330,149.85

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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。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、休息日等，支付日期顺延。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 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	70,754.61	77,116.77

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

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。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、休息日等，支付日期顺延。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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C	合计
东方证券股份有限公司	-	8.36	8.36
汇添富基金管理股份有限公司	-	6,877.52	6,877.52
中国建设银行股份有限公司	-	15,794.02	15,794.02
合计	-	22,679.90	22,679.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	6,402.31	6,402.31
东方证券股份有限公司	-	38.61	38.61
中国建设银行股份有限公司	-	13,743.36	13,743.36
合计	-	20,184.28	20,184.28

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 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、休息日等，支付日期顺延。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**

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

建设银行	6,831,226.95	8,897.85	7,834,718.67	9,904.71
------	--------------	----------	--------------	----------

#### 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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	6,831,226.95	-	-	-	-	-	6,831,226.95
结算备付金	1,889,813.54	-	-	-	-	-	1,889,813.54
存出保证金	4,786.32	-	-	-	-	695,294.40	700,080.72
交易性金融资产	-	-	1,105,761.29	-	-	59,631,045.28	60,736,806.57
衍生	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,985.14	2,985.14
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	8,725,826.81	-	1,105,761.29	-	-	60,329,324.82	70,160,912.92
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	-	-	-	-	-	0.60	0.60
应付赎回	-	-	-	-	-	10,338.46	10,338.46

款							
应付 管理人报 酬	-	-	-	-	-	67,610.52	67,610.52
应付 托管费	-	-	-	-	-	11,268.41	11,268.41
应付 销售服 务费	-	-	-	-	-	11,324.42	11,324.42
应付 投资咨 询费	-	-	-	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-	-	2,360.43	2,360.43
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税负 债	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	71,565.52	71,565.52
负债 总计	-	-	-	-	-	174,468.36	174,468.36
利率 敏感 度缺 口	8,725,826.81	-	1,105,761.29	-	-	60,154,856.46	69,986,444.56
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	6,864,807.56	-	-	-	-	-	6,864,807.56
结算	1,302,715.90	-	-	-	-	-	1,302,715.90



备付金							
存出保证金	11,785.82	-	-	-	-	-	11,785.82
交易性金融资产	-	-	-	-	-	67,807,048.90	67,807,048.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	720.14	720.14
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	8,179,309.28	-	-	-	-	67,807,769.04	75,987,078.32
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	-	-	-	-	-	8,775.01	8,775.01
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	5,523.54	5,523.54
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	79,636.99	79,636.99
应付 托管 费	-	-	-	-	-	13,272.81	13,272.81
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	12,734.16	12,734.16
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	-	-	-	-	-	195,709.12	195,709.12
负债 总计	-	-	-	-	-	315,651.63	315,651.63
利率 敏感 度缺 口	8,179,309.28	-	-	-	-	67,492,117.41	75,671,426.69

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

行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	1,380.89	-
	基准利率增加 25 个基点	-1,377.33	-

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	59,631,045.2	85.20	67,807,048.9	89.61

	8		0	
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1, 105, 761. 29	1. 58	—	—
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	60, 736, 806. 57	86. 78	67, 807, 048. 90	89. 61

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, 954, 882. 80	3, 295, 942. 89
	中证 500 指数下跌 5%	-2, 954, 882. 80	-3, 295, 942. 89

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	59,631,045.28
第二层次	1,105,761.29
第三层次	-
合计	60,736,806.57

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	59,631,045.28	84.99
	其中：股票	59,631,045.28	84.99
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,105,761.29	1.58
	其中：债券	1,105,761.29	1.58
	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	8,721,040.49	12.43
8	其他各项资产	703,065.86	1.00
9	合计	70,160,912.92	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	482,526.00	0.69
B	采矿业	1,528,953.00	2.18
C	制造业	38,087,372.25	54.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,694,427.00	2.42
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	1,327,267.00	1.90
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	6,023,864.89	8.61
J	金融业	6,856,050.70	9.80
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	290,345.60	0.41
M	科学研究和技术服务业	276,380.84	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	250,644.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	324,562.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	1,130,063.00	1.61
S	综合	1,261,855.00	1.80
	合计	59,534,311.28	85.07

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	96,734.00	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
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	96,734.00	0.14

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	600673	东阳光	108,500	1,261,855.00	1.80
2	300476	胜宏科技	4,900	658,462.00	0.94
3	002966	苏州银行	69,900	613,722.00	0.88

