

# 汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) (原汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)) 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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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 10 月 31 日起，汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 转型为汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)。本报告中，汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 10 月 30 日止，汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的报告期自 2025 年 10 月 31 日起至 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合规守信情况的说明	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	38
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	39
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	39
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	40
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	41
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	41
§ 5 托管人报告	41
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	41
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	41
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	41
§ 6 审计报告 (转型后)	42
6.1 审计报告的基本信息	42
6.2 审计报告的基本内容	42
§ 6 审计报告 (转型前)	44
6.1 审计报告的基本信息	44
6.2 审计报告的基本内容	44

§ 7 年度财务报表 (转型后)	46
7.1 资产负债表	46
7.2 利润表	47
7.3 净资产变动表	48
7.4 报表附注	49
§ 7 年度财务报表 (转型前)	84
7.1 资产负债表	84
7.2 利润表	86
7.3 净资产变动表	87
7.4 报表附注	89
§ 8 投资组合报告 (转型后)	132
8.1 期末基金资产组合情况	132
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	132
8.3 期末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	133
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	134
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	135
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	136
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	136
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	136
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	136
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	136
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	136
8.12 本报告期投资基金情况	136
8.13 投资组合报告附注	137
§ 8 投资组合报告 (转型前)	138
8.1 期末基金资产组合情况	138
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	139
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	140
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	163
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	165
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	165
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	166
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	166
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	166
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	166
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	166
8.12 投资组合报告附注	166
§ 9 基金份额持有人信息 (转型后)	167
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	167
9.2 期末上市基金前十名持有人	168
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	169
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	169
9.5 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.....	169
§ 9 基金份额持有人信息 (转型前) .....	169
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	169
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	170
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	171
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	171
9.5 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.....	171
9.6 发起式基金发起资金持有份额情况.....	171
§ 10 开放式基金份额变动 (转型后) .....	172
§ 10 开放式基金份额变动 (转型前) .....	172
§ 11 重大事件揭示.....	173
11.1 基金份额持有人大会决议.....	173
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.....	173
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	173
11.4 基金投资策略的改变.....	173
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	173
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	173
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后) .....	175
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前) .....	176
11.8 其他重大事件 (转型后) .....	177
11.8 其他重大事件 (转型前) .....	178
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	179
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.....	179
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	180
§ 13 备查文件目录.....	180
13.1 备查文件目录.....	180
13.2 存放地点.....	181
13.3 查阅方式.....	181

## § 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
基金简称	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF)	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 10 月 31 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	236,846,480.66	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500ETF 联接(LOF) A	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额 (份)	158,585,033.73	78,261,446.93

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

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	563750
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 10 月 22 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 10 月 30 日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	招商证券股份有限公司

### 2.1 基金基本情况 (转型前)

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)	
基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF)	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 08 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	256,662,592.91	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额 (份)	173,567,208.64	83,095,384.27

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

## 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	<p>本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。</p> <p>为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；目标 ETF 的投资策略；成份股、备选成份股投资策略；固定收益类资产投资策略；金融衍生工具投资策略；融资及转融通投资策略；存托凭证的投资策略等。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 × 95% + 银行人民币活期存款利率 (税后) × 5%
风险收益特征	本基金为汇添富中证 500ETF 的联接基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、

	较高预期收益的品种。同时本基金通过投资目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

### 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略等。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.2 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	<p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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		招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	韩鑫普
	联系电话	021-28932888	0755-82943666
	电子邮箱	service@99fund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话	400-888-9918		95565
传真	021-28932998		0755-82960794
注册地址	上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼		深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号		深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	200010		518000
法定代表人	鲁伟铭		霍达

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、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 10 月 31 日 (基金合同生效日) - 2025 年 12 月 31 日	
	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) A	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C
本期已实现收益	24,156,883.18	11,440,885.60
本期利润	2,151,284.15	1,375,778.61
加权平均基金份额本期利润	0.0128	0.0166
本期加权平均净值利润率	0.94%	1.24%
本期基金份额净值增	1.09%	1.05%

长率		
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	66,129,197.68	30,564,607.37
期末可供分配基金份额利润	0.4170	0.3905
期末基金资产净值	224,714,231.41	108,826,054.30
期末基金份额净值	1.4170	1.3905
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	1.09%	1.05%

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 10 月 31 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 10 月 30 日		2024 年		2023 年	
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
本期已	23,929,622.48	18,297,745.56	-12,764,215.06	-6,512,262.51	-4,408,776.25	-2,407,330.19

实现收益						
本期利润	65,248,159.63	34,484,243.57	15,641,793.71	5,952,115.10	-13,623,530.76	-5,102,135.53
加权平均基金份额本期利润	0.2921	0.2576	0.0585	0.0442	-0.0541	-0.0427
本期加权平均净值利润率	25.26%	21.66%	5.83%	4.48%	-4.87%	-3.91%
本期基金份额净值增长率	29.30%	29.07%	5.26%	5.07%	-5.20%	-5.42%
3.1.2	2025 年 10 月 30 日	2024 年末		2023 年末		

期末数据和指标						
期末可供分配利润	68,945,357.60	31,061,217.41	21,460,618.67	7,591,009.27	7,574,786.16	1,833,036.64
期末可供分配基金份额利润	0.3972	0.3738	0.0841	0.0661	0.0299	0.0147
期末基金资产净值	243,293,907.63	114,341,746.16	276,544,162.73	122,506,247.52	261,173,153.44	126,206,447.31
期末基金份额净值	1.4017	1.3760	1.0841	1.0661	1.0299	1.0147
3.1.	2025 年 10 月 30 日		2024 年末		2023 年末	

3 累 计 期 末 指 标						
基 金 份 额 累 计 净 值 增 长 率	40.17%	37.60%	8.41%	6.61%	2.99%	1.47%

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 500ETF 联接 (LOF) A						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	① - ③	② - ④
自基金 合同生 效起至 今	1.09%	1.01%	1.04%	1.03%	0.05%	-0.02%

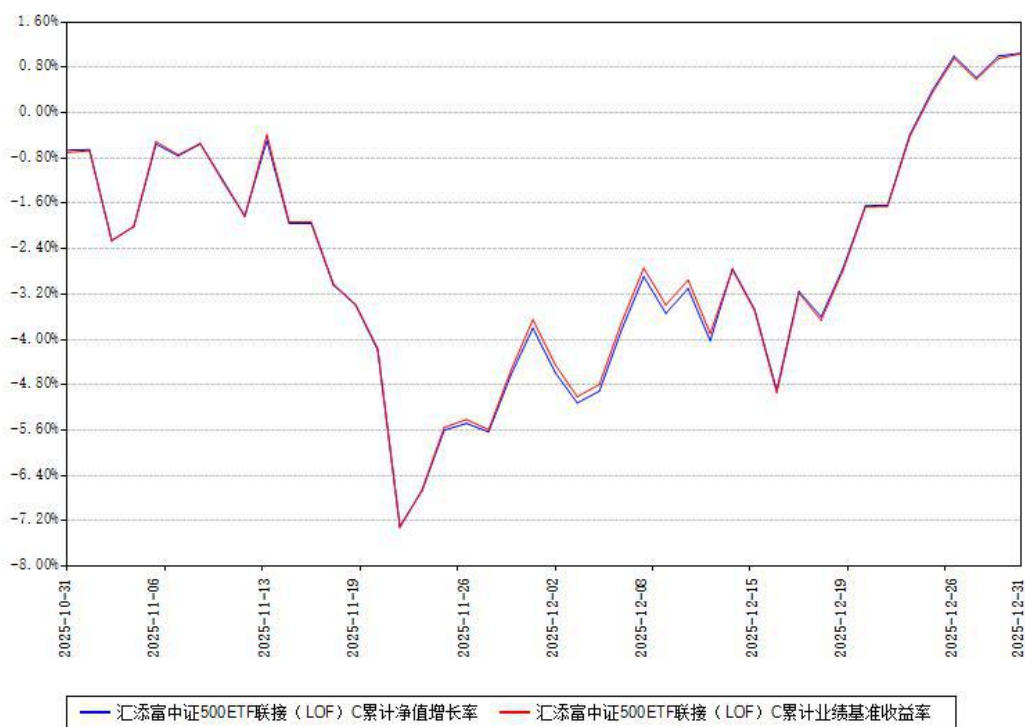
汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
自基金合同生效起至今	1.05%	1.01%	1.04%	1.03%	0.01%	-0.02%

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

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



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



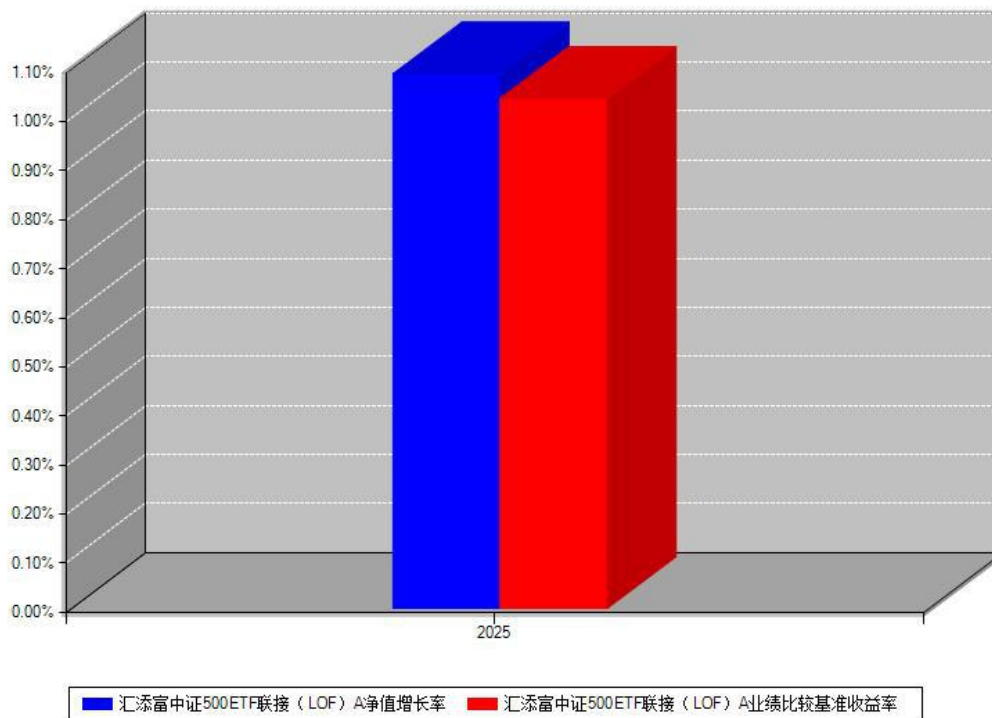
注：本《基金合同》生效之日为2025年10月31日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

