汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金(原汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金)2025 年年度报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

自 2025 年 08 月 07 日起，汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金转型为汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金。本报告中，汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 08 月 06 日止，汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的报告期自 2025 年 08 月 07 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....3
1.1 重要提示.....3
1.2 目录.....4
§2 基金简介.....7
2.1 基金基本情况（转型后）.....7
2.1 基金基本情况（转型前）.....7
2.2 基金产品说明（转型后）.....8
2.2 基金产品说明（转型前）.....9
2.3 基金管理人和基金托管人.....9
2.4 信息披露方式.....10
2.5 其他相关资料.....10
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....10
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）.....10
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）.....11
3.2 基金净值表现（转型后）.....14
3.2 基金净值表现（转型前）.....17
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）.....21
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）.....21
§4 管理人报告.....21
4.1 基金管理人及基金经理情况.....21
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....35
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....35
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.....37
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....38
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....38
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....39
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....39
4.9 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.....40
§5 托管人报告.....40
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....40
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.....40
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....40
§6 审计报告（转型后）.....40
6.1 审计报告的基本信息.....40
6.2 审计报告的基本内容.....40
§6 审计报告（转型前）.....42
6.1 审计报告的基本信息.....42
6.2 审计报告的基本内容.....43

§7 年度财务报表（转型后）..... 44
7.1 资产负债表..... 45
7.2 利润表..... 46
7.3 净资产变动表..... 47
7.4 报表附注..... 48
§7 年度财务报表（转型前）..... 77
7.1 资产负债表..... 77
7.2 利润表..... 78
7.3 净资产变动表..... 79
7.4 报表附注..... 81
§8 投资组合报告（转型后）..... 115
8.1 期末基金资产组合情况..... 115
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... 116
8.3 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..... 116
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... 116
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... 117
8.6 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..... 118
8.7 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..... 118
8.8 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..... 118
8.9 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..... 118
8.10 本基金投资股指期货的投资政策..... 118
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... 118
8.12 本报告期投资基金情况..... 118
8.13 投资组合报告附注..... 119
§8 投资组合报告（转型前）..... 120
8.1 期末基金资产组合情况..... 120
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... 120
8.3 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..... 121
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... 124
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... 126
8.6 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..... 126
8.7 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..... 126
8.8 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..... 126
8.9 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..... 127
8.10 本基金投资股指期货的投资政策..... 127
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... 127
8.12 投资组合报告附注..... 127
§9 基金份额持有人信息（转型后）..... 128
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... 128
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... 128
9.3 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..... 129
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况..... 129

§9 基金份额持有人信息（转型前）..... 129
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... 129
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... 130
9.3 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..... 130
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况..... 131
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况..... 131
§10 开放式基金份额变动（转型后）..... 131
§10 开放式基金份额变动（转型前）..... 132
§11 重大事件揭示..... 132
11.1 基金份额持有人大会决议..... 132
11.2 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..... 132
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... 133
11.4 基金投资策略的改变..... 133
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... 133
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况..... 133
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）..... 134
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）..... 138
11.8 其他重大事件（转型后）..... 141
11.8 其他重大事件（转型前）..... 142
§12 影响投资者决策的其他重要信息..... 143
12.1 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..... 143
12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... 143
§13 备查文件目录..... 143
13.1 备查文件目录..... 143
13.2 存放地点..... 144
13.3 查阅方式..... 144

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接	
基金主代码	014543	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 08 月 07 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	674,742,619.36	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	014543	014544
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	292,425,063.85	382,317,555.51

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159273
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 07 月 28 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 08 月 06 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	招商银行股份有限公司

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金
基金简称	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式
基金主代码	014543
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 28 日

基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	858,476,465.03	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C
下属分级基金的交易代码	014543	014544
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	284,861,985.47	573,614,479.56

2.2 基金产品说明（转型后）

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	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。 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、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；融资投资策略；国债期货投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证沪港深云计算产业指数收益率×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沪港深云计算产业 ETF 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。 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。本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.2.1 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。 本基金的投资策略主要包括：1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、金融衍生工具投资策略；5、参与融资投资策略；6、参与转融通证券出借业务策略；7、存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	中证沪港深云计算产业指数收益率
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。 本基金除了投资 A 股以外，还将根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.2 基金产品说明（转型前）

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。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、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、融资投资策略、国债期货投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证沪港深云计算产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。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。 本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	张姗
	联系电话	021-28932888	400-61-95555
	电子邮箱	service@99fund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-9918	400-61-95555
传真		021-28932998	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	鲁伟铭	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 日	
	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C
本期已实现收益	119,047,917.32	196,903,582.16
本期利润	125,372,936.79	190,822,593.13
加权平均基金份额本期利润	0.3952	0.3774
本期加权平均净值利润率	24.18%	23.46%
本期基金份额净值增长率	30.69%	30.55%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	80,066,000.94	99,533,246.06
期末可供分配基金份额利润	0.2738	0.2603
期末基金资产净值	504,869,621.76	652,163,967.21
期末基金份额净值	1.7265	1.7058
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	

基金份额累计净值增长率	30.69%	30.55%

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。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2025 年 08 月 07 日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和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 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 01 月 01 日-2025 年 08 月 06 日		2024 年		2023 年	
	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C
本期已实现收益	-3,589,594.95	-9,119,378.98	64,985.73	-724,506.11	15,047.19	-97,885.23
本期利润	51,060,655.48	46,662,501.39	19,619,877.90	19,560,555.51	-10,842,372.72	-10,374,036.82

加权平均基金份额本期利润	0.1891	0.0881	0.1629	0.1923	-0.1584	-0.1613
本期加权平均净值利润率	16.68%	7.80%	19.46%	23.28%	-17.39%	-17.72%
本期基金份额净值增长率	31.05%	30.80%	24.73%	24.18%	2.46%	2.22%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年 08 月 06 日		2024 年末		2023 年末	
期	-27,361,712	-59,509,378	-12,319,721	-11,263,883	-16,721,761	-17,817,885

末可供分配利润	.94	.37	.14	.98	.31	.34
期末可供分配基金份额利润	-0.0961	-0.1037	-0.0878	-0.0939	-0.1918	-0.1956
期末基金资产净值	376,341,903.89	749,497,365.98	141,445,076.70	119,796,989.26	70,454,650.73	73,270,380.21
期末基金份额净值	1.3211	1.3066	1.0081	0.9989	0.8082	0.8044
3.1.3 累计期末指标	2025 年 08 月 06 日		2024 年末		2023 年末	
基	32.11%	30.66%	0.81%	-0.11%	-19.18%	-19.56%

金份额累计净值增长率						

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（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

汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.22%	1.99%	-0.13%	1.99%	-0.09%	0.00%
自基金合同生效起至今	30.69%	2.34%	31.77%	2.35%	-1.08%	-0.01%
汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三	-0.29%	1.98%	-0.13%	1.99%	-0.16%	-0.01%

个月						
自基金合同生效起至今	30.55%	2.33%	31.77%	2.35%	-1.22%	-0.02%

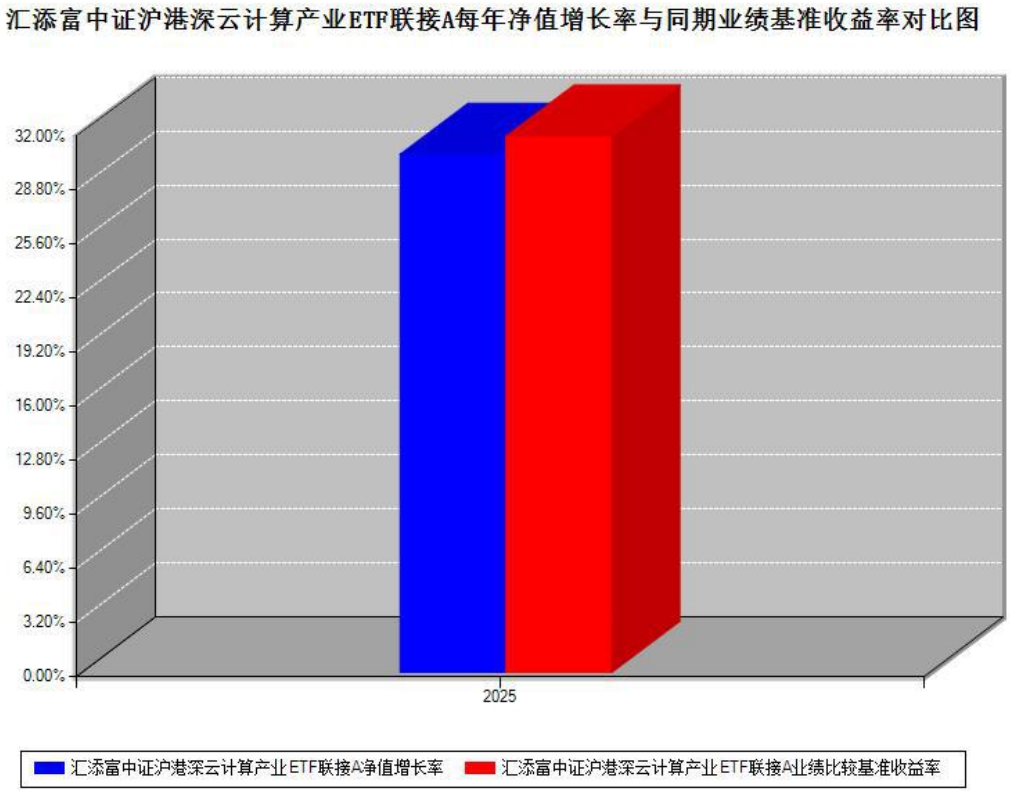
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