4	600177	雅戈尔	75,300	549,690.00	0.79
5	600398	海澜之家	78,200	544,272.00	0.78
6	600988	赤峰黄金	18,200	452,816.00	0.65
7	689009	九号公司	7,266	429,929.22	0.61
8	002517	恺英网络	21,200	409,372.00	0.58
9	002558	巨人网络	16,900	397,995.00	0.57
10	601128	常熟银行	51,580	380,144.60	0.54
11	300251	光线传媒	18,500	374,995.00	0.54
12	601577	长沙银行	37,200	369,768.00	0.53
13	002385	大北农	90,300	364,812.00	0.52
14	300339	润和软件	6,500	330,395.00	0.47
15	000932	华菱钢铁	70,300	309,320.00	0.44
16	002465	海格通信	22,100	308,074.00	0.44
17	600879	航天电子	29,200	305,724.00	0.44
18	601555	东吴证券	34,700	303,625.00	0.43
19	603129	春风动力	1,400	303,100.00	0.43
20	601168	西部矿业	18,100	301,003.00	0.43
21	002085	万丰奥威	18,800	298,732.00	0.43
22	600839	四川长虹	30,200	293,544.00	0.42
23	000831	中国稀土	8,100	292,572.00	0.42
24	300058	蓝色光标	44,260	290,345.60	0.41
25	300002	神州泰岳	24,600	290,280.00	0.41
26	002472	双环传	8,600	288,014.00	0.41



		动			
27	601665	齐鲁银行	45,300	286,296.00	0.41
28	000933	神火股份	17,200	286,208.00	0.41
29	601997	贵阳银行	45,700	285,168.00	0.41
30	603596	伯特利	5,400	284,526.00	0.41
31	688002	睿创微纳	3,935	274,348.20	0.39
32	002318	久立特材	11,600	271,324.00	0.39
33	600598	北大荒	18,700	269,654.00	0.39
34	688521	芯原微电子	2,755	265,857.50	0.38
35	600737	中粮糖业	28,000	264,600.00	0.38
36	002195	岩山科技	46,500	261,795.00	0.37
37	688122	西部超导	5,042	261,578.96	0.37
38	688235	百济神州	1,107	258,639.48	0.37
39	002797	第一创业	36,500	258,420.00	0.37
40	002624	完美世界	16,900	256,373.00	0.37
41	002294	信立泰	5,400	255,582.00	0.37
42	002738	中矿资源	7,900	254,064.00	0.36
43	002261	拓维信息	8,200	253,790.00	0.36
44	002958	青农商行	69,500	250,895.00	0.36
45	002532	天山铝业	30,000	249,300.00	0.36
46	002156	通富微电	9,700	248,514.00	0.36
47	300474	景嘉微	3,400	248,200.00	0.35
48	600487	亨通光电	16,100	246,330.00	0.35
49	603893	瑞芯微	1,600	242,976.00	0.35
50	688617	惠泰医	813	241,461.00	0.35

		疗			
51	688608	恒玄科技	686	238,714.28	0.34
52	600862	中航高科	9,100	237,328.00	0.34
53	000066	中国长城	15,900	235,320.00	0.34
54	601099	太平洋	59,300	233,049.00	0.33
55	002299	圣农发展	16,300	232,927.00	0.33
56	600079	人福医药	11,000	230,780.00	0.33
57	688213	思特威电子科技	2,255	230,506.10	0.33
58	300395	菲利华	4,500	229,950.00	0.33
59	301498	乖宝宠物	2,100	229,677.00	0.33
60	600536	中国软件	4,900	229,173.00	0.33
61	300803	指南针	2,825	227,864.50	0.33
62	000423	东阿阿胶	4,300	224,890.00	0.32
63	601108	财通证券	28,300	223,853.00	0.32
64	600516	方大炭素	47,900	222,256.00	0.32
65	688120	华海清科	1,316	222,009.20	0.32
66	002273	水晶光电	11,100	221,667.00	0.32
67	600549	厦门钨业	10,400	217,568.00	0.31
68	600699	均胜电子	12,400	216,256.00	0.31
69	000733	振华科技	4,300	215,215.00	0.31
70	300017	网宿科技	19,900	213,328.00	0.30
71	000426	兴业银锡	13,500	213,300.00	0.30
72	601118	海南橡胶	45,100	212,872.00	0.30

73	002155	湖南黄金	11,840	211,344.00	0.30
74	601933	永辉超市	42,700	209,230.00	0.30
75	002185	华天科技	20,600	208,060.00	0.30
76	600126	杭钢股份	22,900	206,100.00	0.29
77	002223	鱼跃医疗	5,700	202,920.00	0.29
78	300699	光威复材	6,400	202,688.00	0.29
79	000629	钒钛股份	78,900	201,984.00	0.29
80	300765	新诺威	3,900	201,591.00	0.29
81	600392	盛和资源	15,300	201,501.00	0.29
82	000519	中兵红箭	9,200	201,388.00	0.29
83	000783	长江证券	28,800	199,584.00	0.29
84	600612	老凤祥	4,000	199,000.00	0.28
85	300454	深信服	2,100	197,778.00	0.28
86	603179	新泉股份	4,200	197,274.00	0.28
87	600109	国金证券	22,400	196,448.00	0.28
88	002130	沃尔核材	8,200	195,324.00	0.28
89	000878	云南铜业	15,300	194,616.00	0.28
90	002414	高德红外	18,800	192,700.00	0.28
91	688469	芯联集成	40,325	192,350.25	0.27
92	688099	晶晨半导体	2,685	190,661.85	0.27
93	603979	金诚信	4,100	190,404.00	0.27
94	600637	东方明珠	25,300	188,991.00	0.27
95	000997	新大陆	5,800	187,804.00	0.27
96	002281	光迅科	3,800	187,416.00	0.27