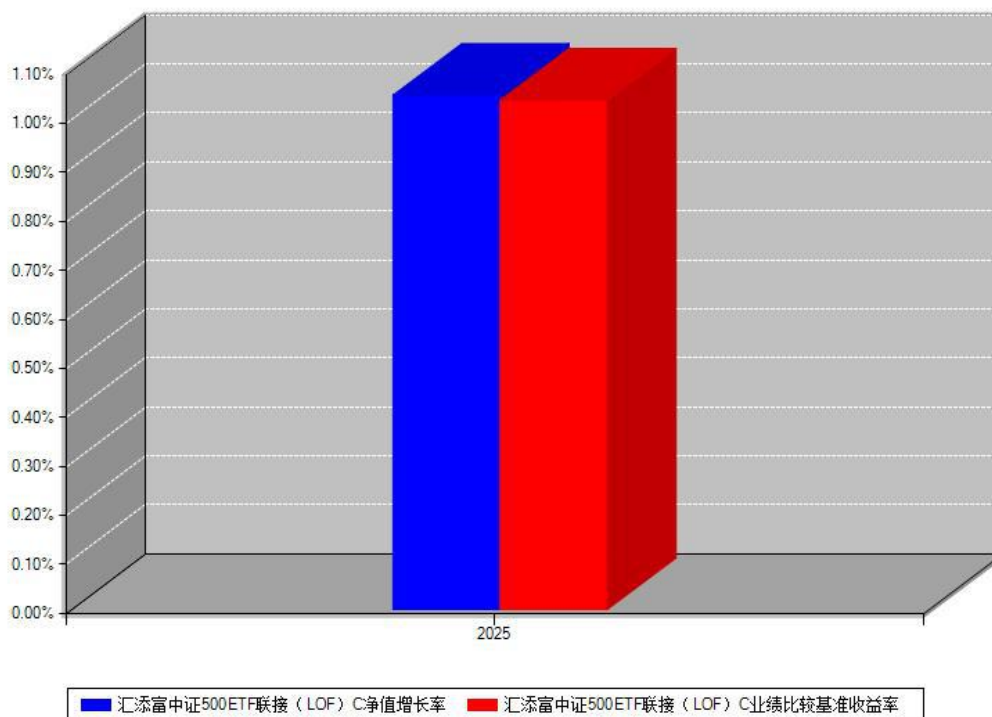
本基金由原汇添富中证500指数型发起式证券投资基金（LOF）于2025年10月31日转型而来。

### 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

汇添富中证500ETF联接（LOF）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500ETF联接（LOF）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2025年10月31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。

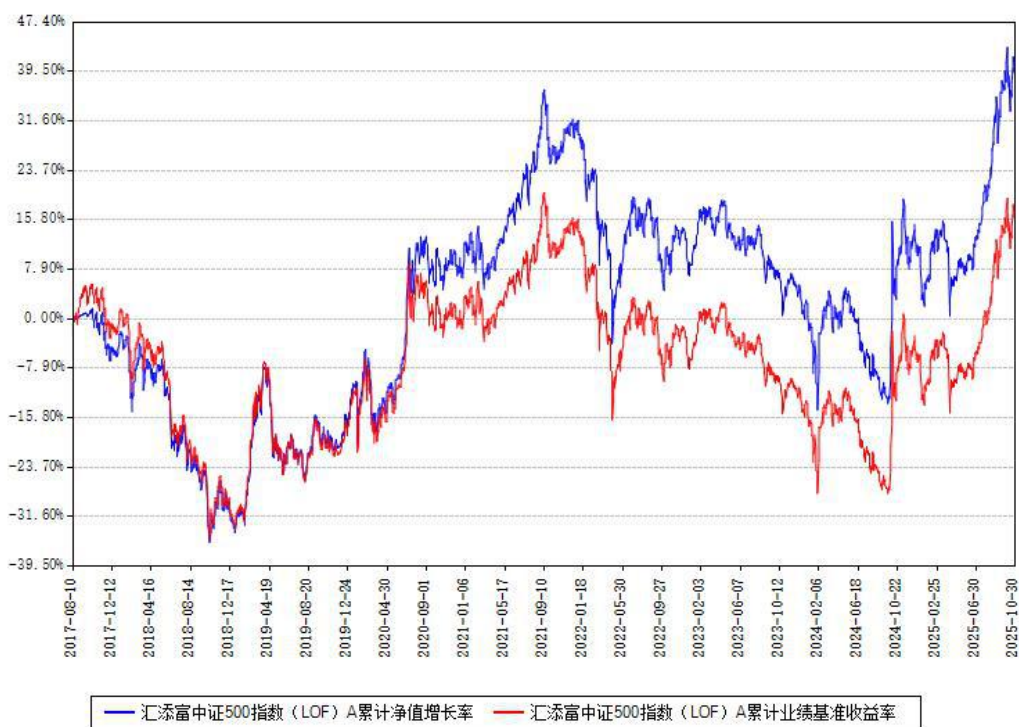
### 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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 500 指数 (LOF) A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
自 2025-08-01 至 2025-10-30	17.78%	1.30%	17.65%	1.30%	0.13%	0.00%
自 2025-05-01 至 2025-10-30	31.41%	1.05%	29.43%	1.05%	1.98%	0.00%
自 2024-11-01 至 2025-10-30	25.52%	1.27%	23.91%	1.27%	1.61%	0.00%
自 2022-11-01 至 2025-10-30	30.29%	1.26%	26.13%	1.29%	4.16%	-0.03%
自 2020-11-01 至 2025-10-30	34.01%	1.21%	20.40%	1.23%	13.61%	-0.02%
自 2017-08-10 至 2025-10-30	40.17%	1.28%	16.84%	1.31%	23.33%	-0.03%
汇添富中证 500 指数 (LOF) C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
自 2025-08-01 至 2025-10-30	17.72%	1.30%	17.65%	1.30%	0.07%	0.00%
自 2025-05-01 至 2025-10-30	31.26%	1.05%	29.43%	1.05%	1.83%	0.00%
自 2024-11-01 至 2025-10-30	25.26%	1.27%	23.91%	1.27%	1.35%	0.00%
自 2022-11-01 至 2025-10-30	29.46%	1.26%	26.13%	1.29%	3.33%	-0.03%
自 2020-11-01 至 2025-10-30	32.47%	1.21%	20.40%	1.23%	12.07%	-0.02%
自 2017-08-10 至 2025-10-30	37.60%	1.28%	16.84%	1.31%	20.76%	-0.03%

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

汇添富中证500指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数（LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

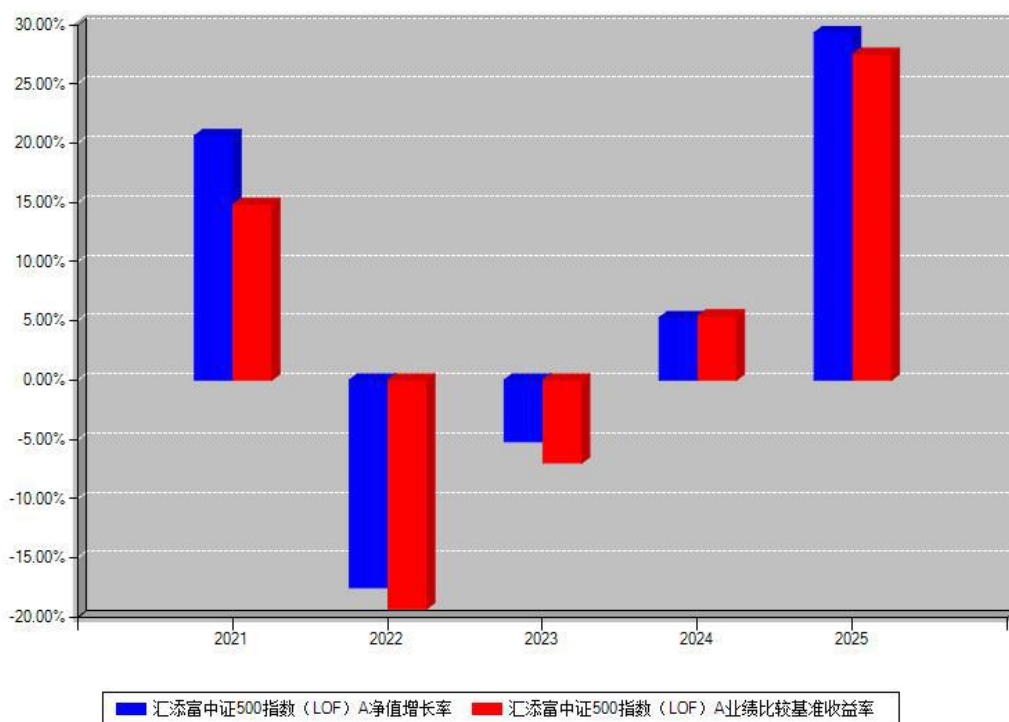


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年08月10日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

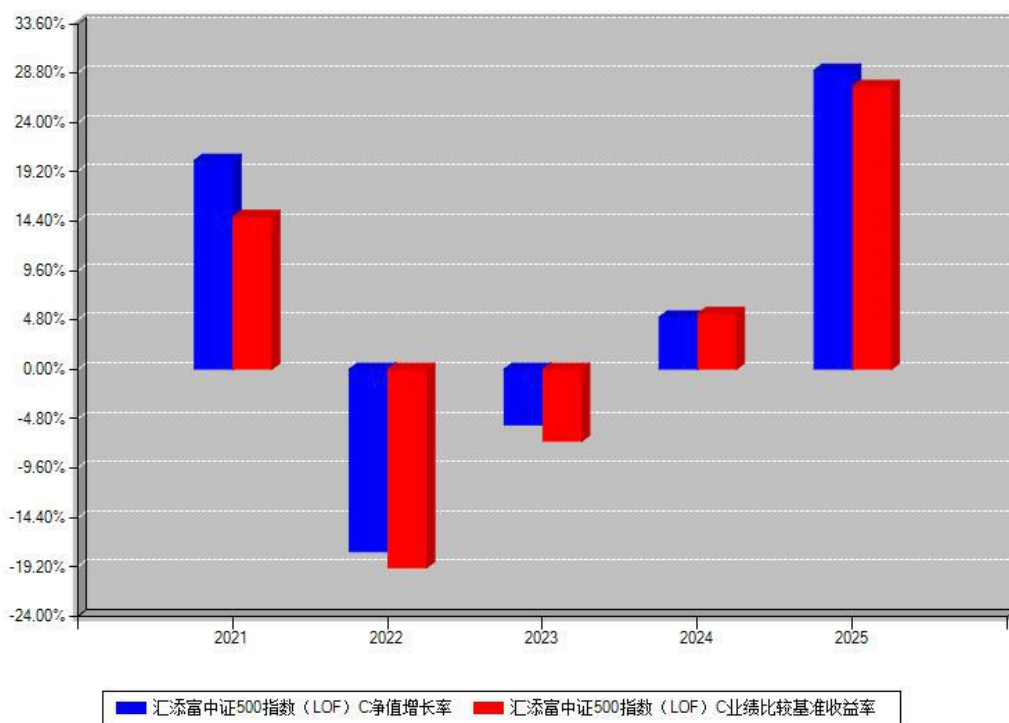
本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

