

汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金联接基金（LOF）(原汇添富中证 500 指
数型发起式证券投资基金（LOF）)2025 年第
4 季度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2026 年 01 月 22 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

自 2025 年 10 月 31 日起，汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）转型为汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）。本报告中，汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的报告期自 2025 年 10 月 01 日起至 2025 年 10 月 30 日止，汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的报告期自 2025 年 10 月 31 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	汇添富中证 500ETF 联接（LOF）
基金主代码	501036
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 10 月 31 日
报告期末基金份额总额(份)	236,846,480.66
投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

投资策略	<p>本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。</p> <p>为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</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>本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；目标 ETF 的投资策略；成份股、备选成份股投资策略；固定收益类资产投资策略；金融衍生工具投资策略；融资及转融通投资策略；存托凭证的投资策略等。</p>	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 × 95% + 银行人民币活期存款利率（税后）× 5%	
风险收益特征	本基金为汇添富中证 500ETF 的联接基金，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，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金通过投资目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) A	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	158,585,033.73	78,261,446.93

注：汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) A 类份额扩位证券简称：中证 500LOF；汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C 类份额扩位证券简称：中证 500LOFC。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	563750

基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 10 月 22 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 10 月 30 日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	招商证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 特殊情况包括但不限于以下情形：(1) 法律法规的限制；(2) 标的指数成份股流动性严重不足；(3) 标的指数的成份股票长期停牌；(4) 其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF)
基金主代码	501036
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 08 月 10 日
报告期末基金份额总额(份)	256,662,592.91
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的

	指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金份额总额(份)	173,567,208.64	83,095,384.27

注：汇添富中证 500 指数 (LOF) A 类份额扩位证券简称：中证 500LOF；汇添富中证 500 指数 (LOF) C 类份额扩位证券简称：中证 500LOFC。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2025 年 10 月 31 日 – 2025 年 12 月 31 日)
--------	--

	汇添富中证500ETF联接(LOF) A	汇添富中证500ETF联接(LOF) C
1.本期已实现收益	24,156,883.18	11,440,885.60
2.本期利润	2,151,284.15	1,375,778.61
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0128	0.0166
4.期末基金资产净值	224,714,231.41	108,826,054.30
5.期末基金份额净值	1.4170	1.3905

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

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

3、本基金的《基金合同》生效日为2025年10月31日，至本报告期末不满一季度，因此主要财务指标只列示从基金合同生效日至2025年12月31日数据，特此说明。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2025年10月01日 - 2025年10月30日)	
	汇添富中证500指数(LOF)A	汇添富中证500指数(LOF)C
1.本期已实现收益	18,820,326.02	14,123,234.54
2.本期利润	-1,584,922.70	-12,267,277.34
3.加权平均基金份额 本期利润	-0.0089	-0.0613
4.期末基金资产净值	243,293,907.63	114,341,746.16
5.期末基金份额净值	1.4017	1.3760

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

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

3.2 基金净值表现（转型后）

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500ETF联接(LOF)A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	1.09%	1.01%	1.04%	1.03%	0.05%	-0.02%
汇添富中证500ETF联接(LOF)C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	1.05%	1.01%	1.04%	1.03%	0.01%	-0.02%

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

汇添富中证500ETF联接(LOF)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500ETF联接(LOF)C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为2025年10月31日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金由原汇添富中证500指数量型发起式证券投资基金(LOF)于2025年10月31日转型而来。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证500指数(LOF)A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自2025-08-01至2025-10-30	17.78%	1.30%	17.65%	1.30%	0.13%	0.00%
自2025-05-01至2025-10-30	31.41%	1.05%	29.43%	1.05%	1.98%	0.00%
自2024-11-01	25.52%	1.27%	23.91%	1.27%	1.61%	0.00%

至 2025-10-30						
自 2022-11-01 至 2025-10-30	30.29%	1.26%	26.13%	1.29%	4.16%	-0.03%
自 2020-11-01 至 2025-10-30	34.01%	1.21%	20.40%	1.23%	13.61%	-0.02%
自 2017-08-10 至 2025-10-30	40.17%	1.28%	16.84%	1.31%	23.33%	-0.03%
汇添富中证 500 指数（LOF）C						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	① - ③	② - ④
自 2025-08-01 至 2025-10-30	17.72%	1.30%	17.65%	1.30%	0.07%	0.00%
自 2025-05-01 至 2025-10-30	31.26%	1.05%	29.43%	1.05%	1.83%	0.00%
自 2024-11-01 至 2025-10-30	25.26%	1.27%	23.91%	1.27%	1.35%	0.00%
自 2022-11-01 至 2025-10-30	29.46%	1.26%	26.13%	1.29%	3.33%	-0.03%
自 2020-11-01 至 2025-10-30	32.47%	1.21%	20.40%	1.23%	12.07%	-0.02%
自 2017-08-10 至 2025-10-30	37.60%	1.28%	16.84%	1.31%	20.76%	-0.03%