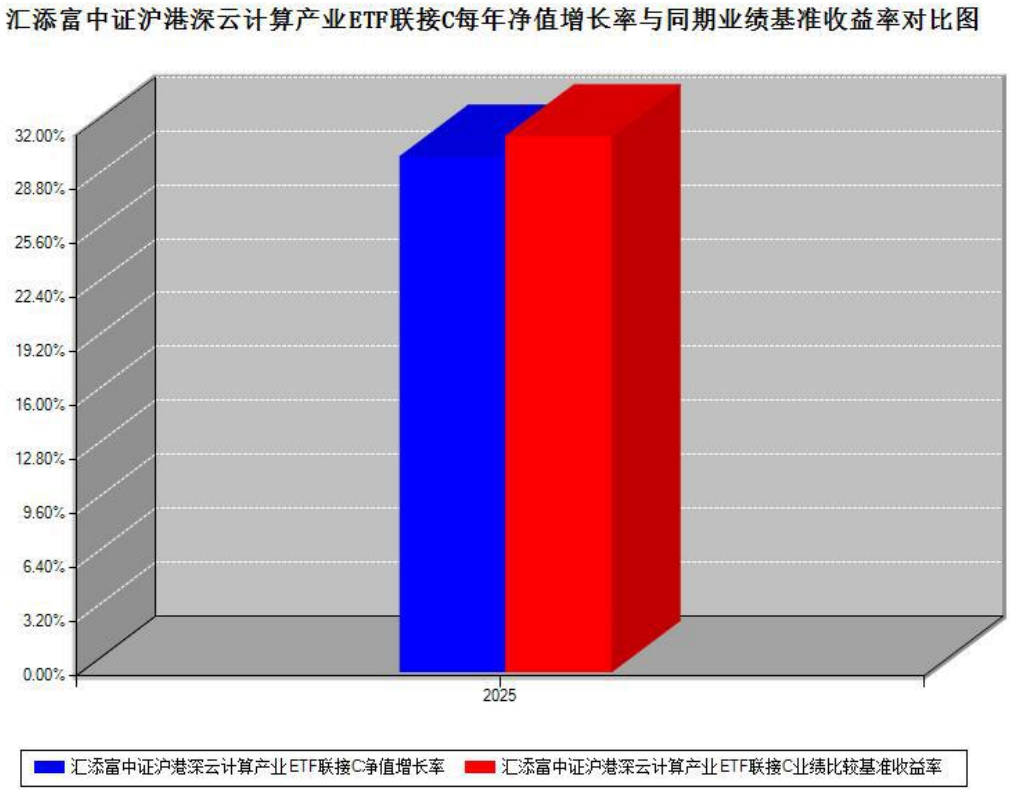
注：本《基金合同》生效之日为 2025 年 08 月 07 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

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沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金于 2025 年 08 月 07 日转型而来。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本《基金合同》生效之日为 2025 年 08 月 07 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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

汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 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 2025-06-01 至 2025-08-06	24.73%	1.45%	24.98%	1.45%	-0.25%	0.00%
自 2025-03-01 至 2025-08-06	12.37%	2.07%	11.89%	2.07%	0.48%	0.00%
自 2024-09-01 至 2025-08-06	87.31%	2.47%	90.21%	2.51%	-2.90%	-0.04%
自 2022-09-01 至 2025-08-06	84.95%	2.09%	89.01%	2.12%	-4.06%	-0.03%
自 2021-12-28 至 2025-08-06	32.11%	2.06%	32.72%	2.09%	-0.61%	-0.03%
汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 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 2025-06-01 至 2025-08-06	24.66%	1.45%	24.98%	1.45%	-0.32%	0.00%
自 2025-03-01 至 2025-08-06	12.24%	2.07%	11.89%	2.07%	0.35%	0.00%
自 2024-09-01 至 2025-08-06	86.44%	2.47%	90.21%	2.51%	-3.77%	-0.04%
自 2022-09-01 至 2025-08-06	83.20%	2.09%	89.01%	2.12%	-5.81%	-0.03%
自 2021-12-28 至 2025-08-06	30.66%	2.06%	32.72%	2.09%	-2.06%	-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

汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

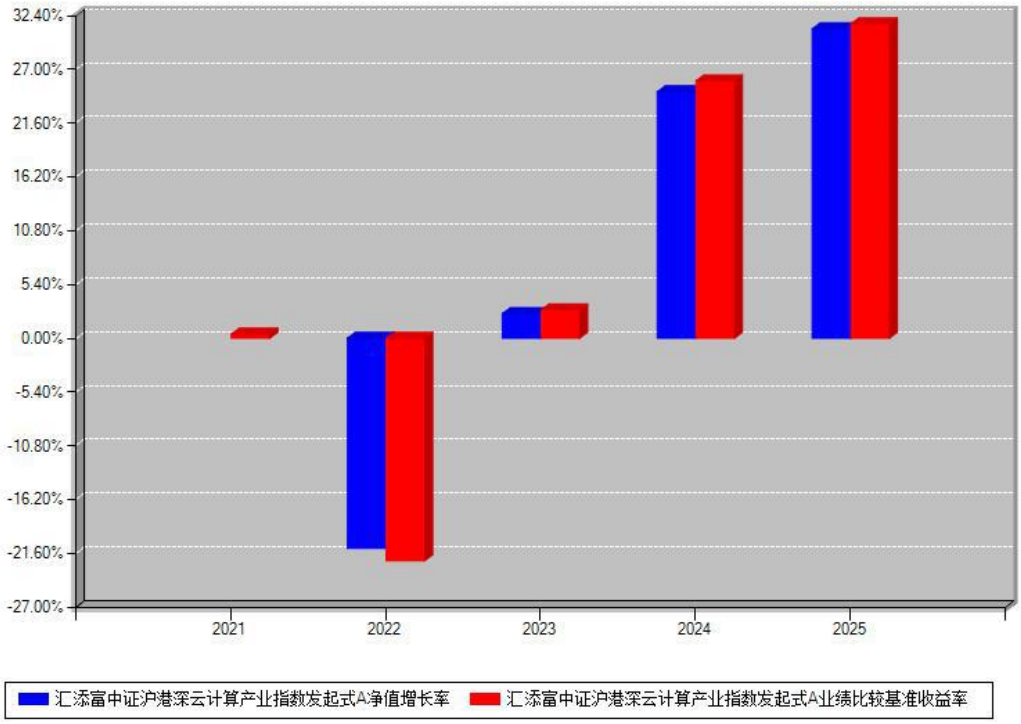
汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2021 年 12 月 28 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。