### 3.2.3 过去五年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500指数（LOF）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500指数（LOF）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2017年08月10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 10 月 31 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		
吴振翔	本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监	2025 年 10 月 31 日	-	19	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：

				<p>证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开</p>
--	--	--	--	---

				<p>放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金</p>
--	--	--	--	---

				<p>经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 8 月 10 日至 2025 年 10 月 30 日任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一</p>
--	--	--	--	---

				<p>路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至 2025 年 11 月 10 日任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 1 日至今</p>
--	--	--	--	--

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

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		
吴振翔	本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监	2017年08月10日	2025年10月30日	19	国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理,现任指数与量化投资部副总监。2010年2月6日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的

				<p>基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经</p>
--	--	--	--	--

				<p>理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 8 月 10 日至 2025 年 10 月 30 日任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

				<p>2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28</p>
--	--	--	--	--

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

					<p>金经理。2024 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 3 月 27 日至今任汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月 31 日至今任汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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。本报告期内兼任投资人员有产品离任情况,离任产品情况如下:吴振翔—离任产品类型:公募基金,离任数量:1只,离任时间:2025年11月10日;离任产品类型:私募资产管理计划,离任数量:1只,离任时间:2025年12月29日。

#### 4.1.3 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)

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

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

吴振翔—离任产品类型：公募基金，离任数量：2 只，离任时间：2025 年 3 月 21 日、2025 年 10 月 30 日；离任产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0 只，离任时间：无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制（转型后）

基金经理的薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或业绩表现不直接挂钩，公司会根据考核结合贡献等情况进行综合评定。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制（转型前）

基金经理的薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或业绩表现不直接挂钩，公司会根据考核结合贡献等情况进行综合评定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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，本基金管理人建立了兼任组合公平交易管理制度，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。

在投资指令管理方面，兼任基金经理原则上应做到“同时同价”。多个组合同日购入或出售同一证券时，应尽量同时发送投资指令，并进行价差监控管理。

在交易行为方面，原则上兼任组合间不得进行同日反向交易（完全按照有关指数的构成比例进行投资的产品等特定情形除外），公司对兼任组合间同日及临近交易日同向交易的价差强化控制和监测。

在交易监测和分析方面，公司对不同时间窗下反向交易和同向交易价差进行分析，最长时间为 10 个交易日以上，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素和兼任基金经理的说明，综合分析和评估兼任组合是否存在不公平对待等异常情形。

在事后分析方面，公司定期对兼任组合间的收益率差异、同反向交易的交易时机和交易价差进行事后分析，并对公平交易和异常交易监控分析机制的内部执行情况实施检查。

本报告期内，公司旗下兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

### 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

外部环境方面，2025 年的主要影响因素集中在关税政策变化和地缘冲突上。4 月初，美国宣布对其贸易伙伴征收对等关税，我们国家也做出了有力回应，上调了美国进口商品的关税，同时加强了稀土出口管制。当时资本市场对这次关税调整反应比较大，全球权益市场都出现了普遍下跌。5 月份，中美双方开展经贸会谈，取得了一定进展，彼此都大幅下调了关税，贸易争端得到了阶段性缓和。到 6 月份，市场风险偏好慢慢修复，但中东地缘冲突爆发，又给市场带来了新一轮冲击。9 月份，中美两国领导人进行了务实、积极且有建设性的电话沟通，对市场情绪起到了稳定作用。与此同时，美联储在 9 月下旬如期降息 25 个基点，将联邦基金目标利率下调至 4.00%-4.25%，这也是美联储 2025 年的首次降息，正式开启了降息周期，全球流动性预期得到改善。虽然美联储后续的降息节奏，还会受到美国经济数据、联储主席换届等不确定因素影响，但从当前市场数据来看，2026 年预计还会有 1-2 次降息，这会给全球流动性带来潜在改善空间，同时也为国内货币政策进一步宽松留出了余地。

政策层面，2025 年财政政策和货币政策始终协同发力，没有出现单一政策发力不足的情况。积极的财政政策和稳健的货币政策相互配合，为 A 股市场营造了较好的流动性环境，市场资金面整体宽松，有效支撑了市场的稳健运行，也缓解了部分行业和企业的经营压力。

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

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2025 年 10 月 31 日转型为汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)。转型前,本报告期汇添富中证 500 指数(LOF)A 类份额净值增长率为 29.30%,同期业绩比较基准收益率为 27.49%。本报告期汇添富中证 500 指数(LOF)C 类份额净值增长率为 29.07%,同期业绩比较基准收益率为 27.49%。转型后,本报告期汇添富中证 500ETF 联接(LOF)A 类份额净值增长率为 1.09%,同期业绩比较基准收益率为 1.04%。本报告期汇添富中证 500ETF 联接(LOF)C 类份额净值增长率为 1.05%,同期业绩比较基准收益率为 1.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年依然会是外部环境高度不确定的一年。地缘冲突越来越频繁,大国之间的竞争,大概率还会扩散到更多领域——从现在的人工智能、工业制造,进一步延伸到资源、太空等各个方面。不过我们也不用过于担心,我国在全球竞争中,有着独特的经济纵深优势,就像 2025 年那样,即便多次受到关税冲击,国内的制造业和出口依然保持了较强的韧性,后续还有充分的发展潜力。另外,随着“十五五”规划的开启,2026 年到 2030 年,是我国迈向远景目标的关键阶段,预计在战略规划和政策执行上,会保持足够的定力,能够较好地推进经济转型,逐步释放经济增长的潜力,这也会给 A 股市场提供长期的支撑。

#### 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。在产品各环节评估新产品、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,且互不相

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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；同一类别内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

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 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_B390 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 10 月 31 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 10 月 31 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)，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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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

	<p>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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)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</p>

	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	陈露	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_B384 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 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报表, 包括 2025 年 10 月 30 日 (基金合同失效前日) 的资产负债表, 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 10 月 30 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。</p> <p>我们认为, 后附的汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2025 年 10 月 30 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 10 月 30 日 (基金合同失效前日) 止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF), 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。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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。</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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，就可能对汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 不能持续经营。</p>

	(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	陈露	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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

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
<b>资产:</b>		
货币资金	7.4.7.1	13,485,929.02
结算备付金		4,749,006.43
存出保证金		1,589,948.34
交易性金融资产	7.4.7.2	320,071,313.65
其中: 股票投资		815,933.76
基金投资		306,738,457.92
债券投资		12,516,921.97
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		305,258.78
应收股利		-
应收申购款		674,907.63
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		340,876,363.85

负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
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		7,029,978.96
应付管理人报酬		3,555.28
应付托管费		1,185.08
应付销售服务费		18,790.14
应付投资顾问费		-
应交税费		17,478.26
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.7	265,090.42
负债合计		7,336,078.14
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.8	236,846,480.66
未分配利润	7.4.7.9	96,693,805.05
净资产合计		333,540,285.71
负债和净资产总计		340,876,363.85

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 236,846,480.66 份。本基金下属汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) A 基金份额净值 1.4170 元，基金份额总额 158,585,033.73 份；本基金下属汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C 基金份额净值 1.3905 元，基金份额总额 78,261,446.93 份。

2、本基金合同于 2025 年 10 月 31 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期：2025 年 10 月 31 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 10 月 31 日 (基金合 同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>3,630,655.55</b>
1.利息收入		31,542.26

其中：存款利息收入	7.4.7.10	31,542.26
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）		35,668,545.90
其中：股票投资收益	7.4.7.11	34,984,060.93
基金投资收益	7.4.7.12	220,389.99
债券投资收益	7.4.7.13	163,847.83
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	294,744.87
股利收益	7.4.7.17	5,502.28
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	-32,070,706.02
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	1,273.41
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>103,592.79</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	25,627.74
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	8,542.56
3. 销售服务费		37,704.39
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		1,872.82
8. 其他费用	7.4.7.21	29,845.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,527,062.76</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,527,062.76</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>3,527,062.76</b>

注：本基金合同于 2025 年 10 月 31 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期：2025 年 10 月 31 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 10 月 31 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	256,662,592.91	100,973,060.88	357,635,653.79
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-19,816,112.25	-4,279,255.83	-24,095,368.08
(一)、综合收益总额	-	3,527,062.76	3,527,062.76
(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)	-19,816,112.25	-7,806,318.59	-27,622,430.84
其中：1.基金申购款	26,588,221.33	8,937,880.46	35,526,101.79
2.基金赎回款	-46,404,333.58	-16,744,199.05	-63,148,532.63
(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	236,846,480.66	96,693,805.05	333,540,285.71

注：本基金合同于 2025 年 10 月 31 日生效，本报无上年度可比期间，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：

张暉	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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(以下简称“本基金”),是由汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金(LOF)变更而来。原汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金(LOF)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〔2017〕770 号文《关于准予汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金(LOF)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 2017 年 8 月 10 日生效。首次设立基金募集规模为 735,804,689.63 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(2017)验字第 60466941\_B29 号验资报告予以验证。

根据《关于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金(LOF)转型为汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)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 500 指数型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》的相关约定,经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致,履行适当程序后,汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金(LOF)转型为汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)。根据转型安排,修订后的《汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》自 2025 年 10 月 31 日起生效,《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金(LOF)基金合同》同日起失效。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

#### 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 10 月 31 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 10 月 31 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：

(1)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;

(2)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;

(3)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;

(4)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

(1)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;

(2)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;

(3)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;

(4)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;

(5)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;

(6)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;

(7)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;

(8)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、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金可进行基金收益分配;若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,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;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

3、同一类别内每一基金份额享有同等分配权;

4、法律法规或监管机构另有规定的,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。

### 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	13,485,929.02
等于：本金	13,481,580.41

加：应计利息	4,348.61
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	13,485,929.02

#### 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	1,123,066.28	-	815,933.76	-307,132.52	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	12,403,777.00	112,353.97	12,516,921.97	791.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	12,403,777.00	112,353.97	12,516,921.97	791.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	295,884,618.14	-	306,738,457.92	10,853,839.78	
其他	-	-	-	-	
合计	309,411,461.42	112,353.97	320,071,313.65	10,547,498.26	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
(国债期货投资)	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
(外汇期货投资)	-	-	-	-
权益衍生工具	6,829,520.00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	6,829,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,829,520.00	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2603	IC2603	5	7,366,600.00	537,080.00
合计				537,080.00
减：可抵销期货暂收款				537,080.00
净额				-

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

#### 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	100,090.42
其中：交易所市场	100,090.42
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	265,090.42

### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) A		
项目	本期 2025 年 10 月 31 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	173,567,208.64	173,567,208.64
本期申购	9,731,528.86	9,731,528.86
本期赎回(以“-”号填列)	-24,713,703.77	-24,713,703.77
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	158,585,033.73	158,585,033.73
汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C		
项目	本期 2025 年 10 月 31 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	83,095,384.27	83,095,384.27
本期申购	16,856,692.47	16,856,692.47
本期赎回(以“-”号填列)	-21,690,629.81	-21,690,629.81
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	78,261,446.93	78,261,446.93

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 500ETF 联接 (LOF) 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	68,945,357.60	781,341.39	69,726,698.99

日			
本期利润	24,156,883.18	-22,005,599.03	2,151,284.15
本期基金份额交易产生的变动数	-7,661,139.76	1,912,354.30	-5,748,785.46
其中：基金申购款	4,905,030.62	-1,345,919.03	3,559,111.59
基金赎回款	-12,566,170.38	3,258,273.33	-9,307,897.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	85,441,101.02	-19,311,903.34	66,129,197.68
汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	31,061,217.41	185,144.48	31,246,361.89
本期利润	11,440,885.60	-10,065,106.99	1,375,778.61
本期基金份额交易产生的变动数	-2,409,711.62	352,178.49	-2,057,533.13
其中：基金申购款	8,286,736.52	-2,907,967.65	5,378,768.87
基金赎回款	-10,696,448.14	3,260,146.14	-7,436,302.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,092,391.39	-9,527,784.02	30,564,607.37

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	23,104.65
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	7,571.83
其他	865.78
合计	31,542.26

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 10 月 31 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	23,917,335.21
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	11,066,725.72
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	34,984,060.93

#### 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 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	205,078,539.96
减：卖出股票成本总额	181,003,168.25
减：交易费用	158,036.50
买卖股票差价收入	23,917,335.21

#### 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 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日
申购基金份额总额	296,758,500.00
减：现金支付申购款总额	154,464,259.95
减：申购股票成本总额	131,227,514.33
减：交易费用	-
申购差价收入	11,066,725.72

#### 7.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 31 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	21,123,938.70
减：卖出/赎回基金成本总额	20,892,108.27
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	6,752.35
减：交易费用	4,688.09
基金投资收益	220,389.99

#### 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 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	28,733.72
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	135,114.11
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	163,847.83

### 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 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日
卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成交总额	487,299.85
减: 卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成本总额	352,000.00
减: 应计利息总额	166.28
减: 交易费用	19.46
买卖债券差价收入	135,114.11

### 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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	294,744.87
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 31 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	5,502.28
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	5,502.28

#### 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 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-31,998,146.02
——股票投资	-42,744,588.80
——债券投资	-107,397.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	10,853,839.78
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-72,560.00
——权证投资	-
——期货投资	-72,560.00
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	-32,070,706.02

### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日	
基金赎回费收入		1,273.41
替代损益		-
其他		-
合计		1,273.41

### 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 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日	
审计费用		7,643.13
信息披露费		20,382.69
证券出借违约金		-
账户维护费		-
银行费用		1,812.27
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		7.19
合计		29,845.28

## 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
招商证券股份有限公司 ("招商证券")	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 500 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
招商证券	231,205,163.87	100.00

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日
-------	--

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
招商证券	487,299.85	100.00

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
招商证券	40,541,268.10	100.00

### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期末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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
招商证券	40,673.13	100.00	100,090.42	100.00

注：根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

### 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 10 月 31 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	25,627.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	27,429.58
应支付基金管理人的净管理费	-1,801.84

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 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 10 月 31 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	8,542.56

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 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

### 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 10 月 31 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 500ETF 联接 (LOF) A	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	7,162.97	7,162.97
东方证券股份有限公司	-	995.78	995.78
招商证券股份有限公司	-	71.42	71.42
合计	-	8,230.17	8,230.17

注:本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

计算方法如下:

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

### 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:本基金本报告期末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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用自有资金投资本基金。

##### 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

注：本基金本报告期末无由关联方保管的银行存款余额，本报告期末有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

#### 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：本基金本报告期末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 298,616,100.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 72.88%。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301563	云汉芯城	2025年09月23日	6个月	新股流通受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	
301575	艾芬达	2025年09月03日	6个月	新股流通受限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	
301584	建发致新	2025年09月18日	6个月	新股流通受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	
301609	山大电力	2025年07月16日	6个月	新股流通受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	
301656	联合动力	2025年09月17日	6个月	新股流通受限	12.48	25.46	3,235	40,372.80	82,363.10	
301668	昊创瑞	2025年09月15日	6个月	新股流	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	

	通	日		通						
600930	华电 新能源 集团	2025 年 07 月 09 日	6 个月	新股 流通 受限	3.18	6.24	70,549	224,345.82	440,225.76	
601026	道生 天合 材料 科技	2025 年 10 月 09 日	6 个月	新股 流通 受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	
603175	超颖 电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股 流通 受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	
603334	丰倍 生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股 流通 受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	
603370	华新 精科	2025 年 08 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	
603376	大明 电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	
603406	天富	2025 年 07	6 个	新股	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	

	龙	月 30 日	月	流通受限						
603418	友升股份	2025 年 09 月 16 日	6 个月	新股流通受限	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	
688729	屹唐半导体股份	2025 年 07 月 01 日	6 个月	新股流通受限	8.45	24.28	1,676	14,162.20	40,693.28	
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天 3	2023 年 08 月 30 日	重大事项停牌	0.01		-	283,500	738,496.28	2,835.00	

注：截止 2025 年 12 月 31 日，本基金合计持有中天 3 (在深圳证券交易所退市时的股票简

称为\*ST 中天，证券代码为 000540) 283,500 股。根据中天金融集团股份有限公司 (以下简称“公司”) 于 2023 年 6 月 29 日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市暨摘牌的公告》，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证券监督管理委员会公告〔2017〕13 号) 的有关规定，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，决定自 2023 年 6 月 16 日起，对旗下证券投资基金所持有的\*ST 中天 (000540.SZ) 按每股 0.01 元人民币估值。

根据公司于 2023 年 8 月 28 日发布的《中天金融集团股份有限公司股票转让公告》，公司可在全国中小企业股份转让系统有限责任公司依托原证券公司代办股份转让系统设立并代为管理的两网公司及退市公司板块 (以下简称“退市板块”) 转让仅限于原在深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 挂牌交易的流通股份，确权代码 (即挂牌退市板块后的股票代码): 400174，开始转让日为 2023 年 8 月 30 日。根据公司于同日发布的《中天金融集团股份有限公司关于公司股票挂牌当日即暂停转让的公告》，因公司正在进行重整事项，经向全国股转公司申请，公司股票自 2023 年 8 月 30 日起暂停转让。

#### 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	13,485,929.02	-	-	-	-	-	13,485,929.02
结算备付金	4,749,006.43	-	-	-	-	-	4,749,006.43
存出保证	484,958.34	-	-	-	-	1,104,990.00	1,589,948.34

金							
交易性金融资产	489.17	-	12,516,432.80	-	-	307,554,391.68	320,071,313.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	305,258.78	305,258.78
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	68,014.96	-	-	-	-	606,892.67	674,907.63
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,788,397.92	-	12,516,432.80	-	-	309,571,533.13	340,876,363.85
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	-	-	-	-	-	7,029,978.96	7,029,978.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,555.28	3,555.28
应付托管费	-	-	-	-	-	1,185.08	1,185.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	18,790.14	18,790.14
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	17,478.26	17,478.26
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	265,090.42	265,090.42
负债总计	-	-	-	-	-	7,336,078.14	7,336,078.14
利率敏感度缺口	18,788,397.92	-	12,516,432.80	-	-	302,235,454.99	333,540,285.71

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 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	10,502.04
	基准利率增加 25 个基点	-10,482.46

#### 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	815,933.76	0.24
交易性金融资产 - 基金投资	306,738,457.92	91.96
交易性金融资产 - 债券投资	12,516,921.97	3.75
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	320,071,313.65	95.96
----	----------------	-------

#### 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 500 指数上涨 5%	15,588,916.33
	中证 500 指数下跌 5%	-15,588,916.33

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 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	306,899,070.28
第二层次	12,515,843.35
第三层次	656,400.02

合计	320,071,313.65
----	----------------

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	787,366.20	787,366.20
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,548.17	3,548.17
转出第三层次	-	134,464.68	134,464.68
当期利得或损失总额	-	-49.67	-49.67
其中：计入损益的利得或损失	-	-49.67	-49.67
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	656,400.02	656,400.02
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-49.67	-49.67

##### 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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股权	2,835.00	上市公司比较法	折现率	0.2	负相关
限售股票	653,565.02	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1628-3.0323	负相关

#### 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 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2025 年 10 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 10 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	10,260,185.36	7,945,916.30

结算备付金		3,964,733.17	1,410,877.00
存出保证金		1,273,636.30	1,003,700.02
交易性金融资产	7.4.7.2	342,612,331.48	389,031,245.00
其中：股票投资		329,664,581.23	369,947,187.06
基金投资		-	-
债券投资		12,947,750.25	19,084,057.94
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		2,855,568.61	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,298,438.85	608,342.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		362,264,893.77	400,000,081.09
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 10 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	0.73
应付赎回款		4,098,821.84	464,851.50
应付管理人报酬		234,133.75	178,126.83
应付托管费		46,826.73	35,625.37
应付销售服务费		53,065.03	21,546.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.16	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	196,391.47	249,519.62
负债合计		4,629,239.98	949,670.84
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	256,662,592.91	369,998,782.31
未分配利润	7.4.7.9	100,973,060.88	29,051,627.94
净资产合计		357,635,653.79	399,050,410.25