		技			
97	688578	艾力斯医药科技	2,013	187,289.52	0.27
98	300223	北京君正	2,700	186,840.00	0.27
99	603087	甘李药业	3,400	186,252.00	0.27
100	601198	东兴证券	16,700	186,205.00	0.27
101	600118	中国卫星	6,500	185,705.00	0.27
102	002138	顺络电子	6,600	185,592.00	0.27
103	002078	太阳纸业	13,700	184,402.00	0.26
104	002673	西部证券	23,300	183,604.00	0.26
105	300458	全志科技	4,600	182,574.00	0.26
106	002410	广联达	13,600	182,376.00	0.26
107	002739	万达电影	15,900	181,737.00	0.26
108	002436	兴森科技	13,700	181,388.00	0.26
109	600435	北方导航	11,600	180,844.00	0.26
110	000738	航发控制	8,700	180,525.00	0.26
111	000728	国元证券	22,700	179,103.00	0.26
112	300748	金力永磁	7,500	178,800.00	0.26
113	600316	洪都航空	4,700	177,190.00	0.25
114	600497	驰宏锌锗	33,400	176,686.00	0.25
115	600298	安琪酵母	5,000	175,850.00	0.25
116	600765	中航重机	10,400	175,552.00	0.25
117	688180	君实生物	5,166	175,540.68	0.25

118	300003	乐普医疗	12,700	175,006.00	0.25
119	002065	东华软件	18,200	174,720.00	0.25
120	600038	中直股份	4,500	174,645.00	0.25
121	688525	佰维存储	2,589	174,498.60	0.25
122	000887	中鼎股份	9,900	174,141.00	0.25
123	300346	南大光电	5,500	174,020.00	0.25
124	600282	南钢股份	41,400	173,880.00	0.25
125	600562	国睿科技	5,500	173,195.00	0.25
126	300136	信维通信	7,700	172,480.00	0.25
127	300054	鼎龙股份	6,000	172,080.00	0.25
128	688072	拓荆科技	1,110	170,618.10	0.24
129	000034	神州数码	4,500	169,380.00	0.24
130	600363	联创光电	2,900	169,157.00	0.24
131	300142	沃森生物	15,300	168,300.00	0.24
132	002821	凯莱英	1,900	167,675.00	0.24
133	300496	中科创达	2,900	165,938.00	0.24
134	300383	光环新网	11,600	165,880.00	0.24
135	000960	锡业股份	10,800	165,240.00	0.24
136	000021	深科技	8,800	164,912.00	0.24
137	300857	协创数据	1,900	163,514.00	0.23
138	600166	福田汽车	60,300	163,413.00	0.23
139	002007	华兰生物	10,400	162,968.00	0.23
140	300115	长盈精密	7,600	162,640.00	0.23

		密			
141	000750	国海证 券	38,900	160,268.00	0.23
142	600521	华海药 业	8,600	160,218.00	0.23
143	688220	翱捷科 技	2,031	159,027.30	0.23
144	603605	珀莱雅	1,900	157,301.00	0.22
145	300604	长川科 技	3,500	157,185.00	0.22
146	300627	华测导 航	4,480	156,800.00	0.22
147	603160	汇顶科 技	2,200	156,266.00	0.22
148	000623	吉林敖 东	9,200	155,940.00	0.22
149	601990	南京证 券	19,200	155,136.00	0.22
150	601696	中银证 券	14,500	155,005.00	0.22
151	002044	美年健 康	30,100	154,714.00	0.22
152	002025	航天电 器	3,000	154,230.00	0.22
153	600171	上海贝 岭	4,500	154,125.00	0.22
154	000709	河钢股 份	70,500	152,280.00	0.22
155	688361	中科飞 测	1,800	151,542.00	0.22
156	000729	燕京啤 酒	11,700	151,281.00	0.22
157	600369	西南证 券	34,700	150,945.00	0.22
158	002984	森麒麟	7,900	148,125.00	0.21
159	600060	海信视 像	6,400	147,328.00	0.21
160	000988	华工科 技	3,100	145,731.00	0.21
161	002340	格林美	22,700	144,145.00	0.21
162	600909	华安证 券	24,600	143,418.00	0.20
163	688052	纳芯微	816	142,383.84	0.20