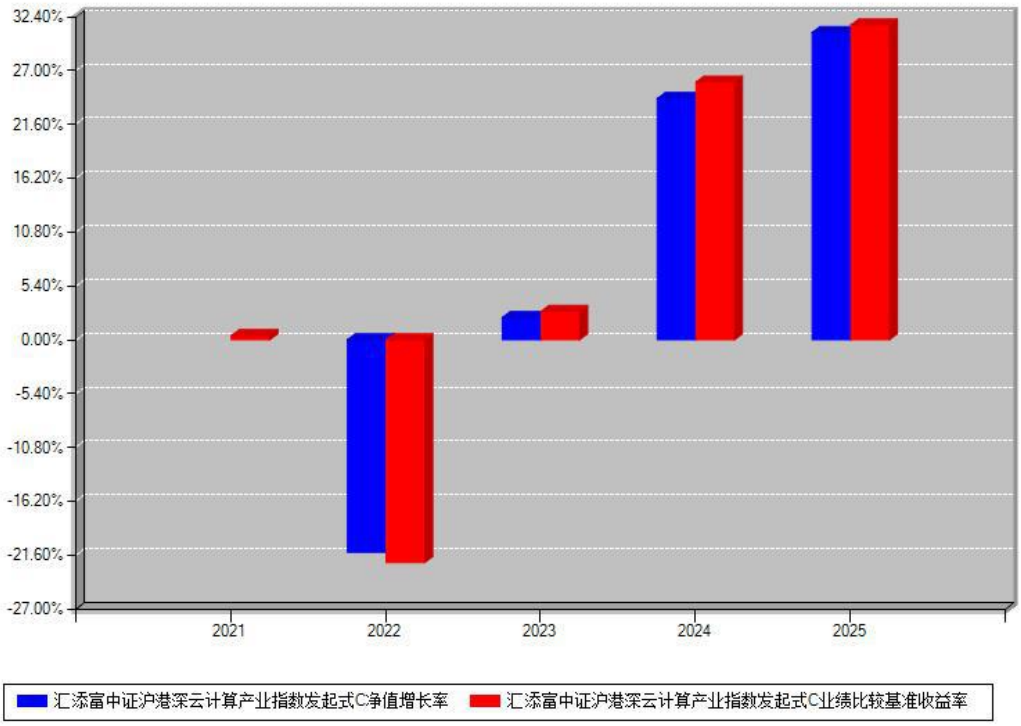
本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式C每年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 2021 年 12 月 28 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

注：本《基金合同》生效之日为 2025 年 08 月 07 日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

§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、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、汇添富投资管理有限公司、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、汇添富基金销售（上海）有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问、公募证券投资基金销售等业务资格。

汇添富现已形成公募业务、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 年，汇添富基金新成立 54 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 12 月 31 日，汇添富基金共管理 395 只公募基金，涵盖股票型基金、指数型基金、QDII 基金、混合型基

金、债券型基金、REITs 基金及货币市场基金等各类产品。

2025 年，汇添富基金持续坚持以客户为中心，以提升投资者长期回报为核心导向，持续完善投顾式服务体系，强化全流程投资陪伴与资产配置能力。公司互联网金融业务围绕数字化转型，依托大数据与 AI 等技术，持续优化平台功能与服务流程，提升客户触达效率与服务精准度。同时，汇添富基金持续深耕互联网平台合作，丰富投教内容与工具供给，通过线上线下融合、内容创新与场景化运营，打造更开放、协同的服务生态，更好满足客户多元化、个性化的投资需求，持续提升客户体验与满意度。

2025 年，汇添富基金坚持金融服务实体经济本源，秉持“一切从长期出发”和“客户第一”的经营理念，以高质量发展为核心，持续提升投资者的获得感。在客户服务方面，公司继续坚定推进与核心机构客户的合作战略。公司深化组织变革，通过团队专业化分工，持续提升客户服务及产品运营能力。公司坚定推进与核心机构客户的合作战略，与银行及银行理财公司加快合作，保险规模维持市场领先地位，同时也致力于服务其他机构投资者的专业投资需求。在产品策略上，公司优化产品布局并夯实底层资产布局，构建多元化、多层次的产品矩阵，满足匹配各类机构投资者的差异化配置需求。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合规模持续增加。在数字化建设方面，强化科技赋能，加速数字化转型，深化人工智能（AI）技术在业务全流程的应用，在运营效能与服务质量上取得突破，持续为客户及团队赋能。

2025 年，汇添富渠道业务坚持“一切从长期出发、客户第一”原则，围绕提升“客户获得感”开展各项业务合作和产品布局。顺应行业净值化转型与居民稳健理财需求，以固收+产品为核心，深化银行渠道融合与科技赋能，实现高质量增长。将基金产品精准匹配银行客户多元资产配置需求，助力客户优化风险收益结构。银行渠道深化国有行、股份行战略合作，围绕客户全生命周期理财需求，打造专属资产配置方案。全年线下投教活动 7786 场，覆盖超 50 万人次；线上升级 AI 工具与数字化内容矩阵，全流程赋能银行渠道，获合作伙伴高度认可。

2025 年，汇添富基金持续深化券商专业化服务。全年紧扣机构客户核心需求，打造“添富投资月度策略会”、“云调研固收+基金专题”等系列调研活动；同时面向渠道客户，在全国范围内开展多场投顾赋能培训，助力券商夯实资产配置能力、优化客户服务体系。为拓宽投资者交流渠道，部门全年落地超 300 场线下活动，涵盖“指能添富”、“渠道赋能千场

行”及“走进汇添富”等特色活动。秉持“客户第一”的理念，汇添富基金通过为券商提供全流程专业支持，推动优质服务触达更广泛的投资者群体。

2025 年，汇添富基金持续提升客户服务能力，进一步完善服务体系建设，为公司各项业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2025 年，汇添富香港子公司持续深化与母公司的两地一体化运营及垂直化管理模式，核心业务实现跨越式增长，客户覆盖范围进一步拓宽，客群基础进一步夯实。在产品线维度，公司立足权益投资的核心专长，新增多个主动管理权益专户，同时固定收益与权益类资产规模同步攀升，核心产品竞争力持续凸显。至此，公司境外产品线已形成境外权益、固定收益、货币市场的多元布局，为投资者全球资产分散配置提供了坚实支撑。下一步香港子公司将继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通，进一步完善个性化客户服务体系，积极引导长期资金入市。

2025 年以来，汇添富基金积极开展公益慈善工作，充分发挥公募基金优势，践行社会责任，为助力实现“共同富裕”与中国式现代化贡献力量。公司连续十七年开展“河流•孩子”公益助学项目，举办第十八期乡村优秀青年教师培训和第八届乡村教育管理研习班，助力乡村教育高质量发展；参与中国慈善联合会《慈善组织投资管理指南》团体标准起草，启动“基业上善”慈善资产管理研修营第二期项目，发布《基金会慈善资产投资管理委员会指南（试行）》，用专业力量推动公益慈善事业可持续发展；发起第三期“致敬城市建设者”公益项目、汇爱社区支持计划一期，助力上海的社区发展，为人民城市增添温度；通过捐赠驰援香港火灾救援工作，与香港同胞共渡难关；参加云南、青海、内蒙古等地产业和教育帮扶等项目，深化东西部协作，助力乡村振兴。

2026 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
乐无穹	本基金的基金经理	2025 年 08 月 07 日	-	11	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从

					业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2024 年 4 月 19 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 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至 2025 年 5 月 16 日任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 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 9 月 29 日至 2024 年 9 月 29 日任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）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。2021 年 12 月 28 日至 2025 年 8 月 6 日任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2023 年 11 月 28 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联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能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。2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 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。2022 年 7 月 29 日至 2024 年 2 月 7 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8

					月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至 2024 年 7 月 5 日任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至 2024 年 7 月 9 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 23 日至 2025 年 5 月 9 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。2023 年 12 月 28 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月 5 日至今任汇添富 MSCI 美国 50 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年 3 月 1

					日至今任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024 年 4 月 1 日至 2025 年 5 月 9 日任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 10 月 28 日至今任汇添富中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月 18 日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 10 日至今任汇添富国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 6 日至今任汇添富国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 7 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 8 月 27 日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金

					经理。
何丽竹	本基金的基金经理	2025 年 08 月 18 日	-	5	国籍：中国。学历：复旦大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2021 年 7 月起加入汇添富基金管理股份有限公司。2025 年 3 月 18 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 3 月 18 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 3 月 21 日至今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。2025 年 4 月 21 日至今任汇添富中证机器人交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月 30 日至今任汇添富中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 13 日至 2025 年 7 月 28 日任汇添富国证自由现金流指数型证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 16 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 16 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 15 日至今

					任汇添富中证机器人交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 7 月 17 日至今任汇添富国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 29 日至今任汇添富国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 8 月 5 日至今任汇添富中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 8 月 18 日至今任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 8 月 18 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 8 月 18 日至今任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 25 日至今任汇添富上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 29 日至今任汇添富中证金

					融科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
乐无穹	本基金的基金经理	2021 年 12 月 28 日	2025 年 08 月 06 日	11	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2024 年 4 月 19 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 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题

					交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至 2025 年 5 月 16 日任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 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 9 月 29 日至 2024 年 9 月 29 日任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）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。2021 年 12 月 28 日至 2025 年 8 月 6 日任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2023 年 11 月 28 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联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能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。2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 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。2022 年 7 月 29 日至 2024 年 2 月 7 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至 2024 年 7 月 5 日任汇添富中证国新央企股东回报交易型开

					放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至 2024 年 7 月 9 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 23 日至 2025 年 5 月 9 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。2023 年 12 月 28 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月 5 日至今任汇添富 MSCI 美国 50 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年 3 月 1 日至今任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024 年 4 月 1 日至 2025 年 5 月 9 日任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 10 月 28 日至今任汇添富中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月 18