负债和净资产总计		362,264,893.77	400,000,081.09
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2025 年 10 月 30 日，基金份额总额 256,662,592.91 份。本基金下属汇添富中证 500 指数 (LOF) A 基金份额净值 1.4017 元，基金份额总额 173,567,208.64 份；本基金下属汇添富中证 500 指数 (LOF) C 基金份额净值 1.3760 元，基金份额总额 83,095,384.27 份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 10 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>102,279,723.94</b>	<b>24,523,815.24</b>
1.利息收入		181,241.69	655,754.50
其中：存款利息收入	7.4.7.10	180,710.08	343,813.87
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		531.61	-
其他利息收入		-	311,940.63
2.投资收益（损失以“-”填列）		44,583,334.00	-17,066,127.01
其中：股票投资收益	7.4.7.11	37,858,236.65	-25,295,395.39
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	139,153.60	86,425.83
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	1,252,499.66	291,991.68
股利收益	7.4.7.17	5,333,444.09	7,850,850.87
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	57,505,035.16	40,870,386.38
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	10,113.09	63,801.37
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,547,320.74</b>	<b>2,929,906.43</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,757,008.83	2,007,824.14
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	351,401.74	401,564.84
3. 销售服务费		273,828.38	266,060.00
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		4,512.99	2,182.90
8. 其他费用	7.4.7.21	160,568.80	252,274.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>99,732,403.20</b>	<b>21,593,908.81</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>99,732,403.20</b>	<b>21,593,908.81</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>99,732,403.20</b>	<b>21,593,908.81</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	369,998,782.31	29,051,627.94	399,050,410.25
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	369,998,782.31	29,051,627.94	399,050,410.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-113,336,189.40	71,921,432.94	-41,414,756.46
（一）、综合收益总额	-	99,732,403.20	99,732,403.20
（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）	-113,336,189.40	-27,810,970.26	-141,147,159.66
其中：1.基金申购款	394,635,436.11	107,876,233.24	502,511,669.35
2.基金赎回款	-507,971,625.51	-135,687,203.50	-643,658,829.01
（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	256,662,592.91	100,973,060.88	357,635,653.79
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	377,971,777.95	9,407,822.80	387,379,600.75
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	377,971,777.95	9,407,822.80	387,379,600.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,972,995.64	19,643,805.14	11,670,809.50
（一）、综合收益总额	-	21,593,908.81	21,593,908.81
（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）	-7,972,995.64	-1,950,103.67	-9,923,099.31
其中：1.基金申购款	494,668,202.32	13,872,197.12	508,540,399.44
2.基金赎回款	-502,641,197.96	-15,822,300.79	-518,463,498.75
（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	369,998,782.31	29,051,627.94	399,050,410.25

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) (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〔2017〕770 号文《关于准予汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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 2017 年 8 月 10 日生效。首次设立基金募集规模为 735,804,689.63 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 (2017) 验字第 60466941\_B29 号验资报告予以验证。本基金为上市契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为招商证券股份有限公司。

### 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 10 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 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 10 月 30 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：

(1)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；

(2)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；

(3)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;

(4)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

(1)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;

(2)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;

(3)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;

(4)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;

(5)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;

(6)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;

(7)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;

(8)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、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金可进行基金收益分配;若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,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;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事

项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

- 3、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；
- 4、法律法规或监管机构另有规定的，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。

#### 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 10 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	10,260,185.36	7,945,916.30
等于：本金	10,232,171.57	7,942,856.92
加：应计利息	28,013.79	3,059.38
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	10,260,185.36	7,945,916.30

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 10 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		287,227,124.95	-	329,664,581.23	42,437,456.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,755,777.00	83,785.25	12,947,750.25	108,188.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	12,755,777.00	83,785.25	12,947,750.25	108,188.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		299,982,901.95	83,785.25	342,612,331.48	42,545,644.28
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		384,092,489.94	-	369,947,187.06	-14,145,302.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	18,915,248.00	151,857.94	19,084,057.94	16,952.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	18,915,248.00	151,857.94	19,084,057.94	16,952.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		403,007,737.94	151,857.94	389,031,245.00	-14,128,350.88

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 10 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
(国债期货投资)	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
(外汇期货投资)	-	-	-	-
权益衍生工具	6,697,560.00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	6,697,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,697,560.00	-	-	-
	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
项目	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
(国债期货投资)	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
(外汇期货投资)	-	-	-	-
权益衍生工具	5,896,800.00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	5,896,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,896,800.00	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2512	IC2512	5	7,307,200.00	609,640.00
合计				609,640.00
减：可抵销期货暂收款				609,640.00
净额				-

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

#### 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 2025 年 10 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	-	5.99
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	59,417.29	61,762.05
其中：交易所市场	59,417.29	61,762.05
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	37,356.87	45,000.00
应付信息披露费	99,617.31	120,000.00
应付指数使用费	-	22,751.58
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	196,391.47	249,519.62

### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	255,083,544.06	255,083,544.06
本期申购	72,090,000.77	72,090,000.77
本期赎回 (以“-”号填列)	-153,606,336.19	-153,606,336.19
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	173,567,208.64	173,567,208.64
汇添富中证 500 指数 (LOF) C		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额

上年度末	114,915,238.25	114,915,238.25
本期申购	322,545,435.34	322,545,435.34
本期赎回 (以“-”号填列)	-354,365,289.32	-354,365,289.32
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	83,095,384.27	83,095,384.27

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 500 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	67,680,157.31	-46,219,538.64	21,460,618.67
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	67,680,157.31	-46,219,538.64	21,460,618.67
本期利润	23,929,622.48	41,318,537.15	65,248,159.63
本期基金份额交易产生的变动数	-22,664,422.19	5,682,342.88	-16,982,079.31
其中：基金申购款	20,129,399.27	-3,638,467.09	16,490,932.18
基金赎回款	-42,793,821.46	9,320,809.97	-33,473,011.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,945,357.60	781,341.39	69,726,698.99
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,297,524.24	-20,706,514.97	7,591,009.27
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	28,297,524.24	-20,706,514.97	7,591,009.27
本期利润	18,297,745.56	16,186,498.01	34,484,243.57
本期基金份额交易产生的变动数	-15,534,052.39	4,705,161.44	-10,828,890.95

其中：基金申购款	84,111,275.34	7,274,025.72	91,385,301.06
基金赎回款	-99,645,327.73	-2,568,864.28	-102,214,192.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,061,217.41	185,144.48	31,246,361.89

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	156,631.61	288,021.93
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	22,887.13	52,859.05
其他	1,191.34	2,932.89
合计	180,710.08	343,813.87

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	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	37,858,236.65	-25,295,395.39
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	37,858,236.65	-25,295,395.39

##### 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年01月01日至2025年10月30日	2024年01月01日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	511,215,099.02	276,880,812.64
减：卖出股票成本总额	472,888,590.23	301,818,994.99
减：交易费用	468,272.14	357,213.04
买卖股票差价收入	37,858,236.65	-25,295,395.39

#### 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	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年10月30日	2024年01月01日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	153,423.60	68,329.05
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-14,270.00	18,096.78
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	139,153.60	86,425.83

##### 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	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年10月30日	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	20,493,388.88	3,568,265.75
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	20,215,049.00	3,479,790.00
减：应计利息总额	292,609.88	70,375.09
减：交易费用	-	3.88
买卖债券差价收入	-14,270.00	18,096.78

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	1,252,499.66	291,991.68
外汇期货投资收益	-	-
外汇远期投资收益	-	-
国债期货投资收益	-	-

#### 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 10 月 30 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	5,333,444.09	7,850,850.87
其中：证券出借权益补偿收入	-	299,343.71
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,333,444.09	7,850,850.87

#### 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 10 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
------	---------------------------------------	--

	月 30 日	月 31 日
1.交易性金融资产	56,673,995.16	41,101,666.38
——股票投资	56,582,759.16	41,109,012.28
——债券投资	91,236.00	-7,345.90
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	831,040.00	-231,280.00
——权证投资	-	-
——期货投资	831,040.00	-231,280.00
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	57,505,035.16	40,870,386.38

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	10,113.09	63,801.37
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	10,113.09	63,801.37

#### 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	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	37,356.87	45,000.00
信息披露费	99,617.31	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	6,149.97	6,706.52
指数使用费	17,216.67	80,312.96

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	227.98	255.07
合计	160,568.80	252,274.55

## 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,基金发起人
招商证券股份有限公司 ("招商证券")	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
招商证券	885,930,275.01	100.00	549,561,826.41	100.00

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
招商证券	15,603,557.00	100.00	19,313,683.75	100.00

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
招商证券	5,759,000.00	100.00	-	-

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
招商证券	155,881.18	100.00	59,417.29	100.00
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
招商证券	183,530.50	100.00	61,762.05	100.00

注:1.上述佣金按协议约定的佣金率计算,佣金率由协议签订方参考市场价格确定。截至 2024 年 6 月 30 日止,该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》,自 2024 年 7 月 1 日起,基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率,且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用;其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用,但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍,且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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 10 月 30 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	1,757,008.83	2,007,824.14
其中:应支付销售机构的客户维护费	548,756.24	615,385.79
应支付基金管理人的净管理费	1,208,252.59	1,392,438.35

注:基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日	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	351,401.74	401,564.84

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

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 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 10 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
东方证券股份有限公司	-	5,334.95	5,334.95
汇添富基金管理股份有限公司	-	120,342.59	120,342.59
招商证券股份有限公司	-	301.98	301.98
合计	-	125,979.52	125,979.52
获得销售服务	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		

费的各关联方 名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	42,207.05	42,207.05
东方证券股份有限公司	-	9,139.55	9,139.55
招商证券股份有限公司	-	245.23	245.23
合计	-	51,591.83	51,591.83

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 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

单位：人民币元

本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	1,254,963.00	0.81~3.50	2.00	988.22	-	-
招商证券	219,390.00	1.70~2.40	2.35	207.12	-	-

### 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自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额，本报告期及上年度可比期间均未有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

### 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：本基金本报告期末进行利润分配。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10月30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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301563	云汉芯城	2025年09月23日	6个月	新股流通受限	27.00	161.60	110	2,970.00	17,776.00	
301575	艾芬达	2025年09月03日	6个月	新股流通受限	27.69	43.62	126	3,488.94	5,496.12	
301584	建发致新	2025年09月18日	6个月	新股流通受限	7.05	24.99	447	3,151.35	11,170.53	
301590	优优绿能	2025年05月28日	6个月	新股流通受限	89.60	170.43	73	6,540.80	12,441.39	
301609	山大	2025年07	6个月	新股	14.66	46.60	277	4,060.82	12,908.20	

	电 力	月 16 日	月	流 通 受 限						
301656	联 合 动 力	2025 年 09 月 17 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	12.48	22.76	3,235	40,372.80	73,628.60	
301668	昊 创 瑞 通	2025 年 09 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.00	44.65	165	3,465.00	7,367.25	
301678	新 恒 汇	2025 年 06 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	12.80	67.68	382	4,889.60	25,853.76	
600930	华 电 新 能 源 集 团	2025 年 07 月 09 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	3.18	6.32	70,549	224,345.82	445,869.68	
601026	道 生 天 合 材 料 科 技	2025 年 10 月 09 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	5.98	16.45	451	2,696.98	7,418.95	
603049	中 策 橡 胶	2025 年 05 月 27 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	46.50	52.47	174	8,091.00	9,129.78	
603175	超	2025	6	新	17.08	58.41	169	2,886.52	9,871.29	

	颖电子	年 10 月 17 日	个月	股流通受限						
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	5 个交易日	新股流通受限	24.49	24.49	791	19,371.59	19,371.59	
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股流通受限	24.49	24.49	88	2,155.12	2,155.12	
603370	华新精科	2025 年 08 月 27 日	6 个月	新股流通受限	18.60	36.99	82	1,525.20	3,033.18	
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	7 个交易日	新股流通受限	12.55	12.55	995	12,487.25	12,487.25	
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.55	12.55	111	1,393.05	1,393.05	
603406	天富龙	2025 年 07 月 30 日	6 个月	新股流通受限	23.60	36.47	153	3,610.80	5,579.91	
603418	友升股	2025 年 09 月 16 日	6 个月	新股流	46.36	53.55	139	6,444.04	7,443.45	