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指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数（LOF）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》生效之日起6个月内，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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监	2025 年 10 月 31 日	-	19	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

				理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月 16 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。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗
--	--	--	--	--

				主题指数组型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年7月28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数组型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至2025年10月30日任汇添富中证500指数组型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年3月23日至2024年4月26日任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理。2019年7月26日至2022年6月13日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数组型证券投资基金的基金经理。2019年9月24日至2022年6月13日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数组型证券投资基金联接基金的基金经理。2019年11月6日至2022年6月13日任汇添富中证国企一带一路交易型开放
--	--	--	--	---

				式指数证券投资 基金的基金经理。 2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富 中证国企一带一路 交易型开放式指 数证券投资基金的基 金经理。2021 年 10 月 29 日至今任 汇添富 MSCI 中 国 A50 互联互通 交易型开放式指 数证券投资基金的基 金经理。 2022 年 1 月 11 日 至 2024 年 4 月 15 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通 交易型开放式指 数证券投资基金的基 金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇 添富中证智能汽 车主题交易型开 放式指数证券投资 基金的基金经理。 2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日任汇添富 中证沪港深张江 自主创新 50 交易 型开放式指数证 券投资基金的基 金经理。2023 年 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇 添富中证 500 指 数增强型证券投资 基金的基金经理。 2023 年 6 月 6 日至 2025 年 11 月 10 日任汇添富
--	--	--	--	--

				量化选股混合型 证券投资基金的 基金经理。2023 年 9 月 1 日至今 任汇添富稳健回 报债券型证券投资 基金的基金经理。 2023 年 11 月 7 日至今任汇添 富国证 2000 指数 增强型证券投资基 金的基金经理。 2023 年 11 月 22 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富 上证综合交易型 开放式指数证券投资 基金的基金经理。 2024 年 1 月 31 日至今任汇 添富稳丰回报债 券型发起式证券投资 基金的基金经理。 2024 年 12 月 10 日至 2024 年 12 月 11 日任 汇添富中证 A500 指数型证券投资基 金的基金经理。 2024 年 12 月 12 日至今任汇添 富中证 A500 交易 型开放式指数证券投资 基金联接基金的基金经 理。2025 年 3 月 27 日至今任汇添 富中证 A500 指数 增强型证券投资基 金的基金经理。 2025 年 10 月 31 日至今任汇添 富中证 500 交易 型开放式指数证券投资 基金联接基金 (LOF) 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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。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:吴振翔—离任产品类型:公募基金,离任数量:1 只,离任时间:2025 年 11 月 10 日;离任产品类型:私募资产管理计划,离任数量:1 只,离任时间:2025 年 12 月 29 日。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介(转型前)

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部 副总监	2017 年 08 月 10 日	2025 年 10 月 30 日	19	国籍:中国。学 历:中国科学技术大学管理学博 士。从业资格: 证券投资基金从 业资格。从业经 历:曾任长盛基 金管理有限公司 金融工程研究 员、上投摩根基 金管理有限公司 产品开发高级经 理。2008 年 3 月 加入汇添富基金 管理股份有限公 司,历任产品开 发高级经理、数 量投资高级分析 师、基金经理助 理,现任指数与 量化投资部副总 监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添 富上证综合指数 证券投资基金的

				基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月 16 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。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数组型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数组型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 8 月 10 日至 2025 年 10 月 30 日任汇添富中证 500 指数组型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式
--	--	--	--	---

				指数证券投资基 金的基金经理。 2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角 一体化发展主题交 易型开放式指数证券 投资基金联接基金的基 金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇 添富中证国企一带一路 交易型开放式指数证券投 资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富 中证国企一带一路交易型开放 式指数证券投资基 金联接基金的基 金经理。2021 年 10 月 29 日至今 任汇添富 MSCI 中国 A50 互 联网互通交易型开 放式指数证券投 资基金联接基金 的基金经理。 2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互 联网互通交易型开 放式指数证券投 资基金联接基金 的基金经理。 2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中 证智能汽车主题 交易型开放式指 数证券投资基 金的基金经理。 2022 年 4 月 28
--	--	--	--	--

				日至 2024 年 4 月 30 日任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至 2025 年 11 月 10 日任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 22 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳丰回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 10 日至 2024 年 12 月 11 日任汇添富中证 A500 指数型证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 12 日至今
--	--	--	--	--