		电子			
164	603939	益丰药房	5,800	141,926.00	0.20
165	600529	山东药玻	6,300	139,482.00	0.20
166	603000	人民网	6,900	139,449.00	0.20
167	000825	太钢不锈	38,800	139,292.00	0.20
168	300558	贝达药业	2,400	139,080.00	0.20
169	600808	马钢股份	40,300	139,035.00	0.20
170	688027	科大国盾量子	505	138,880.05	0.20
171	002563	森马服饰	26,300	138,338.00	0.20
172	603345	安井食品	1,700	136,714.00	0.20
173	601966	玲珑轮胎	9,300	136,431.00	0.19
174	002152	广电运通	10,100	135,744.00	0.19
175	002203	海亮股份	13,100	135,192.00	0.19
176	300373	扬杰科技	2,600	134,940.00	0.19
177	600155	华创云信	19,300	134,328.00	0.19
178	688249	晶合集成	6,541	132,586.07	0.19
179	000060	中金岭南	28,600	130,988.00	0.19
180	002653	海思科	3,100	130,882.00	0.19
181	688385	复旦微电	2,650	130,565.50	0.19
182	300207	欣旺达	6,500	130,390.00	0.19
183	000951	中国重汽	7,400	130,092.00	0.19
184	688114	华大智造	1,996	129,400.68	0.18
185	000559	万向钱潮	16,600	126,990.00	0.18
186	603228	景旺电	3,000	125,520.00	0.18

		子			
187	600998	九州通	24,300	124,902.00	0.18
188	600763	通策医疗	3,000	123,840.00	0.18
189	688188	上海柏楚电子科技	937	123,365.42	0.18
190	002262	恩华药业	5,900	122,602.00	0.18
191	000513	丽珠集团	3,400	122,536.00	0.18
192	002926	华西证券	13,700	122,478.00	0.18
193	600685	中船防务	4,500	122,355.00	0.17
194	600901	江苏金租	20,060	121,563.60	0.17
195	002409	雅克科技	2,200	120,318.00	0.17
196	600563	法拉电子	1,100	119,999.00	0.17
197	600498	烽火通信	5,700	119,871.00	0.17
198	300676	华大基因	2,400	119,448.00	0.17
199	300450	先导智能	4,800	119,280.00	0.17
200	300623	捷捷微电	4,000	119,200.00	0.17
201	688297	中航无人机	2,226	118,868.40	0.17
202	688568	中科星图公司	3,281	118,148.81	0.17
203	601098	中南传媒	9,000	118,080.00	0.17
204	002939	长城证券	14,000	117,320.00	0.17
205	002432	九安医疗	3,200	116,576.00	0.17
206	601958	金钼股份	10,600	115,964.00	0.17
207	600380	健康元	10,500	115,815.00	0.17
208	600885	宏发股	5,180	115,565.80	0.17



		份			
209	000403	派林生物	6,350	115,125.50	0.16
210	002841	视源股份	3,300	114,180.00	0.16
211	688278	特宝生物	1,580	113,933.80	0.16
212	600390	五矿资本	19,500	113,685.00	0.16
213	603529	爱玛科技	3,300	113,520.00	0.16
214	002603	以岭药业	8,000	112,800.00	0.16
215	600535	天士力	7,200	112,680.00	0.16
216	002756	永兴材料	3,500	111,125.00	0.16
217	300285	国瓷材料	6,400	111,040.00	0.16
218	603486	科沃斯	1,900	110,637.00	0.16
219	600132	重庆啤酒	2,000	110,200.00	0.16
220	600863	内蒙华电	26,700	109,737.00	0.16
221	002500	山西证券	18,700	109,208.00	0.16
222	688582	芯动联科	1,623	109,065.60	0.16
223	600008	首创环保	35,800	108,116.00	0.15
224	600959	江苏有线	31,300	107,672.00	0.15
225	002568	百润股份	4,200	107,562.00	0.15
226	601928	凤凰传媒	9,600	107,232.00	0.15
227	600764	中国海防	3,100	105,400.00	0.15
228	600511	国药股份	3,600	104,976.00	0.15
229	603568	伟明环保	5,500	104,940.00	0.15
230	300679	电连技术	2,300	104,374.00	0.15