	份	日		通受限						
688729	屹唐半导体股份	2025年07月01日	6个月	新股流通受限	8.45	25.36	1,676	14,162.20	42,503.36	
688775	影石创新	2025年06月04日	6个月	新股流通受限	47.27	295.05	295	13,944.65	87,039.75	
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123259	锦浪转02	2025年10月17日	14个交易日	新债流通受限	100.00	100.01	734	73,400.00	73,404.50	

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年08月30日	重大事项	0.01		-	283,500	738,496.28	2,835.00	

			停牌						
--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

注：截止 2025 年 10 月 30 日，本基金合计持有中天 3（在深圳证券交易所退市时的股票简称为\*ST 中天，证券代码为 000540）283,500 股。根据中天金融集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 6 月 29 日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市暨摘牌的公告》，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告〔2017〕13 号）的有关规定，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，决定自 2023 年 6 月 16 日起，对旗下证券投资基金所持有的\*ST 中天（000540.SZ）按每股 0.01 元人民币估值。

根据公司于 2023 年 8 月 28 日发布的《中天金融集团股份有限公司股票转让公告》，公司可在全国中小企业股份转让系统有限责任公司依托原证券公司代办股份转让系统设立并代为管理的两网公司及退市公司板块（以下简称“退市板块”）转让仅限于原在深圳证券交易所（以下简称“深交所”）挂牌交易的流通股份，确权代码（即挂牌退市板块后的股票代码）：400174，开始转让日为 2023 年 8 月 30 日。根据公司于同日发布的《中天金融集团股份有限公司关于公司股票挂牌当日即暂停转让的公告》，因公司正在进行重整事项，经向全国股转公司申请，公司股票自 2023 年 8 月 30 日起暂停转让。

### 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 10 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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 10 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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 10 月 30 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 202 5年 10 月 30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1- 5 年	5 年 以上	不计息	合计
资 产							

货币资金	10,260,185.36	-	-	-	-	-	10,260,185.36
结算备付金	3,964,733.17	-	-	-	-	-	3,964,733.17
存出保证金	177,556.30	-	-	-	-	1,096,080.00	1,273,636.30
交易性金融资产	123,601.66	127,160.43	12,696,988.16	-	-	329,664,581.23	342,612,331.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,855,568.61	2,855,568.61

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	11,515.50	-	-	-	-	1,286,923.35	1,298,438.85
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	14,537,591.99	127,160.43	12,696,988.16	-	-	334,903,153.19	362,264,893.77
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	-	-	-	-	-	4,098,821.84	4,098,821.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	234,133.75	234,133.75
应付托管费	-	-	-	-	-	46,826.73	46,826.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	53,065.03	53,065.03
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-	1.16	1.16
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	196,391.47	196,391.47
负债总计	-	-	-	-	-	4,629,239.98	4,629,239.98
利率敏感度缺口	14,537,591.99	127,160.43	12,696,988.16	-	-	330,273,913.21	357,635,653.79
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	7,945,916.30	-	-	-	-	-	7,945,916.30

资金							
结算备付金	1,410,877.00	-	-	-	-	-	1,410,877.00
存出保证金	152,390.02	-	-	-	-	851,310.00	1,003,700.02
交易性金融资产	1,630,577.97	-	17,453,479.97	-	-	369,947,187.06	389,031,245.00
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	51,232.62	-	-	-	-	557,110.15	608,342.77
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,190,993.91	-	17,453,479.97	-	-	371,355,607.21	400,000,081.09
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回	-	-	-	-	-	-	-

购金融资产款								
应付清算款	-	-	-	-	-	0.73	0.73	
应付赎回款	-	-	-	-	-	464,851.50	464,851.50	
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	178,126.83	178,126.83	
应付托管费	-	-	-	-	-	35,625.37	35,625.37	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,546.79	21,546.79	
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	-	-	-	-	-	249,519.62	249,519.62
负债总计	-	-	-	-	-	949,670.84	949,670.84
利率敏感度缺口	11,190,993.91	-	17,453,479.97	-	-	370,405,936.37	399,050,410.25

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	<p>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;</p> <p>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;</p> <p>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;</p> <p>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</p>
----	--

	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 10 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	15,719.22	23,380.78
基准利率增加 25 个基点	-15,677.67	-23,308.95	

#### 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 10 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产 - 股票投资	329,664,581.23	92.18	369,947,187.06	92.71
交易性金融资产 - 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 - 债券投资	12,947,750.25	3.62	19,084,057.94	4.78
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	342,612,331.48	95.80	389,031,245.00	97.49

##### 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 10 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上涨 5%	16,906,641.56	18,328,975.13
	中证 500 指数下跌 5%	-16,906,641.56	-18,328,975.13

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 10 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	329,230,480.48	369,944,352.06
第二层次	12,594,484.80	19,084,057.94
第三层次	787,366.20	2,835.00
合计	342,612,331.48	389,031,245.00

###### 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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 10 月 30 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,835.00	2,835.00
当期购买	-	346,646.52	346,646.52
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	437,884.68	437,884.68
其中：计入损益的利得或损失	-	437,884.68	437,884.68
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	787,366.20	787,366.20
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	437,884.68	437,884.68
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,012,308.16	1,012,308.16
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,009,473.16	1,009,473.16
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,835.00	2,835.00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动—公允价值变动损益	-	-	-

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股权	2,835.00	上市公司比较法	折现率	0.2	负相关
限售股票	784,531.20	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.1972-2.6919	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股权	2,835.00	上市公司比较法	折现率	0.2	负相关

#### 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	815,933.76	0.24
	其中：股票	815,933.76	0.24
2	基金投资	306,738,457.92	89.99
3	固定收益投资	12,516,921.97	3.67
	其中：债券	12,516,921.97	3.67
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,234,935.45	5.35
8	其他各项资产	2,570,114.75	0.75
9	合计	340,876,363.85	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	303,150.56	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	440,225.76	0.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,694.44	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	43,028.00	0.01
K	房地产业	2,835.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	815,933.76	0.24

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末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	600930	华电新能源集团	70,549	440,225.76	0.13
2	301656	联合动力	3,235	82,363.10	0.02
3	688775	影石创新	295	69,295.50	0.02
4	601198	东兴证券	3,100	43,028.00	0.01
5	688729	屹唐半导体股份	1,676	40,693.28	0.01
6	301678	新恒汇	382	24,532.04	0.01
7	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
8	301590	优优绿能	73	12,942.90	0.00
9	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
10	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
11	603049	中策橡胶	174	9,735.30	0.00
12	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
13	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
14	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
15	601026	道生天合材料科技	451	6,440.28	0.00
16	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
17	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
18	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00

19	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
20	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
21	400174	中天 3	283,500	2,835.00	0.00

## 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	688521	芯原微电子	1,631,789.11	0.49
2	688525	佰维存储	1,382,644.67	0.41
3	688099	晶晨半导体	968,752.97	0.29
4	300476	胜宏科技	863,110.00	0.26
5	688002	睿创微纳	857,559.94	0.26
6	603893	瑞芯微	802,880.00	0.24
7	002850	科达利	725,288.00	0.22
8	688385	复旦微电	639,637.31	0.19
9	688122	西部超导	565,389.37	0.17
10	688065	凯赛生物	552,438.22	0.17
11	300857	协创数据	465,856.00	0.14
12	603345	安井食品	406,690.00	0.12
13	688568	中科星图公司	402,097.05	0.12
14	603728	鸣志电器	376,129.00	0.11
15	002821	凯莱英	364,617.00	0.11
16	300454	深信服	340,491.00	0.10
17	300573	兴齐眼药	327,853.00	0.10
18	603486	科沃斯	316,046.00	0.09
19	301536	星辰科技	291,018.00	0.09
20	002294	信立泰	283,344.00	0.08

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	300476	胜宏科技	7,153,118.00	2.14
2	000988	华工科技	2,861,537.00	0.86

3	300450	先导智能	2,081,231.00	0.62
4	002558	巨人网络	1,861,485.00	0.56
5	002850	科达利	1,846,882.00	0.55
6	300857	协创数据	1,800,213.00	0.54
7	300207	欣旺达	1,763,668.00	0.53
8	002837	英维克	1,747,815.00	0.52
9	002156	通富微电	1,702,521.00	0.51
10	300803	指南针	1,686,755.10	0.51
11	300339	润和软件	1,665,462.00	0.50
12	002738	中矿资源	1,628,758.00	0.49
13	688072	拓荆科技	1,586,066.13	0.48
14	002195	岩山科技	1,527,720.05	0.46
15	002340	格林美	1,515,014.00	0.45
16	002294	信立泰	1,466,696.00	0.44
17	002517	恺英网络	1,441,409.00	0.43
18	000933	神火股份	1,431,916.00	0.43
19	300454	深信服	1,429,913.00	0.43
20	000426	兴业银锡	1,386,787.00	0.42

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	26,126,623.91
卖出股票收入（成交）总额	205,078,539.96

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,515,843.35	3.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,078.62	0.00
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-

10	其他	-	-
11	合计	12,516,921.97	3.75

### 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

金额单位：人民币元

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

### 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则, 充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征, 运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险, 如大额申购赎回等, 以降低交易成本和组合风险, 提高投资效率。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

### 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	563750	中证 500ETF 汇添富	交易型开放式	298,616,100.00	306,738,457.92	91.96	是

### 8.13 投资组合报告附注

#### 8.13.1

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

#### 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	1,589,948.34
2	应收清算款	305,258.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	674,907.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,570,114.75

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

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

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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

## § 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	329,664,581.23	91.00
	其中：股票	329,664,581.23	91.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,947,750.25	3.57
	其中：债券	12,947,750.25	3.57
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,224,918.53	3.93
8	其他各项资产	5,427,643.76	1.50
9	合计	362,264,893.77	100.00

## 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	711,262.00	0.20
B	采矿业	11,976,258.00	3.35
C	制造业	217,206,914.67	60.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,494,482.65	2.93
E	建筑业	2,741,175.00	0.77
F	批发和零售业	6,085,219.56	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	4,791,132.30	1.34
H	住宿和餐饮业	696,784.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,446,869.04	7.95
J	金融业	29,249,790.35	8.18
K	房地产业	4,115,379.81	1.15
L	租赁和商务服务业	2,313,282.60	0.65
M	科学研究和技术服务业	2,260,054.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	1,392,466.32	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	472,484.00	0.13
Q	卫生和社会工作	1,272,733.24	0.36
R	文化、体育和娱乐业	3,425,753.00	0.96
S	综合	1,189,518.00	0.33
	合计	328,841,558.54	91.95

## 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

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	345,371.48	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	445,869.68	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	28,946.53	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,835.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	823,022.69	0.23