					任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。 2025 年 3 月 27 日至今任汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金管理的基金经理。2025 年 10 月 31 日至今任汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金管理的基金经理(LOF)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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
吴振翔	公募基金	12	17,966,307,104.76	2010 年 2 月 6 日
	私募资产管理计划	1	12,847,798.93	2025 年 3 月 11 日
	其他组合	-	-	
	合计	13	17,979,154,903.69	

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：

吴振翔—离任产品类型：公募基金，离任数量：1 只，离任时间：2025 年 10 月 30 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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025 年四季度 A 股分化明显。10 月初中美关税摩擦冲击全球市场，10-11 月 A 股主要指数震荡下行；11 月下旬至年末显著修复。整体来看，中证 800 指数微涨 0.02%。行业方面，通信、有色、石化领涨，地产、传媒、医药领跌。

四季度中美关税摩擦升级，中方强化稀土产业链管控，美方提升关税并拟限制关键软件出口。但此次冲击影响弱于前次，因摩擦局限于中美之间，且市场预期谈判缓和。后续中美经贸会谈取得积极成果，关税摩擦显著缓和，市场对关税冲击敏感度大幅下降。

四季度人民币汇率大幅走强，年末中间价接近 7.0、离岸突破 7.0，国内货币政策宽松空间充足。经济数据整体稳中向好，结构分化显著。出口在关税扰动下保持韧性，制造业平稳；投资、消费相对偏弱，固投、基建投资 11 月同比降幅收窄；社会消费品零售总额同比下滑，服务消费增长较快，消费动能待提振。

中证 500 指数是 A 股市场代表性宽基指数之一，有着典型的中盘股特征属性，本基金则是这一代表性指数的产品化形式，为投资者提供了配置国内权益资产的优质工具。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，以汇添富中证 500ETF 为主要投资标的，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2025 年 10 月 31 日转型为汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)。转型前，本报告期汇添富中证 500 指数(LOF)A 类份额净值增长率为 -0.54%，同期业绩比较基准收益率为 -0.33%。本报告期汇添富中证 500 指数(LOF)C 类份额净值增长率为 -0.56%，同期业绩比较基准收益率为 -0.33%。转型后，本报告期汇添富中证 500ETF 联接(LOF)A 类份额净值增长率为 1.09%，同期业绩比较基准收益率为 1.04%。本报告期

汇添富中证500ETF联接(LOF)C类份额净值增长率为1.05%，同期业绩比较基准收益率为1.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告(转型后)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	815,933.76	0.24
	其中：股票	815,933.76	0.24
2	基金投资	306,738,457.92	89.99
3	固定收益投资	12,516,921.97	3.67
	其中：债券	12,516,921.97	3.67
	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	18,234,935.45	5.35
8	其他资产	2,570,114.75	0.75
9	合计	340,876,363.85	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
汇添富中证500交易型开	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理股份有	306,738,457.92	91.96

开放式指数证券投资基金			限公司		
-------------	--	--	-----	--	--

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末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	303,150.56	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	440,225.76	0.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,694.44	0.01
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	43,028.00	0.01
K	房地产业	2,835.00	0.00
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	815,933.76	0.24

5.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600930	华电新能源集团	70,549	440,225.76	0.13
2	301656	联合动力	3,235	82,363.10	0.02
3	688775	影石创新	295	69,295.50	0.02
4	601198	东兴证券	3,100	43,028.00	0.01
5	688729	屹唐半导体股份	1,676	40,693.28	0.01
6	301678	新恒汇	382	24,532.04	0.01
7	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
8	301590	优优绿能	73	12,942.90	0.00
9	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
10	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	12,515,843.35	3.75
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)	1,078.62	0.00

8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	12,516,921.97	3.75

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019773	25国债08	101,000	10,201,974.03	3.06
2	019785	25国债13	23,000	2,313,869.32	0.69
3	123259	锦浪转02	4	589.45	0.00
4	127108	太能转债	4	489.17	0.00

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 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。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2603	IC2603	5.00	7,366,600.00	537,080.00	
公允价值变动总额合计(元)				537,080.00	
股指期货投资本期收益(元)				294,744.87	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				-72,560.00	

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，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，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，东兴证券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。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,589,948.34
2	应收证券清算款	305,258.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	674,907.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,570,114.75

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127108	太能转债	489.17	0.00

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600930	华电新能源集团	440,225.76	0.13	新股流通受限
2	301656	联合动力	82,363.10	0.02	新股流通受限
3	688729	屹唐半导体股份	40,693.28	0.01	新股流通受限
4	301563	云汉芯城	14,705.90	0.00	新股流通受限
5	301584	建发致新	11,988.54	0.00	新股流通受限
6	301609	山大电力	11,354.23	0.00	新股流通受限