231	688538	和辉光电	44,369	103,823.46	0.15
232	600859	王府井	7,400	102,786.00	0.15
233	605358	立昂微	4,400	102,520.00	0.15
234	688520	神州细胞集团 公司	1,712	102,463.20	0.15
235	600655	豫园股份	18,400	102,120.00	0.15
236	002850	科达利	900	101,853.00	0.15
237	300677	英科医疗	4,300	101,824.00	0.15
238	688183	生益电子	1,986	101,683.20	0.15
239	601212	白银有色	32,400	101,412.00	0.14
240	600021	上海电力	11,500	101,085.00	0.14
241	603589	口子窖	2,900	100,920.00	0.14
242	600816	建元信托	34,200	100,890.00	0.14
243	600977	中国电影	9,400	100,768.00	0.14
244	603816	顾家家居	3,900	99,528.00	0.14
245	600095	湘财股份	9,900	99,297.00	0.14
246	300529	健帆生物	4,600	99,222.00	0.14
247	002773	康弘药业	3,400	98,498.00	0.14
248	000591	太阳能	22,400	98,336.00	0.14
249	002423	中粮资本	8,000	97,840.00	0.14
250	000921	海信家电	3,800	97,660.00	0.14
251	600580	卧龙电驱	4,920	97,268.40	0.14
252	688728	格科微有 限公司	6,316	97,266.40	0.14
253	300601	康泰生物	6,400	97,216.00	0.14

254	600872	中炬高新	5,100	96,900.00	0.14
255	600739	辽宁成大	8,800	96,800.00	0.14
256	000958	电投产融	14,000	95,760.00	0.14
257	601991	大唐发电	30,200	95,734.00	0.14
258	000563	陕国投 A	26,600	94,962.00	0.14
259	688301	奕瑞科技股份	1,081	94,706.41	0.14
260	002439	启明星辰	5,900	94,341.00	0.13
261	002202	金风科技	9,200	94,300.00	0.13
262	601456	国联民生	9,100	94,185.00	0.13
263	000898	鞍钢股份	40,300	93,496.00	0.13
264	603606	东方电缆	1,800	93,078.00	0.13
265	601615	明阳智能	8,100	93,069.00	0.13
266	600867	通化东宝	11,300	92,660.00	0.13
267	300146	汤臣倍健	8,200	92,168.00	0.13
268	600566	济川药业	3,500	92,155.00	0.13
269	601016	节能风电	31,800	91,902.00	0.13
270	603927	中科软	4,700	90,898.00	0.13
271	000636	风华高科	6,600	90,684.00	0.13
272	601965	中国汽研	5,100	90,525.00	0.13
273	002851	麦格米特	1,800	90,252.00	0.13
274	600329	达仁堂	2,700	90,072.00	0.13
275	000987	越秀资本	13,100	89,866.00	0.13
276	600373	中文传	8,700	89,349.00	0.13

		媒			
277	300212	易华录	4,100	89,216.00	0.13
278	000959	首钢股份	26,200	89,080.00	0.13
279	000062	深圳华强	3,300	88,638.00	0.13
280	603659	璞泰来	4,700	88,266.00	0.13
281	300573	兴齐眼药	1,700	88,043.00	0.13
282	000598	兴蓉环境	12,200	87,962.00	0.13
283	600483	福能股份	9,100	87,724.00	0.13
284	301308	江波龙	1,000	87,490.00	0.13
285	000155	川能动力	8,900	87,398.00	0.12
286	688777	中控技术	1,941	87,170.31	0.12
287	600295	鄂尔多斯	10,000	87,100.00	0.12
288	603899	晨光股份	3,000	86,970.00	0.12
289	603156	养元饮品	4,100	86,756.00	0.12
290	600131	国网信通	4,900	86,730.00	0.12
291	603858	步长制药	5,300	86,072.00	0.12
292	000050	深天马 A	10,000	85,200.00	0.12
293	002507	涪陵榨菜	6,600	84,414.00	0.12
294	600271	航天信息	9,100	84,084.00	0.12
295	688563	航空材料股份	1,484	84,038.92	0.12
296	688234	天岳先进	1,402	82,087.10	0.12
297	600928	西安银行	20,800	81,536.00	0.12
298	603290	斯达半导	1,000	81,270.00	0.12
299	002429	兆驰股	18,500	81,030.00	0.12

		份			
300	300037	新宙邦	2,300	80,960.00	0.12
301	688363	华熙生物	1,571	80,670.85	0.12
302	300070	碧水源	17,800	80,100.00	0.11
303	300595	欧普康视	5,200	79,404.00	0.11
304	300001	特锐德	3,300	79,101.00	0.11
305	600096	云天化	3,600	79,092.00	0.11
306	601231	环旭电子	5,400	79,002.00	0.11
307	300073	当升科技	1,800	78,966.00	0.11
308	000739	普洛药业	5,600	78,400.00	0.11
309	301536	星宸科技	1,300	78,390.00	0.11
310	300888	稳健医疗	1,900	78,090.00	0.11
311	603341	龙旗科技	1,900	77,197.00	0.11
312	600906	财达证券	11,300	77,066.00	0.11
313	301301	川宁生物	6,400	77,056.00	0.11
314	600995	南网储能	7,800	76,284.00	0.11
315	600517	国网英大	14,900	75,990.00	0.11
316	688561	奇安信集团	2,235	75,945.30	0.11
317	600707	彩虹股份	11,700	75,582.00	0.11
318	300735	光弘科技	3,000	75,300.00	0.11
319	002670	国盛金控	5,000	75,250.00	0.11
320	600062	华润双鹤	4,000	74,640.00	0.11
321	600578	京能电力	16,600	74,534.00	0.11
322	003031	中瓷电子	1,400	74,494.00	0.11