## 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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	300476	胜宏科技	21,600	7,097,760.00	1.98
2	000988	华工科技	35,900	3,004,830.00	0.84

3	300450	先导智能	39,200	2,324,560.00	0.65
4	688521	芯原微电子	12,642	2,055,589.20	0.57
5	002156	通富微电	43,400	1,939,112.00	0.54
6	300207	欣旺达	52,800	1,932,480.00	0.54
7	600580	卧龙电驱	39,080	1,900,851.20	0.53
8	300803	指南针	12,790	1,860,305.50	0.52
9	600988	赤峰黄金	59,500	1,764,770.00	0.49
10	300339	润和软件	28,500	1,721,970.00	0.48
11	002558	巨人网络	48,400	1,717,716.00	0.48
12	688072	拓荆科技	5,000	1,633,750.00	0.46
13	002195	岩山科技	203,001	1,601,677.89	0.45
14	600487	亨通光电	70,500	1,588,365.00	0.44
15	688525	佰维存储	11,600	1,574,004.00	0.44
16	002340	格林美	183,200	1,573,688.00	0.44
17	002837	英维克	20,800	1,525,264.00	0.43
18	600021	上海电力	50,300	1,518,557.00	0.42
19	600143	金发科技	75,400	1,510,262.00	0.42
20	601168	西部矿业	59,600	1,472,716.00	0.41
21	000831	中国稀土	26,500	1,471,280.00	0.41
22	002738	中矿资源	25,820	1,469,158.00	0.41
23	002517	恺英网络	61,100	1,438,905.00	0.40
24	300857	协创数据	8,600	1,434,308.00	0.40
25	000933	神火股份	56,300	1,417,634.00	0.40
26	300604	长川科	15,800	1,390,400.00	0.39

		技			
27	603893	瑞芯微	7,500	1,388,400.00	0.39
28	601555	东吴证 券	142,090	1,388,219.30	0.39
29	688122	西部超 导	16,271	1,374,085.95	0.38
30	000426	兴业银 锡	44,400	1,356,420.00	0.38
31	002532	天山铝 业	98,300	1,334,914.00	0.37
32	601162	天风证 券	253,700	1,331,925.00	0.37
33	600839	四川长 虹	132,000	1,330,560.00	0.37
34	600096	云天化	45,600	1,326,504.00	0.37
35	688027	科大国 盾量子	2,200	1,317,800.00	0.37
36	002966	苏州银 行	159,740	1,298,686.20	0.36
37	688120	华海清 科	8,815	1,294,659.05	0.36
38	600157	永泰能 源	794,000	1,294,220.00	0.36
39	002436	兴森科 技	60,400	1,281,688.00	0.36
40	002008	大族激 光	30,100	1,278,046.00	0.36
41	301308	江波龙	4,500	1,273,500.00	0.36
42	002273	水晶光 电	49,681	1,247,489.91	0.35
43	300395	菲利华	14,931	1,243,752.30	0.35
44	600549	厦门钨 业	34,000	1,242,700.00	0.35
45	600895	张江高 科	27,700	1,237,082.00	0.35
46	689009	九号公 司	20,500	1,230,615.00	0.34
47	300115	长盈精 密	33,900	1,230,570.00	0.34
48	300136	信维通 信	34,600	1,228,300.00	0.34
49	002261	拓维信 息	35,900	1,220,959.00	0.34

50	600885	宏发股份	41,685	1,214,700.90	0.34
51	002202	金风科技	74,000	1,212,120.00	0.34
52	600392	盛和资源	50,160	1,207,852.80	0.34
53	002850	科达利	6,800	1,201,016.00	0.34
54	600673	东阳光	53,800	1,189,518.00	0.33
55	002851	麦格米特	15,600	1,183,572.00	0.33
56	688235	百济神州	4,200	1,183,560.00	0.33
57	000066	中国长城	69,200	1,175,016.00	0.33
58	688777	中控技术	22,567	1,173,484.00	0.33
59	002797	第一创业	150,200	1,170,058.00	0.33
60	688469	芯联集成	179,680	1,144,561.60	0.32
61	301358	湖南裕能	16,200	1,144,530.00	0.32
62	002281	光迅科技	17,305	1,138,322.90	0.32
63	000021	深科技	39,000	1,137,240.00	0.32
64	002353	杰瑞股份	21,952	1,134,479.36	0.32
65	002185	华天科技	91,600	1,123,932.00	0.31
66	002138	顺络电子	28,800	1,123,200.00	0.31
67	600699	均胜电子	35,200	1,117,600.00	0.31
68	688002	睿创微纳	13,155	1,116,464.85	0.31
69	300223	北京君正	12,100	1,112,232.00	0.31
70	002294	信立泰	19,900	1,104,450.00	0.31
71	601099	太平洋	243,600	1,098,636.00	0.31
72	300073	当升科技	15,600	1,092,000.00	0.31
73	603659	璞泰来	38,200	1,090,610.00	0.30
74	688213	思特威	10,000	1,083,500.00	0.30

		电子科 技			
75	600879	航天电 子	94,300	1,064,647.00	0.30
76	002472	双环传 动	24,200	1,046,892.00	0.29
77	603228	景旺电 子	14,101	1,043,615.01	0.29
78	688099	晶晨半 导体	11,964	1,040,868.00	0.29
79	300454	深信服	9,000	1,037,700.00	0.29
80	688608	恒玄科 技	4,250	1,035,640.00	0.29
81	688249	晶合集 成	28,720	1,034,781.60	0.29
82	300748	金力永 磁	24,580	1,034,080.60	0.29
83	600536	中国软 件	20,160	1,030,176.00	0.29
84	000783	长江证 券	118,600	1,023,518.00	0.29
85	002130	沃尔核 材	36,000	1,017,360.00	0.28
86	688183	生益电 子	9,000	1,011,960.00	0.28
87	601615	明阳智 能	64,900	1,006,599.00	0.28
88	601108	财通证 券	116,150	1,003,536.00	0.28
89	300346	南大光 电	24,700	1,000,597.00	0.28
90	300017	网宿科 技	87,400	994,612.00	0.28
91	300054	鼎龙股 份	26,800	987,580.00	0.28
92	600352	浙江龙 盛	93,000	981,150.00	0.27
93	002595	豪迈科 技	14,300	965,965.00	0.27
94	603129	春风动 力	3,800	960,678.00	0.27
95	300458	全志科 技	20,600	958,724.00	0.27

96	600109	国金证 券	92,900	950,367.00	0.27
97	300724	捷佳伟 创	9,900	940,401.00	0.26
98	600118	中国卫 星	21,100	940,005.00	0.26
99	300037	新宙邦	18,740	937,187.40	0.26
100	601717	中创智 领	38,600	936,436.00	0.26
101	000878	云南铜 业	50,100	930,357.00	0.26
102	603606	东方电 缆	14,700	919,632.00	0.26
103	603979	金诚信	13,400	906,242.00	0.25
104	601665	齐鲁银 行	153,900	904,932.00	0.25
105	300496	中科创 达	13,200	904,728.00	0.25
106	603179	新泉股 份	12,200	903,532.00	0.25
107	603087	甘李药 业	12,900	901,710.00	0.25
108	601198	东兴证 券	69,300	896,742.00	0.25
109	002085	万丰奥 威	53,100	889,425.00	0.25
110	688361	中科飞 测	7,528	888,228.72	0.25
111	002414	高德红 外	61,000	872,300.00	0.24
112	601233	桐昆股 份	60,200	868,084.00	0.24
113	300251	光线传 媒	52,400	866,172.00	0.24
114	000960	锡业股 份	35,300	862,379.00	0.24
115	600079	人福医 药	40,800	861,696.00	0.24
116	000932	华菱钢 铁	148,180	860,925.80	0.24
117	300012	华测检 测	60,100	855,223.00	0.24
118	300058	蓝色光	126,460	854,869.60	0.24

		标			
119	601696	中银证 券	59,600	852,280.00	0.24
120	002080	中材科 技	24,000	847,920.00	0.24
121	002465	海格通 信	71,000	847,740.00	0.24
122	300474	景嘉微	11,250	847,237.50	0.24
123	002410	广联达	59,000	846,060.00	0.24
124	002078	太阳纸 业	59,900	845,189.00	0.24
125	002409	雅克科 技	10,200	844,764.00	0.24
126	600298	安琪酵 母	21,700	843,479.00	0.24
127	688578	艾力斯 医药科 技	8,000	843,040.00	0.24
128	300373	扬杰科 技	11,700	839,943.00	0.23
129	000893	亚钾国 际	19,800	839,520.00	0.23
130	600363	联创光 电	13,000	836,030.00	0.23
131	000034	神州数 码	20,300	835,142.00	0.23
132	688220	翱捷科 技	8,916	834,359.28	0.23
133	601128	常熟银 行	118,496	834,211.84	0.23
134	000728	国元证 券	93,600	833,976.00	0.23
135	603160	汇顶科 技	9,900	833,283.00	0.23
136	300002	神州泰 岳	70,100	827,180.00	0.23
137	002673	西部证 券	95,800	826,754.00	0.23
138	002624	完美世 界	48,500	822,560.00	0.23
139	300003	乐普医 疗	47,000	822,030.00	0.23
140	300024	机器人	44,800	818,944.00	0.23

141	002065	东华软件	80,200	810,020.00	0.23
142	601577	长沙银行	86,200	806,832.00	0.23
143	688617	惠泰医疗	2,981	800,249.45	0.22
144	300757	罗博特科	3,600	799,200.00	0.22
145	002155	湖南黄金	39,110	793,933.00	0.22
146	600873	梅花生物	71,400	791,112.00	0.22
147	600141	兴发集团	27,640	787,187.20	0.22
148	600884	杉杉股份	56,300	776,377.00	0.22
149	002223	鱼跃医疗	21,500	772,280.00	0.22
150	300001	特锐德	26,401	765,629.00	0.21
151	688385	复旦微电	11,536	764,606.08	0.21
152	300919	中伟股份	16,700	762,522.00	0.21
153	000423	东阿阿胶	16,100	756,378.00	0.21
154	601933	永辉超市	162,200	752,608.00	0.21
155	600497	驰宏锌锗	109,200	748,020.00	0.21
156	603596	伯特利	15,200	747,992.00	0.21
157	002444	巨星科技	25,600	744,704.00	0.21
158	603486	科沃斯	8,200	741,280.00	0.21
159	000623	吉林敖东	34,200	738,378.00	0.21
160	688180	君实生物	19,274	735,688.58	0.21
161	000750	国海证券	159,750	731,655.00	0.20
162	002821	凯莱英	7,100	727,963.00	0.20
163	000733	振华科技	13,900	723,078.00	0.20
164	000009	中国宝	64,540	720,911.80	0.20