					日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 10 日至今任汇添富国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 6 日至今任汇添富国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 7 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 8 月 27 日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

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（转型后）

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。

4.1.3 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（转型前）

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.3 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 年全年，国内资本市场稳中有升，市场信心持续修复。

从市场表现来看，A 股整体上涨，上证指数全年涨幅达 18.41%。风格方面，市场分化明显，成长风格大幅跑赢价值风格，有色、通信、电子等行业领涨市场，人工智能为代表的科技领域和有色为代表的周期板块表现突出，成为市场焦点。交易活跃度方面，市场全年成交活跃，年末两市成交一度接近每日四万亿元。整体说来，市场今年先有一定下跌后强势回暖，走势稳健。

经济数据方面，中国经济景气水平总体回升。12 月制造业 PMI 指数为 50.1，时隔 8 个月重返扩张区间，这显示制造业产需两端均较上月有一定扩张。1-11 月工业增加值累计同比增长 6.0%，高技术制造业增幅居前。社会消费品零售总额 1-11 月累计同比增长 4.0%，但自 6 月以来增速下滑，整体消费动能仍有待提振。四季度，中美关税摩擦升级，但随后沟通谈判进展顺利。当前全球地缘冲突加剧，关税等摩擦可能成为未来一段时间的常态，但市场对关税冲击的敏感度已逐渐下降。

在信息时代，云计算基于互联网共享数据、算力，成为必不可少的资源。云计算是当前人工智能时代重要的投资主题，是投资 AI 算力的良好标的。中证沪港深云计算指数由 60%软件和 40%硬件构成，其中硬件包括光模块、服务器等当下表现良好的细分环节，是国产算力的代名词。软件方面，中证沪港深云计算产业指数含有港股市场的龙头股票，在 AI 产业链中具有 A 股股票所没有的稀缺性和重要性。指数整体结构合理，有较好的长期增长空间。

转型前，本基金在报告期内按照被动投资的原则，采用完全复制法，实现了对标的指数的良好跟踪；转型后，本基金为 ETF 联接基金，在报告期内主要通过投资目标 ETF 基本实现了对底层指数的良好跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2025 年 08 月 07 日转型为汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证

券投资基金联接基金。转型前，本报告期汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A 类份额净值增长率为 31.05%，同期业绩比较基准收益率为 31.55%。本报告期汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C 类份额净值增长率为 30.80%,同期业绩比较基准收益率为 31.55%。转型后，本报告期汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A 类份额净值增长率为 30.69%，同期业绩比较基准收益率为 31.77%。本报告期汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C 类份额净值增长率为 30.55%，同期业绩比较基准收益率为 31.77%。

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 2026 年，作为“十五五”开局之年，国内政策发力可期，中国经济新动能、新势力有望保持强劲势头。从外部环境来看，2026 年仍有较多不确定性，地缘冲突频繁，国际竞争或将影响各产业领域。2026 年，国内经济聚焦高质量发展，新质生产力驱动产业跃升、激活内需仍是经济增长的关键。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规管理

公司以党的二十届四中全会精神为指导，全面响应公募基金高质量发展行动方案，持续完善合规管理体系建设，在合规管理工作中贯彻落实政策精神及各项法规要求，坚守合规底线、防范合规风险。公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的价值观，通过完善合规管理体系、提升合规专业能力、优化合规资源配置等举措，不断提升合规管理工作的有效性。公司强化合规制度建设，同时深入审慎开展合规审查、合规咨询、合规检查、合规监测等日常工作；高度重视并持续开展员工执业操守和职业道德建设，广泛开展合规培训，强化全员合规意识及合规敏感度；加强监督督促职能，规范人员执业行为，强化一线合规执行效果；高度重视合规管理专业能力建设，保障合规资源配置、优化合规工作机制，不断提升公司合规管理水平。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报告与监督；通过协助监管机构开展各项自查、核查工作，协调第三方独立机构开展审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过督促并跟踪检查风险隐患整改，持续优化公司内部控制管理，切实维护基金份额持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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对应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类基金份额、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认

的收益分配方式是现金分红；同一类别每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70015647_B263 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的财务报表,包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 8 月 7 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的财务报告过程。

注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔺育化　　戴唯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2026 年 03 月 27 日

§6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70015647_B385 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的财务报表,包括 2025 年 8 月 6 日(基金合同失效前日)的资产负债表，2025 年 1 月 1 日至 2025 年 8 月 6 日（基金合同失效前日）止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金 2025 年 8 月 6 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 8 月 6 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续

	经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔺育化　　戴唯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2026 年 03 月 27 日

§7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	99,542,907.90
结算备付金		245,080.76
存出保证金		427,294.89
交易性金融资产	7.4.7.2	1,091,708,791.98
其中：股票投资		-
基金投资		1,091,708,791.98
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
应收清算款		10,718,262.56
应收股利		-
应收申购款		6,342,829.37
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,208,985,167.46
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		51,024,948.60
应付管理人报酬		28,660.72
应付托管费		5,732.14
应付销售服务费		150,057.14

应付投资顾问费		-
应交税费		577,179.89
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.7	165,000.00
负债合计		51,951,578.49
净资产：		
实收基金	7.4.7.8	674,742,619.36
未分配利润	7.4.7.9	482,290,969.61
净资产合计		1,157,033,588.97
负债和净资产总计		1,208,985,167.46

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 674,742,619.36 份。本基金下属汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A 基金份额净值 1.7265 元，基金份额总额 292,425,063.85 份；本基金下属汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C 基金份额净值 1.7058 元，基金份额总额 382,317,555.51 份。

2、本基金合同于 2025 年 08 月 07 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2025 年 12 月 31 日数据，特此说明。

7.2 利润表

会计主体：汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 08 月 07 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		**317,814,881.22**
1.利息收入		197,829.26
其中：存款利息收入	7.4.7.10	197,829.26
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）		315,976,264.99
其中：股票投资收益	7.4.7.11	253,191,925.34
基金投资收益	7.4.7.12	63,000,142.45
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-

股利收益	7.4.7.17	-215,802.80
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）	7.4.7.18	244,030.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,396,756.53
减：二、营业总支出		**1,619,351.30**
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	402,545.21
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	80,509.06
3. 销售服务费		825,077.10
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	7.4.7.20	-
7. 税金及附加		227,104.82
8. 其他费用	7.4.7.21	84,115.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**316,195,529.92**
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**316,195,529.92**
五、其他综合收益的税后净额		**-**
六、综合收益总额		**316,195,529.92**

注：本基金合同于 2025 年 08 月 07 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	858,476,465.03	267,362,804.84	1,125,839,269.87
三、本期增减变	-183,733,845.67	214,928,164.77	31,194,319.10

动额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	316,195,529.92	316,195,529.92
（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）	-183,733,845.67	-101,267,365.15	-285,001,210.82
其中：1.基金申购款	1,622,105,373.85	968,585,144.95	2,590,690,518.80
2.基金赎回款	-1,805,839,219.52	-1,069,852,510.10	-2,875,691,729.62
（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	674,742,619.36	482,290,969.61	1,157,033,588.97

注：本基金合同于 2025 年 08 月 07 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”），是由汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金变更而来。原汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资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〔2021〕2088 号文《关于准予汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式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 12 月 28 日生效。首次设立基金募集规模为 10,680,097.97 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_B86 号验资报告予以验证。

根据《关于汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金转型为汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订法律文件的公告》，为更好地满足投资者理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金基金合同》的相关约定，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，履行适当程序后，汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金转型为汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金。根据转型安排，修订后的《汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自 2025 年 8 月 7 日起生效，《汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报

表的实际编制期间系 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金

在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履

行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

⑴存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

⑵不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

⑶如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

⑷如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

⑴存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

⑵交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有

期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

⑶股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

⑷处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

⑸买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

⑹公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

⑺转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

⑻其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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对应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类基金份额、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3.城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4.企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号文《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.境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2014〕81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款	99,542,907.90
等于：本金	99,533,674.73
加：应计利息	9,233.17
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	99,542,907.90

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
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		963,555,055.50	-	1,091,708,791.98	128,153,736.48
其他		-	-	-	-
合计		963,555,055.50	-	1,091,708,791.98	128,153,736.48

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

7.4.7.5.2 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。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	45,000.00
应付信息披露费	120,000.00
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	165,000.00