323	600056	中国医药	7,200	74,448.00	0.11
324	600352	浙江龙盛	7,300	74,168.00	0.11
325	002508	老板电器	3,900	74,139.00	0.11
326	601019	山东出版	7,800	73,866.00	0.11
327	688281	华秦科技实业	1,198	72,490.98	0.10
328	688318	财富趋势	629	72,284.68	0.10
329	000027	深圳能源	11,300	72,094.00	0.10
330	600361	创新新材	18,000	71,820.00	0.10
331	603233	大参林	4,400	71,720.00	0.10
332	000883	湖北能源	15,900	71,709.00	0.10
333	000967	盈峰环境	10,300	71,585.00	0.10
334	002595	豪迈科技	1,200	71,064.00	0.10
335	000009	中国宝安	8,000	71,040.00	0.10
336	000400	许继电气	3,200	69,664.00	0.10
337	300919	中伟股份	2,100	69,048.00	0.10
338	002831	裕同科技	2,900	67,918.00	0.10
339	002353	杰瑞股份	1,900	66,500.00	0.10
340	600884	杉杉股份	7,000	66,220.00	0.09
341	002572	索菲亚	4,700	65,847.00	0.09
342	002266	浙富控股	21,300	65,604.00	0.09
343	300024	机器人	3,800	65,284.00	0.09
344	300724	捷佳伟创	1,200	65,160.00	0.09
345	000543	皖能电力	9,200	64,400.00	0.09

346	002008	大族激光	2,600	63,362.00	0.09
347	300763	锦浪科技	1,100	63,129.00	0.09
348	688387	中信科移动	11,149	62,991.85	0.09
349	301358	湖南裕能	2,000	62,380.00	0.09
350	300957	贝泰妮	1,400	61,908.00	0.09
351	688702	盛科通信	1,001	61,141.08	0.09
352	600143	金发科技	5,900	60,829.00	0.09
353	603658	安图生物	1,600	60,000.00	0.09
354	600873	梅花生物	5,600	59,864.00	0.09
355	002153	石基信息	6,700	58,022.00	0.08
356	002444	巨星科技	2,200	56,122.00	0.08
357	000537	中绿电	6,700	56,012.00	0.08
358	601179	中国西电	9,100	55,874.00	0.08
359	603786	科博达	1,000	55,410.00	0.08
360	600312	平高电气	3,600	55,404.00	0.08
361	601717	郑煤机	3,300	54,846.00	0.08
362	600098	广州发展	8,600	53,750.00	0.08
363	001286	陕西能源	6,100	53,070.00	0.08
364	603707	健友股份	4,700	52,405.00	0.07
365	601216	君正集团	9,400	51,888.00	0.07
366	688375	国博电子	852	51,128.52	0.07
367	002056	横店东磁	3,600	50,940.00	0.07
368	002837	英维克	1,700	50,507.00	0.07
369	605589	圣泉集团	1,800	49,950.00	0.07

370	300390	天华新能	2,600	49,582.00	0.07
371	000893	亚钾国际	1,600	48,224.00	0.07
372	000528	柳工	5,000	48,050.00	0.07
373	688065	凯赛生物	1,010	47,571.00	0.07
374	001696	宗申动力	2,100	47,145.00	0.07
375	301267	华夏眼科	2,400	46,008.00	0.07
376	002608	江苏国信	6,200	45,446.00	0.06
377	600141	兴发集团	2,200	45,166.00	0.06
378	601921	浙版传媒	5,600	45,136.00	0.06
379	688100	威胜信息	1,210	44,830.50	0.06
380	000039	中集集团	5,700	44,802.00	0.06
381	600032	浙江新能	5,900	44,604.00	0.06
382	601139	深圳燃气	7,000	44,520.00	0.06
383	002683	广东宏大	1,300	44,122.00	0.06
384	688772	珠海冠宇电池	3,024	43,212.96	0.06
385	301165	锐捷网络	700	43,022.00	0.06
386	003035	南网能源	9,300	42,687.00	0.06
387	688017	绿的谐波	337	42,087.93	0.06
388	688778	厦钨新能源	749	41,884.08	0.06
389	300751	迈为股份	600	41,736.00	0.06
390	688676	海南金盘智能科技	1,218	40,742.10	0.06
391	002461	珠江啤酒	3,600	40,644.00	0.06