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	329,664,581.23	91.00
	其中：股票	329,664,581.23	91.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,947,750.25	3.57
	其中：债券	12,947,750.25	3.57
	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	14,224,918.53	3.93
8	其他资产	5,427,643.76	1.50
9	合计	362,264,893.77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	711,262.00	0.20
B	采矿业	11,976,258.00	3.35
C	制造业	217,206,914.67	60.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,494,482.65	2.93
E	建筑业	2,741,175.00	0.77
F	批发和零售业	6,085,219.56	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	4,791,132.30	1.34

H	住宿和餐饮业	696,784.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,446,869.04	7.95
J	金融业	29,249,790.35	8.18
K	房地产业	4,115,379.81	1.15
L	租赁和商务服务业	2,313,282.60	0.65
M	科学研究和技术服务业	2,260,054.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	1,392,466.32	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	472,484.00	0.13
Q	卫生和社会工作	1,272,733.24	0.36
R	文化、体育和娱乐业	3,425,753.00	0.96
S	综合	1,189,518.00	0.33
	合计	328,841,558.54	91.95

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	345,371.48	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	445,869.68	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	28,946.53	0.01
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	2,835.00	0.00
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	823,022.69	0.23

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	21,600	7,097,760.00	1.98
2	000988	华工科技	35,900	3,004,830.00	0.84
3	300450	先导智能	39,200	2,324,560.00	0.65
4	688521	芯原微电子	12,642	2,055,589.20	0.57
5	002156	通富微电	43,400	1,939,112.00	0.54
6	300207	欣旺达	52,800	1,932,480.00	0.54
7	600580	卧龙电驱	39,080	1,900,851.20	0.53
8	300803	指南针	12,790	1,860,305.50	0.52
9	600988	赤峰黄金	59,500	1,764,770.00	0.49
10	300339	润和软件	28,500	1,721,970.00	0.48

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

投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600930	华电新能源集团	70,549	445,869.68	0.12
2	688775	影石创新	295	87,039.75	0.02
3	301656	联合动力	3,235	73,628.60	0.02
4	688729	屹唐半导体股份	1,676	42,503.36	0.01
5	301678	新恒汇	382	25,853.76	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	12,485,673.29	3.49
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)	462,076.96	0.13
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	12,947,750.25	3.62

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

1	019773	25国债 08	101,000	10,177,460.08	2.85
2	019785	25国债 13	23,000	2,308,213.21	0.65
3	113699	金25转 债	870	137,910.37	0.04
4	113696	伯25转 债	910	127,160.43	0.04
5	127108	太能转 债	1,014	123,601.66	0.03

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买 /卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说 明
IC2512	IC2512	5.00	7,307,200.00	609,640.00	
公允价值变动总额合计(元)				609,640.00	
股指期货投资本期收益(元)					-
股指期货投资本期公允价值变动(元)				18,400.00	

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，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，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,273,636.30
2	应收证券清算款	2,855,568.61
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,298,438.85
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,427,643.76

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127108	太能转债	123,601.66	0.03

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600930	华电新能源集团	445,869.68	0.12	新股流通受限
2	688775	影石创新	87,039.75	0.02	新股流通受限
3	301656	联合动力	73,628.60	0.02	新股流通受限
4	688729	屹唐半导体股份	42,503.36	0.01	新股流通受限
5	301678	新恒汇	25,853.76	0.01	新股流通受限

§ 6 开放式基金份额变动 (转型后)

单位:份

项目	汇添富中证 500ETF 联接(LOF) A	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C
基金合同生效日(2025 年 10 月 31 日)基金份额总额	173,567,208.64	83,095,384.27
本报告期内基金总申购份额	9,731,528.86	16,856,692.47
减: 本报告期内基金总赎回	24,713,703.77	21,690,629.81

份额		
本报告期基金拆分变动 份额	-	-
本报告期末基金份额 总额	158,585,033.73	78,261,446.93

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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	汇添富中证500指数(LOF)A	汇添富中证500指数(LOF)C
本报告期期初基金份额总额	178,217,343.97	336,452,440.08
本报告期基金总申购份额	10,941,184.05	7,604,710.54
减：本报告期基金总赎回份额	15,591,319.38	260,961,766.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	173,567,208.64	83,095,384.27

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况（转型前）

注：本基金成立后有10,002,700.27份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2017年08月10日起3年。截至本报告期期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为0.00份。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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10月1日至2025年10月16日	172,670,566.79	-	172,670,566.79	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、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。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》；
- 5、《汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）在规定报刊上披露的各项公告；
- 8、报告期内汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）在规定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

10.2 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

10.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 01 月 22 日