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A		
项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	284,861,985.47	284,861,985.47
本期申购	394,239,712.72	394,239,712.72
本期赎回（以“-”号填列）	-386,676,634.34	-386,676,634.34
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	292,425,063.85	292,425,063.85
汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C		
项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	573,614,479.56	573,614,479.56
本期申购	1,227,865,661.13	1,227,865,661.13
本期赎回（以“-”号填列）	-1,419,162,585.18	-1,419,162,585.18
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	382,317,555.51	382,317,555.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-27,361,712.94	118,841,631.36	91,479,918.42
本期利润	119,047,917.32	6,325,019.47	125,372,936.79
本期基金份额交易产生的变动数	-11,620,203.44	7,211,906.14	-4,408,297.30
其中：基金申购款	53,842,568.09	184,808,309.14	238,650,877.23
基金赎回款	-65,462,771.53	-177,596,403.00	-243,059,174.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,066,000.94	132,378,556.97	212,444,557.91
汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生	-59,509,378.37	235,392,264.79	175,882,886.42

效日			
本期利润	196,903,582.16	-6,080,989.03	190,822,593.13
本期基金份额交易产生的变动数	-37,860,957.73	-58,998,110.12	-96,859,067.85
其中：基金申购款	160,875,487.37	569,058,780.35	729,934,267.72
基金赎回款	-198,736,445.10	-628,056,890.47	-826,793,335.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,533,246.06	170,313,165.64	269,846,411.70

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	184,372.01
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	7,398.97
其他	6,058.28
合计	197,829.26

注:“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	241,375,650.40
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	11,816,274.94
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	253,191,925.34

7.4.7.11.2 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 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12

	月 31 日
卖出股票成交总额	1,148,191,088.08
减：卖出股票成本总额	905,791,087.85
减：交易费用	1,024,349.83
买卖股票差价收入	241,375,650.40

7.4.7.11.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
申购基金份额总额	75,751,800.00
减：现金支付申购款总额	30,887,129.65
减：申购股票成本总额	33,048,395.41
减：交易费用	-
申购差价收入	11,816,274.94

7.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	642,385,528.97
减：卖出/赎回基金成本总额	577,408,318.43
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	1,892,540.12
减：交易费用	84,527.97
基金投资收益	63,000,142.45

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.13.3 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无申购差价收入。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 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。

7.4.7.16.2 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。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	-215,802.80
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	-215,802.80

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	244,030.44
——股票投资	-127,909,706.04
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	128,153,736.48
——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	244,030.44

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,396,756.53
替代损益	-
其他	-
合计	1,396,756.53

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	18,122.78
信息披露费	48,328.14
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	16,555.88
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	1,108.31
合计	84,115.11

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
招商银行股份有限公司（"招商银行"）	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
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富基金销售（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期不存在向关联方支付佣金的情况。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	402,545.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,083,134.23
应支付基金管理人的净管理费	-680,589.02

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H = E × 0.50% ÷ 当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

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，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	80,509.06

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

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，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.3 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 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C	合计
东方证券股份有限公司	-	79.78	79.78
汇添富基金管理股份有限公司	-	44,829.30	44,829.30
招商银行股份有限公司	-	31,322.39	31,322.39
合计	-	76,231.47	76,231.47

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.25%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25%年费率计提。

计算方法如下：

H = E × 0.25% ÷ 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

基金销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注:本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A	
项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2025 年 08 月 07 日）持有的基金份额	10,002,790.18
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-

报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,002,790.18
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	3.42
汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C	
项目	本期 2025 年 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2025 年 08 月 07 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.5.2 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: 本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

7.4.10.6 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 08 月 07 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	99,542,907.90	184,372.01

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 810,835,407.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 81.10%。

7.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注: 截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	99,542,907.90	-	-	-	-	-	99,542,907.90
结算备付金	245,080.76	-	-	-	-	-	245,080.76
存出保证金	427,294.89	-	-	-	-	-	427,294.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,091,708,791.98	1,091,708,791.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	10,718,262.56	10,718,262.56
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	6,342,829.37	6,342,829.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	100,215,283.55	-	-	-	-	1,108,769,883.91	1,208,985,167.46
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	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	51,024,948.60	51,024,948.60
应付管理人报	-	-	-	-	-	28,660.72	28,660.72

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	5,732.14	5,732.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	150,057.14	150,057.14
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	577,179.89	577,179.89
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	51,951,578.49	51,951,578.49
利率敏感度缺口	100,215,283.55	-	-	-	-	1,056,818,305.42	1,157,033,588.97

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	1,091,708,791.98	94.35
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	1,091,708,791.98	94.35

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日
	中证沪港深云计算产业指数上涨 5%	54,716,075.79
	中证沪港深云计算产业指数下跌 5%	-54,716,075.79

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	1,091,708,791.98
第二层次	-
第三层次	-
合计	1,091,708,791.98

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.4 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。

7.4.14.5 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。

7.4.15 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 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 08 月 06 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 08 月 06 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	100,198,180.35	19,385,770.57
结算备付金		1,548,721.95	189,799.71
存出保证金		206,074.87	26,959.92
交易性金融资产	7.4.7.2	1,048,258,184.30	246,107,995.62
其中：股票投资		1,048,258,184.30	245,704,890.96
基金投资		-	-
债券投资		-	403,104.66
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	1,120,150.16
应收股利		-	-
应收申购款		20,655,318.71	1,165,968.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,170,866,480.18	267,996,644.83
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 08 月 06 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		57.59	218.09
应付赎回款		44,749,152.35	6,396,169.79
应付管理人报酬		91,036.50	116,995.86
应付托管费		18,207.29	23,399.16
应付销售服务费		30,364.84	26,884.51
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	7.4.7.7	138,391.74	190,911.46
负债合计		45,027,210.31	6,754,578.87
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	858,476,465.03	260,240,795.15
未分配利润	7.4.7.9	267,362,804.84	1,001,270.81
净资产合计		1,125,839,269.87	261,242,065.96
负债和净资产总计		1,170,866,480.18	267,996,644.83

注：报告截止日 2025 年 08 月 06 日，基金份额总额 858,476,465.03 份。本基金下属汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A 基金份额净值 1.3211 元，基金份额总额 284,861,985.47 份；本基金下属汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C 基金份额净值 1.3066 元，基金份额总额 573,614,479.56 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		**101,877,220.84**	**40,656,170.26**
1.利息收入		175,228.38	64,312.04
其中：存款利息收入	7.4.7.10	175,228.38	64,312.04
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）		-9,649,136.65	368,520.78
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-14,823,957.29	-609,104.87
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,578.02	59.62
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	5,172,242.62	977,566.03
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)	7.4.7.18	110,432,130.80	39,839,953.79
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.19	918,998.31	383,383.65
减：二、营业总支出		**4,154,063.97**	**1,475,736.85**
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,631,992.79	916,813.07
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	526,398.60	183,362.56
3. 销售服务费		867,629.37	208,836.22
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	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.21	128,043.21	166,725.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**97,723,156.87**	**39,180,433.41**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**97,723,156.87**	**39,180,433.41**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**97,723,156.87**	**39,180,433.41**

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	260,240,795.15	1,001,270.81	261,242,065.96

资产			
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	260,240,795.15	1,001,270.81	261,242,065.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	598,235,669.88	266,361,534.03	864,597,203.91
（一）、综合收益总额	-	97,723,156.87	97,723,156.87
（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）	598,235,669.88	168,638,377.16	766,874,047.04
其中：1.基金申购款	2,324,521,638.94	433,522,955.93	2,758,044,594.87
2.基金赎回款	-1,726,285,969.06	-264,884,578.77	-1,991,170,547.83
（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	858,476,465.03	267,362,804.84	1,125,839,269.87

项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	178,264,677.59	-34,539,646.65	143,725,030.94
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	178,264,677.59	-34,539,646.65	143,725,030.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	81,976,117.56	35,540,917.46	117,517,035.02
（一）、综合收益总额	-	39,180,433.41	39,180,433.41
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	81,976,117.56	-3,639,515.95	78,336,601.61

“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	633,409,003.20	-81,044,463.80	552,364,539.40
2.基金赎回款	-551,432,885.64	77,404,947.85	-474,027,937.79
（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	260,240,795.15	1,001,270.81	261,242,065.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金（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〔2021〕2088 号文《关于准予汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式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 12 月 28 日生效。首次设立基金募集规模为 10,680,097.97 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_B86 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 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 08 月 06 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日（合同失效前日）止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债),按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,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;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原

则确定公允价值并进行估值：

⑴存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

⑵不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

⑶如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

⑷如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净

值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

⑴存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

⑵交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

⑶股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

⑷处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

⑸买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

⑹公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

⑺转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

⑻其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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对应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类基金份额、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

3、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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.境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2014〕81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 08 月 06 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	100,198,180.35	19,385,770.57
等于：本金	100,155,739.17	19,383,894.40
加：应计利息	42,441.18	1,876.17
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	100,198,180.35	19,385,770.57