392	600486	扬农化工	700	40,600.00	0.06
393	688475	萤石网络	1,284	40,471.68	0.06
394	601061	中信金属	5,100	40,341.00	0.06
395	603728	鸣志电器	700	40,229.00	0.06
396	601858	中国科传	2,000	38,900.00	0.06
397	688172	燕东微电子股份	1,962	38,572.92	0.06
398	603338	浙江鼎力	800	37,920.00	0.05
399	600927	永安期货	2,500	37,025.00	0.05
400	002064	华峰化学	5,600	37,016.00	0.05
401	300567	精测电子	600	36,366.00	0.05
402	002312	川发龙蟒	3,100	35,588.00	0.05
403	300487	蓝晓科技	700	35,210.00	0.05
404	000683	博源化工	7,300	34,967.00	0.05
405	600499	科达制造	3,500	34,300.00	0.05
406	603379	三美股份	700	33,684.00	0.05
407	603298	杭叉集团	1,600	33,520.00	0.05
408	000539	粤电力 A	7,300	33,142.00	0.05
409	000830	鲁西化工	3,200	32,960.00	0.05
410	300140	节能环保	5,100	31,467.00	0.04
411	600582	天地科技	5,100	30,549.00	0.04
412	603077	和邦生物	17,300	30,275.00	0.04
413	300757	罗博特	200	29,994.00	0.04

		科			
414	600378	昊华科技	1,100	29,777.00	0.04
415	003022	联泓新科	1,800	28,494.00	0.04
416	603688	石英股份	800	28,176.00	0.04
417	688349	三一重能	1,092	27,234.48	0.04
418	002430	杭氧股份	1,400	27,188.00	0.04
419	600528	中铁工业	3,400	25,092.00	0.04
420	601608	中信重工	5,600	24,472.00	0.03
421	688248	南方电网电力科技	754	23,720.84	0.03
422	601106	中国一重	8,400	23,520.00	0.03
423	603556	海兴电力	900	22,923.00	0.03
424	603650	彤程新材	700	22,505.00	0.03
425	603225	新凤鸣	2,100	22,365.00	0.03
426	688032	禾迈股份	221	22,069.06	0.03
427	601158	重庆水务	4,700	21,808.00	0.03
428	688153	唯捷创芯	702	21,769.02	0.03
429	688425	铁建重工	4,911	20,036.88	0.03
430	600956	新天绿能	2,500	19,300.00	0.03
431	601568	北元集团	4,400	18,260.00	0.03
432	001389	广合科技	300	17,631.00	0.03
433	688819	天能电池集团股份	606	16,822.56	0.02
434	603868	飞科电器	400	14,348.00	0.02

435	603826	坤彩科技	600	11,742.00	0.02
436	600299	安迪苏	1,100	10,615.00	0.02
437	688295	中复神鹰碳纤维	277	5,761.60	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	302132	中航成飞	1,100	96,734.00	0.14

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	600673	东阳光	1,209,377.00	1.60
2	002966	苏州银行	974,703.00	1.29
3	600839	四川长虹	857,650.00	1.13
4	600398	海澜之家	771,825.00	1.02
5	600177	雅戈尔	761,146.00	1.01
6	600782	新钢股份	754,699.00	1.00
7	601933	永辉超市	625,527.00	0.83
8	300476	胜宏科技	612,212.00	0.81
9	600988	赤峰黄金	581,455.00	0.77
10	601577	长沙银行	567,778.00	0.75
11	601061	中信金属	515,514.00	0.68
12	601128	常熟银行	489,465.00	0.65
13	300251	光线传媒	471,361.00	0.62
14	600612	老凤祥	440,864.00	0.58
15	600298	安琪酵母	436,461.00	0.58
16	603568	伟明环保	430,735.00	0.57
17	000932	华菱钢铁	423,491.00	0.56
18	002517	恺英网络	416,137.00	0.55
19	600008	首创环保	415,915.00	0.55

20	300957	贝泰妮	412,756.00	0.55
----	--------	-----	------------	------

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	600839	四川长虹	1,319,381.00	1.74
2	002966	苏州银行	931,145.00	1.23
3	600782	新钢股份	743,747.00	0.98
4	603605	珀莱雅	715,554.00	0.95
5	002916	深南电路	703,544.00	0.93
6	601933	永辉超市	663,773.00	0.88
7	601577	长沙银行	662,551.00	0.88
8	600418	江淮汽车	662,452.00	0.88
9	600008	首创环保	653,092.00	0.86
10	002261	拓维信息	649,912.00	0.86
11	603568	伟明环保	640,874.00	0.85
12	002128	电投能源	604,551.00	0.80
13	300957	贝泰妮	594,363.00	0.79
14	600487	亨通光电	593,203.00	0.78
15	688363	华熙生物	584,685.14	0.77
16	300888	稳健医疗	584,419.00	0.77
17	601233	桐昆股份	556,744.00	0.74
18	601061	中信金属	543,331.00	0.72
19	601128	常熟银行	532,150.00	0.70
20	601872	招商轮船	515,780.00	0.68

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	89,956,479.68
卖出股票收入（成交）总额	100,950,846.20

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,105,761.29	1.58

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,105,761.29	1.58

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019766	25 国债 01	9,000	903,966.66	1.29
2	019758	24 国债 21	2,000	201,794.63	0.29

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金按照风险管理的原则，以套期保值为目的，参与股指期货交易。
本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及

中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

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

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

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

7.12.2

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	700,080.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,985.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	703,065.86

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

份额 级别	持有人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份 额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
汇添 富中 证 500 基本 面增 强指 数 A	1,642	39,040.30	0.00	0.00	64,104,165.91	100.00
汇添 富中 证 500 基本 面增 强指 数 C	1,525	14,290.39	0.00	0.00	21,792,846.50	100.00
合计	3,167	27,122.52	0.00	0.00	85,897,012.41	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	666,330.78	1.04
	汇添富中证 500	0.00	0.00

	基本面增强指数 C		
	合计	666,330.78	0.78

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	0
	汇添富中证 500 基本面增强指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	50~100
	汇添富中证 500 基本面增强指数 C	0
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C
基金合同生效日 （2021 年 09 月 16 日）基金份额总额	166,454,950.83	123,271,276.27
本报告期期初基金份额总额	73,317,028.96	23,866,196.18
本报告期基金总申购份额	1,576,238.73	2,822,250.69
减：本报告期基金总赎回份额	10,789,101.78	4,895,600.37
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	64,104,165.91	21,792,846.50

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。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

### 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

注：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(%)	
招商证券	4	73,876,327.03	38.70	13,000.60	38.71	
华泰证券	4	36,258,410.71	18.99	6,378.51	18.99	
平安证券	1	31,887,378.00	16.70	5,609.34	16.70	
中信证券	5	25,727,874.26	13.48	4,525.44	13.47	
中信建投证券	4	22,413,783.22	11.74	3,943.27	11.74	
国泰海通	6	743,552.66	0.39	130.79	0.39	
财通证券	2	—	—	—	—	
长江证券	2	—	—	—	—	
大和证券	2	—	—	—	—	
东北证券	1	—	—	—	—	
东方证券	2	—	—	—	—	
东吴证券	3	—	—	—	—	
方正证券	2	—	—	—	—	
广发证券	3	—	—	—	—	
国金证券	2	—	—	—	—	
国联证券	2	—	—	—	—	
国投证券	2	—	—	—	—	

华安 证券	1	-	-	-	-	
华西 证券	2	-	-	-	-	
华兴 证券	2	-	-	-	-	
摩根 大通 证券	2	-	-	-	-	
上海 证券	2	-	-	-	-	
申万 宏源 证券	3	-	-	-	-	
太平 洋证 券	1	-	-	-	-	
天风 证券	2	-	-	-	-	
西部 证券	2	-	-	-	-	
野村 东方 国际	2	-	-	-	-	
银河 证券	2	-	-	-	-	
粤开 证券	1	-	-	-	-	
浙商 证券	1	-	-	-	-	
中金 财富	2	-	-	-	-	
中泰 证券	2	-	-	-	-	
中邮 证券	2	-	-	-	-	

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

#### 10.7.2 基金租用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 (%)
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,297,027.00	100.00	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	2,000,000.00	100.00	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大和	-	-	-	-	-	-	-	-

证 券								
东 北 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东 方 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东 吴 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
方 正 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广 发 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国 金 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国 联 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国 投 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华 安 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华 西 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华 兴	-	-	-	-	-	-	-	-

证 券								
摩 根 大 通 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
上 海 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申 万 宏 源 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
太 平 洋 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天 风 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西 部 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
野 村 东 方 国 际	-	-	-	-	-	-	-	-
银 河 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤 开 证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮 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:

本基金本报告期内新增 8 家证券公司的 16 个交易单元:招商证券(上交所单元,深交所单元)、中信证券(深交所单元,上交所单元)、银河证券(深交所单元,上交所单元)、华泰

证券（上交所单元，深交所单元）、国泰海通（深交所单元，上交所单元）、华西证券（深交所单元，上交所单元）、中金财富（深交所单元，上交所单元）、广发证券（深交所单元，上交所单元）；不再租用 3 家证券公司的 5 个交易单元：开源证券（深交所单元，上交所单元）、平安证券（上交所单元）、川财证券（上交所单元，深交所单元）。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 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
2	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数许可使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	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 03 月 20 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新法律文件	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所	2025 年 03 月 20 日
4	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	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 03 月 21 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新产品资料概要	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 03 月 21 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（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
7	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
8	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
9	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
10	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	上证报, 中国证监会基金电子披露网站,	2025 年 06 月 26 日



	公司合作关系的公告	公司网站	
--	-----------	------	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 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](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2025 年 08 月 29 日