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 08 月 06 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		920,348,478.26	-	1,048,258,184.30	127,909,706.04
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		920,348,478.26	-	1,048,258,184.30	127,909,706.04
项目		上年度末			

		2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		228,227,247.72	-	245,704,890.96	17,477,643.24
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	400,788.00	2,384.66	403,104.66	-68.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	400,788.00	2,384.66	403,104.66	-68.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		228,628,035.72	2,384.66	246,107,995.62	17,477,575.24

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

7.4.7.5.2 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。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2025 年 08 月 06 日	2024 年 12 月 31 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	39,842.66	35,911.46
其中：交易所市场	39,842.66	35,911.46
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	26,877.22	35,000.00
应付信息披露费	71,671.86	120,000.00
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	138,391.74	190,911.46

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	140,314,038.59	140,314,038.59
本期申购	488,834,181.17	488,834,181.17
本期赎回（以“-”号填列）	-344,286,234.29	-344,286,234.29
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	284,861,985.47	284,861,985.47
汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C		

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	119,926,756.56	119,926,756.56
本期申购	1,835,687,457.77	1,835,687,457.77
本期赎回（以“-”号填列）	-1,381,999,734.77	-1,381,999,734.77
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	573,614,479.56	573,614,479.56

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,319,721.14	13,450,759.25	1,131,038.11
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-12,319,721.14	13,450,759.25	1,131,038.11
本期利润	-3,589,594.95	54,650,250.43	51,060,655.48
本期基金份额交易产生的变动数	-11,452,396.85	50,740,621.68	39,288,224.83
其中：基金申购款	-43,992,098.44	137,755,177.36	93,763,078.92
基金赎回款	32,539,701.59	-87,014,555.68	-54,474,854.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,361,712.94	118,841,631.36	91,479,918.42
汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,263,883.98	11,134,116.68	-129,767.30
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-11,263,883.98	11,134,116.68	-129,767.30
本期利润	-9,119,378.98	55,781,880.37	46,662,501.39
本期基金份	-39,126,115.41	168,476,267.74	129,350,152.33

额交易产生的变动数			
其中：基金申购款	-179,119,881.61	518,879,758.62	339,759,877.01
基金赎回款	139,993,766.20	-350,403,490.88	-210,409,724.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-59,509,378.37	235,392,264.79	175,882,886.42

7.4.7.10 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 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	160,658.01	53,679.42
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	9,043.42	6,938.23
其他	5,526.95	3,694.39
合计	175,228.38	64,312.04

注:“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 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 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	452,843,164.63	133,373,444.02
减：卖出股票成本总额	466,585,394.38	133,683,097.88
减：交易费用	1,081,727.54	299,451.01
买卖股票差价收入	-14,823,957.29	-609,104.87

7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	3,186.02	59.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-608.00	-
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	2,578.02	59.62

7.4.7.13.2 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 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,453,140.00	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,400,608.00	-
减：应计利息总额	53,140.00	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-608.00	-

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,172,242.62	977,566.03
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	5,172,242.62	977,566.03

7.4.7.18 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 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	110,432,130.80	39,839,953.79
——股票投资	110,432,062.80	39,840,021.79
——债券投资	68.00	-68.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——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	110,432,130.80	39,839,953.79

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

基金赎回费收入	918,998.31	383,383.65
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	918,998.31	383,383.65

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	26,877.22	35,000.00
信息披露费	71,671.86	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	18,240.81	9,241.03
指数使用费	-	-
登记结算服务费	-	-
IOPV 计算与发布费	-	-
持有人大会-公证费	-	-
持有人大会-律师费	-	-
开户费	-	-
上市费	-	-
或有管理费	-	-
其他	11,253.32	2,483.97
合计	128,043.21	166,725.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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,基金发起人
招商银行股份有限公司（"招商银行"）	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
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.1.6 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,631,992.79	916,813.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	950,562.91	260,644.42
应支付基金管理人的净管理费	1,681,429.88	656,168.65

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

H = E × 0.50% ÷ 当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	526,398.60	183,362.56

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

H = E × 0.10% ÷ 当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.2.3 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 08 月 06 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	81,562.91	81,562.91
东方证券股份有限公司	-	18.53	18.53
招商银行股份有限公司	-	22,549.83	22,549.83
合计	-	104,131.27	104,131.27
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	31,621.09	31,621.09
东方证券股份有限公司	-	2.24	2.24
招商银行股份有限公司	-	5,090.83	5,090.83
合计	-	36,714.16	36,714.16

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.25%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25%年费率计提。

计算方法如下：

H = E × 0.25% ÷ 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，

顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 12 月 28 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,002,790.18	10,002,790.18
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份	10,002,790.18	10,002,790.18

额		
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	3.51	7.13
汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 08 月 06 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 12 月 28 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 08 月 06 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	100,198,180.35	160,658.01	19,385,770.57	53,679.42

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

7.4.12 期末（2025 年 08 月 06 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 08 月 06 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注: 截至本报告期末 2025 年 08 月 06 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。

7.4.12.4 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 08 月 06 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 08 月 06 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	100,198,180.35	-	-	-	-	-	100,198,180.35
结算备付金	1,548,721.95	-	-	-	-	-	1,548,721.95
存出保证金	206,074.87	-	-	-	-	-	206,074.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,048,258,184.30	1,048,258,184.30

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	-	-	-	-	-	20,655,318.71	20,655,318.71
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	101,952,977.17	-	-	-	-	1,068,913,503.01	1,170,866,480.18
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	-	-	-	-	-	57.59	57.59
应付	-	-	-	-	-	44,749,152.35	44,749,152.35

赎回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	91,036.50	91,036.50
应付托管费	-	-	-	-	-	18,207.29	18,207.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30,364.84	30,364.84
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	-	-	-	-	-	138,391.74	138,391.74
负债总计	-	-	-	-	-	45,027,210.31	45,027,210.31
利率敏感度缺口	101,952,977.17	-	-	-	-	1,023,886,292.70	1,125,839,269.87
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	19,385,770.57	-	-	-	-	-	19,385,770.57
结算备付	189,799.71	-	-	-	-	-	189,799.71

金							
存出保证金	26,959.92	-	-	-	-	-	26,959.92
交易性金融资产	-	-	403,104.66	-	-	245,704,890.96	246,107,995.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,120,150.16	1,120,150.16
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,165,968.85	1,165,968.85
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,602,530.20	-	403,104.66	-	-	247,991,009.97	267,996,644.83
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	-	-	-	-	-	218.09	218.09
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,396,169.79	6,396,169.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	116,995.86	116,995.86
应付托管费	-	-	-	-	-	23,399.16	23,399.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-	26,884.51	26,884.51
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	-	-	-	-	-	190,911.46	190,911.46
负债总计	-	-	-	-	-	6,754,578.87	6,754,578.87
利率敏感度缺口	19,602,530.20	-	403,104.66	-	-	241,236,431.10	261,242,065.96

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。

7.4.13.4.1.2 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 08 月 06 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	-	562.90
	基准利率增加 25 个基点	-	-561.32

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 08 月 06 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-

交易性金融资产	-	262,061,162.04	-	262,061,162.04
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	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	262,061,162.04	-	262,061,162.04
以外币计价的负债				
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	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	262,061,162.04	-	262,061,162.04
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元折合人	港币折合人民币	其他币种折	合计

	民币		合人民币	
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	63,043,071.50	-	63,043,071.50
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	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	63,043,071.50	-	63,043,071.50
以外币计价的负债				
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	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
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	-	-	-	-

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	63,043,071.50	-	63,043,071.50

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1.除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
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 08 月 06 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	港币相对人民币贬值 5%	-13,103,058.10	-3,152,153.58
	港币相对人民币升值 5%	13,103,058.10	3,152,153.58

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 08 月 06 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	1,048,258,184.30	93.11	245,704,890.96	94.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	403,104.66	0.15
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	1,048,258,184.30	93.11	246,107,995.62	94.21

7.4.13.4.3.2 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 08 月 06 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证沪港深云计算产业指数上涨 5%	52,977,868.95	12,208,584.06
	中证沪港深云计算产业指数下跌 5%	-52,977,868.95	-12,208,584.06

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 08 月 06 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	1,048,258,184.30	245,704,890.96
第二层次	-	403,104.66
第三层次	-	-

合计	1,048,258,184.30	246,107,995.62

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.5 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告（转型后）

8.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,091,708,791.98	90.30

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	99,787,988.66	8.25
8	其他各项资产	17,488,386.82	1.45
9	合计	1,208,985,167.46	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	5,402,055.00	0.47
2	300308	中际旭创	4,873,390.00	0.42
3	000977	浪潮信息	1,049,229.00	0.09
4	000938	紫光股份	837,947.00	0.07
5	300339	润和软件	639,679.00	0.06
6	002261	拓维信息	515,802.00	0.04
7	300442	润泽科技	508,771.00	0.04
8	300454	深信服	426,881.00	0.04
9	300017	网宿科技	392,196.00	0.03
10	002335	科华数据	354,541.00	0.03
11	002065	东华软件	343,204.00	0.03
12	002410	广联达	312,649.00	0.03
13	300383	光环新网	309,207.00	0.03
14	300170	汉得信息	257,376.00	0.02
15	300738	奥飞数据	241,649.00	0.02
16	300253	卫宁健康	226,849.00	0.02
17	002396	星网锐捷	222,423.00	0.02
18	300229	拓尔思	179,755.00	0.02

19	300624	万兴科技	173,155.00	0.01
20	002368	太极股份	161,252.00	0.01

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	155,452,694.40	13.44
2	300308	中际旭创	152,533,109.52	13.18
3	00700	腾讯控股	100,185,453.72	8.66
4	09988	阿里巴巴－W	92,705,499.24	8.01
5	603019	中科曙光	69,479,155.50	6.00
6	688111	金山办公	42,665,226.68	3.69
7	000977	浪潮信息	36,492,960.00	3.15
8	600570	恒生电子	33,067,995.50	2.86
9	00268	金蝶国际	31,811,269.18	2.75
10	000938	紫光股份	31,170,191.60	2.69
11	300339	润和软件	27,338,385.27	2.36
12	002261	拓维信息	20,561,105.00	1.78
13	300442	润泽科技	20,415,354.10	1.76
14	600588	用友网络	19,372,677.00	1.67
15	03888	金山软件	17,545,562.91	1.52
16	300017	网宿科技	16,732,457.02	1.45
17	300454	深信服	16,501,208.00	1.43
18	002410	广联达	13,462,872.04	1.16
19	002065	东华软件	13,286,639.17	1.15
20	600845	宝信软件	12,978,382.88	1.12

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。

8.4.3 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	18,491,005.00
卖出股票收入（成交）总额	1,148,191,088.08

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策与风险说明

本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便投资者通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争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 4%。如因标的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正常范围的,基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策，投资限制等要求。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理

							人及管理人关联方所管理的基金
1	159273	云计算 ETF 汇添富	交易型开放式	810,835,407.00	1,091,708,791.98	94.35	是

8.13 投资组合报告附注

8.13.1

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。

8.13.2

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。

8.13.3 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	427,294.89
2	应收清算款	10,718,262.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,342,829.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,488,386.82

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

§8 投资组合报告（转型前）

8.1 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	1,048,258,184.30	89.53
	其中：股票	1,048,258,184.30	89.53
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	101,746,902.30	8.69
8	其他各项资产	20,861,393.58	1.78
9	合计	1,170,866,480.18	100.00

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 262,061,162.04 元，占期末净值比例为 23.28%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	373,269,523.32	33.15
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	412,927,498.94	36.68
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	786,197,022.26	69.83

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	86,987,222.13	7.73
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	61,178,863.69	5.43
50 电信服务	113,895,076.22	10.12
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	262,061,162.04	23.28

注:（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.3 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

8.3.1 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	300308	中际旭创	541,100	113,912,372.00	10.12
2	300502	新易盛	603,990	112,583,736.00	10.00
3	00700	腾讯控股	185,600	95,983,611.65	8.53
4	09988	阿里巴巴－W	819,400	86,987,222.13	7.73
5	603019	中科曙光	890,596	61,379,876.32	5.45
6	688111	金山办公	140,959	43,649,363.94	3.88
7	00268	金蝶国际	2,159,000	36,373,263.70	3.23
8	000977	浪潮信息	627,300	34,683,417.00	3.08
9	600570	恒生电子	921,240	32,132,851.20	2.85
10	000938	紫光股份	1,218,700	30,345,630.00	2.70
11	300339	润和软件	484,700	26,459,773.00	2.35
12	002261	拓维信息	611,700	19,929,186.00	1.77
13	600588	用友网络	1,248,100	19,470,360.00	1.73
14	300442	润泽科技	397,800	19,169,982.00	1.70
15	03888	金山软件	569,400	17,911,464.57	1.59
16	300454	深信服	154,100	16,856,999.00	1.50
17	300017	网宿科技	1,488,700	16,852,084.00	1.50
18	002410	广联达	1,005,860	13,971,395.40	1.24
19	600845	宝信软件	525,981	13,244,201.58	1.18
20	002065	东华软件	1,365,500	13,149,765.00	1.17
21	300383	光环新网	875,200	12,751,664.00	1.13
22	300170	汉得信	599,600	11,956,024.00	1.06

		息			
23	300253	卫宁健康	1,077,600	11,929,032.00	1.06
24	03896	金山云	1,506,000	10,315,934.94	0.92
25	688568	中科星图公司	246,241	9,948,136.40	0.88
26	300738	奥飞数据	479,744	9,921,105.92	0.88
27	300229	拓尔思	372,300	9,798,936.00	0.87
28	002335	科华数据	219,500	9,381,430.00	0.83
29	00354	中国软件国际	1,661,000	8,929,882.82	0.79
30	600602	云赛智联	392,100	8,841,855.00	0.79
31	300348	长亮科技	494,100	8,251,470.00	0.73
32	002396	星网锐捷	286,600	8,013,336.00	0.71
33	300624	万兴科技	94,187	8,005,895.00	0.71
34	600410	华胜天成	667,200	7,999,728.00	0.71
35	002123	梦网科技	490,000	7,252,000.00	0.64
36	300212	易华录	306,880	7,190,198.40	0.64
37	300166	东方国信	554,800	7,051,508.00	0.63
38	603881	数据港	262,183	6,937,362.18	0.62
39	002368	太极股份	265,583	6,767,054.84	0.60
40	600131	国网信通	365,800	6,569,768.00	0.58
41	300047	天源迪科	388,300	6,271,045.00	0.56
42	300687	赛意信息	174,900	6,060,285.00	0.54
43	688158	优刻得科技	222,065	5,707,070.50	0.51
44	300168	万达信息	701,900	5,706,447.00	0.51
45	603039	泛微网络	79,400	5,405,552.00	0.48

46	002153	石基信息	497,844	5,112,857.88	0.45
47	872808	曙光数创	48,700	2,969,726.00	0.26
48	01686	新意网集团	430,000	2,941,541.25	0.26
49	02556	迈富时	46,800	2,618,240.98	0.23
50	688225	亚信安全	121,915	2,606,542.70	0.23

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	09988	阿里巴巴－W	133,828,247.82	51.23
2	00700	腾讯控股	109,085,620.08	41.76
3	603019	中科曙光	72,969,616.08	27.93
4	300308	中际旭创	68,753,000.00	26.32
5	300502	新易盛	57,234,111.66	21.91
6	688111	金山办公	56,172,728.73	21.50
7	000938	紫光股份	45,516,688.46	17.42
8	000977	浪潮信息	43,203,604.00	16.54
9	600570	恒生电子	33,316,561.00	12.75
10	00268	金蝶国际	32,529,393.93	12.45
11	300339	润和软件	31,559,640.60	12.08
12	300442	润泽科技	28,630,097.00	10.96
13	03888	金山软件	25,487,216.15	9.76
14	002261	拓维信息	23,880,884.00	9.14
15	600588	用友网络	23,252,577.15	8.90
16	300017	网宿科技	22,112,744.00	8.46
17	600845	宝信软件	19,543,856.12	7.48
18	300383	光环新网	18,368,937.00	7.03
19	300454	深信服	18,165,217.00	6.95

20	002065	东华软件	18,087,525.00	6.92
21	002410	广联达	16,033,104.32	6.14
22	300253	卫宁健康	14,189,563.99	5.43
23	300170	汉得信息	13,833,274.00	5.30
24	03896	金山云	11,472,523.24	4.39
25	300738	奥飞数据	11,281,847.94	4.32
26	002335	科华数据	11,251,431.00	4.31
27	688568	中科星图公司	11,026,092.49	4.22
28	600602	云赛智联	10,621,101.00	4.07
29	300229	拓尔思	10,603,043.00	4.06
30	00354	中国软件国际	10,568,091.10	4.05
31	002123	梦网科技	9,764,419.00	3.74
32	300212	易华录	9,484,183.00	3.63
33	603881	数据港	8,874,152.04	3.40
34	300348	长亮科技	8,804,674.20	3.37
35	002368	太极股份	8,397,094.76	3.21
36	600131	国网信通	8,147,832.70	3.12
37	688158	优刻得科技	8,061,948.93	3.09
38	300624	万兴科技	7,866,331.00	3.01
39	300166	东方国信	7,639,592.00	2.92
40	600410	华胜天成	7,456,287.00	2.85
41	002396	星网锐捷	7,096,862.00	2.72
42	300168	万达信息	7,080,779.00	2.71
43	300047	天源迪科	6,539,658.00	2.50
44	603039	泛微网络	6,168,987.00	2.36
45	002467	二六三	5,708,896.00	2.19
46	300378	鼎捷数智	5,438,733.00	2.08

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。

8.4.2 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	09988	阿里巴巴－W	65,035,708.74	24.89
2	00700	腾讯控股	52,601,861.35	20.14
3	300308	中际旭创	29,643,054.00	11.35
4	300502	新易盛	28,141,737.20	10.77
5	603019	中科曙光	25,198,740.00	9.65

6	000938	紫光股份	18,224,462.00	6.98
7	688111	金山办公	17,718,197.70	6.78
8	000977	浪潮信息	13,929,593.00	5.33
9	00268	金蝶国际	11,912,602.05	4.56
10	600570	恒生电子	11,851,081.30	4.54
11	300339	润和软件	10,640,612.00	4.07
12	300442	润泽科技	10,384,318.00	3.97
13	03888	金山软件	8,484,379.08	3.25
14	002261	拓维信息	7,620,714.00	2.92
15	600588	用友网络	7,557,640.00	2.89
16	300017	网宿科技	6,947,920.00	2.66
17	002467	二六三	6,586,515.00	2.52
18	300454	深信服	6,263,930.00	2.40
19	300378	鼎捷数智	6,049,150.00	2.32
20	600845	宝信软件	5,928,382.00	2.27
21	300383	光环新网	5,696,417.00	2.18
22	002065	东华软件	5,569,185.00	2.13
23	002410	广联达	5,261,094.00	2.01

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。

8.4.3 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	1,158,706,624.92
卖出股票收入（成交）总额	452,843,164.63

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	206,074.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,655,318.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,861,393.58

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 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（%）
汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A	27,727	10,546.58	11,014,067.53	3.77	281,410,996.32	96.23
汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C	71,211	5,368.80	2,150,388.68	0.56	380,167,166.83	99.44
合计	98,938	6,819.85	13,164,456.21	1.95	661,578,163.15	98.05

9.2 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	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A	1,710,868.33	0.59
	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C	216,223.22	0.06
	合计	1,927,091.55	0.29

9.3 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	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A	50~100
	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A	0
	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

§9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 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	23,305	12,223.21	10,877,948.88	3.82	273,984,036.59	96.18

富中证沪港深云计算产业指数发起式 A						
汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C	61,067	9,393.20	85,329,133.93	14.88	488,285,345.63	85.12
合计	84,372	10,174.90	96,207,082.81	11.21	762,269,382.22	88.79

9.2 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	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	1,460,959.80	0.51
	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C	158,373.89	0.03
	合计	1,619,333.69	0.19

9.3 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	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	10~50
	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C	0
	合计	10~50

本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	0
	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,790.18	1.17	10,002,790.18	1.17	3 年
基金管理人高级管理人员	260,014.01	0.03	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	1,359,319.68	0.16	-	-	
合计	11,622,123.87	1.35	10,002,790.18	1.17	

§10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 A	汇添富中证沪港深云计算产业 ETF 联接 C
基金合同生效日（2025 年 08 月 07 日）基金份额总额	284,861,985.47	573,614,479.56
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	394,239,712.72	1,227,865,661.13
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	386,676,634.34	1,419,162,585.18

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	292,425,063.85	382,317,555.51

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 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 A	汇添富中证沪港深云计算产业指数发起式 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 28 日）基金份额总额	10,499,455.40	180,642.57
本报告期期初基金份额总额	140,314,038.59	119,926,756.56
本报告期基金总申购份额	488,834,181.17	1,835,687,457.77
减：本报告期基金总赎回份额	344,286,234.29	1,381,999,734.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	284,861,985.47	573,614,479.56

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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本基金管理人于 2025 年 7 月 15 日发布公告，自 2025 年 7 月 14 日起，鲁伟铭先生担任公司董事长，李文先生不再担任公司董事长。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

2025 年 8 月 7 日原“汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金”转型为“汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资策略请详见 2025 年 8 月 6 日刊登在本公司网站的《汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2021 年 12 月 28 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 45,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作、其他问题(基金销售等)
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题及整改要求，通过完善制度、优化管理等完成相关问题整改并已通过监管检查验收。公司将从严加强内控及各业务管理，持续提升管理质效。
其他	无

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2；高级管理人员 3
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日；2025 年 11 月 11 日；2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海证监局；中国证监会上海证监局；中国证监会上海证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施；行政监管措施；行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函；出具警示函；出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作；其他问题(基金销售)；合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金管理公司管理办法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》;《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》;《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题及整改要求，通过完善制度、优化管理等完成相关问题整改并已通过监管检查验收。公司将从严加强内控及各业务管理，持续提升管理质效。
其他	无

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 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	佣金	占当期佣	

			票成交总额的比例（%）		金总量的比例（%）	
国投证券	3	417,023,288.38	35.74	79,892.52	35.98	
申万宏源证券	2	338,267,532.17	28.99	64,821.07	29.19	
中信证券	4	242,494,128.59	20.78	45,642.38	20.55	
中信建投证券	2	96,929,286.34	8.31	18,933.26	8.53	
国信证券	2	49,470,496.11	4.24	8,700.39	3.92	
广发证券	4	18,647,520.84	1.60	3,665.94	1.65	
招商证券	3	3,849,840.65	0.33	404.28	0.18	
德邦证券	2	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东方财富	2	-	-	-	-	
东方证券	3	-	-	-	-	
高盛中国	2	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国泰海通	8	-	-	-	-	
华安证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	3	-	-	-	-	
开源证券	2	-	-	-	-	
民生证券	2	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
天风证券	2	-	-	-	-	
银河证	2	-	-	-	-	

券						
中金财富	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中原证券	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。

11.7.2 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（%）
国投证券	-	-	-	-	-	-	469,963,604.48	22.30
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	975,937,191.54	46.31
中信证券	-	-	-	-	-	-	486,665,669.11	23.09
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	117,223,490.61	5.56
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	57,483,277.00	2.73
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部（合称“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

（2）交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

（6）交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 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（%）	
中信证券	4	408,305,525.09	25.34	77,844.53	24.79	
广发证券	4	291,149,298.79	18.07	59,286.22	18.88	
国泰海通	8	283,237,817.41	17.58	54,640.51	17.40	
中信建投证券	2	242,787,891.93	15.07	48,473.03	15.43	
招商证券	3	222,908,508.25	13.83	44,080.09	14.04	
国信证券	2	96,787,956.96	6.01	17,025.17	5.42	
申万宏源证券	2	53,898,240.51	3.34	10,429.42	3.32	
国投证券	3	12,474,550.61	0.77	2,280.67	0.73	
德邦证券	2	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东方财富	2	-	-	-	-	
东方证券	3	-	-	-	-	
高盛中	2	-	-	-	-	

国						
国金证券	2	-	-	-	-	
华安证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	3	-	-	-	-	
开源证券	2	-	-	-	-	
民生证券	2	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
天风证券	2	-	-	-	-	
银河证券	2	-	-	-	-	
中金财富	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中原证券	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。

11.7.2 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（%）
中信证券	2,999,820.00	100.00	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部（合称“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

（2）交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

（6）交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2025 年 08 月 07 日
2	汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025 年 08 月 07 日
3	汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,证券时报	2025 年 08 月 18 日
4	汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书（2025 年 8 月 21 日更新）	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025 年 08 月 21 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证	2025 年 08 月 29 日

		报	
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025 年 10 月 28 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2025 年 11 月 14 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2025 年 11 月 14 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于设立汇添富基金销售（上海）有限公司的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025 年 12 月 24 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2025 年 12 月 31 日

11.8 其他重大事件（转型前）

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	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
3	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
4	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
5	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
6	关于汇添富基金管理股份有限公	上证报,中国证监会	2025 年 06 月 26 日

	司终止与大华银行（中国）有限公司合作关系的公告	基金电子披露网站,公司网站	
7	汇添富基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	深交所,上交所,上证报,中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025 年 07 月 15 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025 年 07 月 21 日
9	关于汇添富基金管理股份有限公司住所变更的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025 年 07 月 29 日
10	关于汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金转型为汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订法律文件的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,证券时报	2025 年 08 月 06 日
11	汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025 年 08 月 06 日
12	汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025 年 08 月 06 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金募集的文

件；

2、《汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金托管协议》；

4、《汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

5、《汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

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沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；

8、报告期内汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金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。

13.2 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

13.3 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 03 月 31 日