		安			
165	688676	海南金 盘智能 科技	9,800	717,948.00	0.20
166	000997	新大 陆	25,800	704,082.00	0.20
167	600171	上海贝 岭	20,300	699,132.00	0.20
168	688772	珠海冠 宇电池	24,299	694,708.41	0.19
169	605589	圣泉集 团	24,200	694,298.00	0.19
170	605358	立昂微	19,200	688,896.00	0.19
171	300763	锦浪科 技	8,600	688,000.00	0.19
172	300383	光环新 网	51,400	686,704.00	0.19
173	600498	烽火通 信	27,300	684,957.00	0.19
174	600060	海信视 像	28,000	679,000.00	0.19
175	002683	广东宏 大	16,300	677,428.00	0.19
176	600369	西南证 券	142,500	675,450.00	0.19
177	601990	南京证 券	79,000	673,080.00	0.19
178	300142	沃森生 物	57,200	672,672.00	0.19
179	600862	中航高 科	29,901	671,576.46	0.19
180	600909	华安证 券	100,270	670,806.30	0.19
181	000400	许继电 气	25,500	667,845.00	0.19
182	300285	国瓷材 料	28,500	664,050.00	0.19
183	600637	东方明 珠	72,107	661,942.26	0.19
184	000528	柳工	57,700	656,626.00	0.18
185	600704	物产中 大	111,300	648,879.00	0.18
186	603605	珀莱雅	8,500	648,465.00	0.18

187	600208	衢州发展	152,000	646,000.00	0.18
188	688052	纳芯微电子	3,653	645,083.27	0.18
189	688065	凯赛生物	13,001	644,719.59	0.18
190	002939	长城证券	57,700	640,470.00	0.18
191	600153	建发股份	62,200	638,794.00	0.18
192	601611	中国核建	43,100	636,156.00	0.18
193	300390	天华新能	20,740	634,851.40	0.18
194	300677	英科医疗	16,140	634,786.20	0.18
195	000887	中鼎股份	28,200	634,782.00	0.18
196	300627	华测导航	19,520	634,400.00	0.18
197	000683	博源化工	93,000	630,540.00	0.18
198	002841	视源股份	14,900	629,227.00	0.18
199	002064	华峰化学	70,900	626,756.00	0.18
200	002056	横店东磁	29,100	626,523.00	0.18
201	600563	法拉电子	4,801	624,514.08	0.17
202	601216	君正集团	120,600	623,502.00	0.17
203	002044	美年健康	111,900	623,283.00	0.17
204	688017	绿的谐波	3,895	622,888.40	0.17
205	002318	久立特材	24,400	622,200.00	0.17
206	002007	华兰生物	39,200	620,144.00	0.17
207	600177	雅戈尔	82,600	618,674.00	0.17
208	002653	海思科	12,000	618,000.00	0.17
209	601997	贵阳银	104,500	615,505.00	0.17

		行			
210	600521	华海药业	32,300	606,594.00	0.17
211	688778	厦钨新能源	7,166	606,243.60	0.17
212	600516	方大炭素	100,700	606,214.00	0.17
213	688568	中科星图公司	14,564	605,134.20	0.17
214	601231	环旭电子	23,500	603,950.00	0.17
215	600737	中粮糖业	38,200	599,358.00	0.17
216	000729	燕京啤酒	50,400	596,232.00	0.17
217	300699	光威复材	20,800	590,096.00	0.16
218	002203	海亮股份	49,100	588,709.00	0.16
219	600155	华创云信	79,500	583,530.00	0.16
220	601179	中国西电	73,300	579,070.00	0.16
221	002926	华西证券	56,300	578,201.00	0.16
222	000723	美锦能源	110,200	577,448.00	0.16
223	001696	宗申动力	24,600	575,394.00	0.16
224	688188	上海柏楚电子科技	4,094	568,451.90	0.16
225	002152	广电运通	44,400	568,320.00	0.16
226	000415	渤海租赁	154,700	567,749.00	0.16
227	600486	扬农化工	8,690	563,198.90	0.16
228	601212	白银有色	105,900	562,329.00	0.16
229	000519	中兵红箭	29,900	552,253.00	0.15
230	000830	鲁西化工	40,993	552,175.71	0.15

231	688702	盛科通信	4,400	550,000.00	0.15
232	300567	精测电子	7,000	549,430.00	0.15
233	600499	科达制造	41,100	546,630.00	0.15
234	300751	迈为股份	5,000	543,800.00	0.15
235	000039	中集集团	65,800	542,850.00	0.15
236	603298	杭叉集团	18,700	541,552.00	0.15
237	600765	中航重机	33,820	541,458.20	0.15
238	300679	电连技术	10,600	540,706.00	0.15
239	600435	北方导航	37,800	539,784.00	0.15
240	000559	万向钱潮	47,200	538,552.00	0.15
241	688538	和辉光电	197,831	538,100.32	0.15
242	000703	恒逸石化	78,600	536,838.00	0.15
243	603345	安井食品	7,300	533,703.00	0.15
244	600170	上海建工	190,500	533,400.00	0.15
245	603939	益丰药房	21,624	533,031.60	0.15
246	603816	顾家家居	17,600	532,928.00	0.15
247	601958	金铂股份	34,600	530,418.00	0.15
248	000060	中金岭南	93,500	530,145.00	0.15
249	002756	永兴材料	11,560	529,679.20	0.15
250	600038	中直股份	14,700	529,641.00	0.15
251	000738	航发控制	28,200	529,596.00	0.15
252	603568	伟明环保	24,399	528,970.32	0.15

253	002262	恩华药业	21,800	528,868.00	0.15
254	600398	海澜之家	85,800	528,528.00	0.15
255	600316	洪都航空	15,401	526,714.20	0.15
256	002603	以岭药业	29,900	523,549.00	0.15
257	600820	隧道股份	78,700	523,355.00	0.15
258	300765	新诺威	15,100	522,007.00	0.15
259	600985	淮北矿业	38,500	521,675.00	0.15
260	600095	湘财股份	40,900	519,839.00	0.15
261	002430	杭氧股份	17,600	519,552.00	0.15
262	600348	华阳股份	64,450	519,467.00	0.15
263	688301	奕瑞科技股份	4,639	518,083.52	0.14
264	600008	首创环保	157,440	516,403.20	0.14
265	600312	平高电气	29,100	515,943.00	0.14
266	300573	兴齐眼药	6,180	514,917.60	0.14
267	600801	华新水泥	24,000	512,880.00	0.14
268	601608	中信重工	65,500	511,555.00	0.14
269	300623	捷捷微电	17,800	511,216.00	0.14
270	600562	国睿科技	17,800	507,300.00	0.14
271	002958	青农商行	158,800	506,572.00	0.14
272	603156	养元饮品	18,000	506,160.00	0.14
273	002385	大北农	122,900	505,119.00	0.14
274	000629	钒钛股份	166,100	504,944.00	0.14
275	300487	蓝晓科	9,050	501,008.00	0.14

		技			
276	600863	内蒙华电	116,600	500,214.00	0.14
277	601991	大唐发电	132,900	499,704.00	0.14
278	002500	山西证券	77,010	496,714.50	0.14
279	300558	贝达药业	9,000	496,170.00	0.14
280	002429	兆驰股份	80,900	495,917.00	0.14
281	002244	滨江集团	44,500	493,950.00	0.14
282	600529	山东药玻	23,700	493,908.00	0.14
283	600901	江苏金租	82,800	492,660.00	0.14
284	603379	三美股份	8,700	491,550.00	0.14
285	002739	万达电影	45,300	491,505.00	0.14
286	000155	川能动力	39,600	489,456.00	0.14
287	600166	福田汽车	169,800	489,024.00	0.14
288	688114	华大智造	7,505	487,749.95	0.14
289	603077	和邦生物	220,900	481,562.00	0.13
290	601880	辽港股份	268,000	479,720.00	0.13
291	000636	风华高科	28,900	479,451.00	0.13
292	600390	五矿资本	80,400	477,576.00	0.13
293	600763	通策医疗	11,168	476,650.24	0.13
294	603338	浙江鼎力	9,000	474,300.00	0.13
295	002432	九安医疗	11,900	473,263.00	0.13
296	002607	中公教育	176,300	472,484.00	0.13

297	002568	百润股份	18,800	466,992.00	0.13
298	600282	南钢股份	88,100	466,930.00	0.13
299	000513	丽珠集团	12,964	466,833.64	0.13
300	600380	健康元	39,208	465,791.04	0.13
301	688582	芯动联科	7,200	465,120.00	0.13
302	300146	汤臣倍健	36,500	463,915.00	0.13
303	000591	太阳能	98,000	462,560.00	0.13
304	603290	斯达半导	4,300	461,175.00	0.13
305	600132	重庆啤酒	8,600	460,100.00	0.13
306	603737	三棵树	10,584	459,768.96	0.13
307	600998	九州通	90,151	457,967.08	0.13
308	601155	新城控股	32,293	457,591.81	0.13
309	601666	平煤股份	53,100	455,598.00	0.13
310	600970	中材国际	47,200	453,120.00	0.13
311	688728	格科微有限公司	27,904	451,486.72	0.13
312	300144	宋城演艺	56,200	449,038.00	0.13
313	603927	中科软	20,756	448,952.28	0.13
314	601001	晋控煤业	29,900	448,500.00	0.13
315	002312	川发龙蟒	40,500	446,310.00	0.12
316	603225	新凤鸣	27,220	444,230.40	0.12
317	600995	南网储能	34,300	444,185.00	0.12
318	000987	越秀资本	53,825	441,903.25	0.12
319	600378	昊华科技	13,800	438,564.00	0.12
320	002025	航天电器	9,800	437,570.00	0.12

321	300676	华大基因	9,000	437,400.00	0.12
322	600126	杭钢股份	48,320	435,846.40	0.12
323	600583	海油工程	79,000	433,710.00	0.12
324	601016	节能风电	138,850	431,823.50	0.12
325	688234	天岳先进	6,078	431,538.00	0.12
326	600329	达仁堂	10,200	430,134.00	0.12
327	603728	鸣志电器	6,000	429,540.00	0.12
328	002670	国盛证券	20,698	427,827.66	0.12
329	002773	康弘药业	13,200	427,680.00	0.12
330	002984	森麒麟	22,180	426,077.80	0.12
331	603885	吉祥航空	31,400	425,470.00	0.12
332	601000	唐山港	105,930	424,779.30	0.12
333	600816	建元信托	140,700	422,100.00	0.12
334	601456	国联民生	37,400	420,750.00	0.12
335	002423	中粮资本	32,900	420,133.00	0.12
336	603589	口子窖	12,862	416,600.18	0.12
337	000050	深天马 A	43,900	416,172.00	0.12
338	000921	海信家电	16,511	415,086.54	0.12
339	601636	旗滨集团	57,500	414,575.00	0.12
340	000062	深圳华强	15,000	413,400.00	0.12
341	600739	辽宁成大	32,800	411,640.00	0.12
342	688278	特宝生物	5,800	410,698.00	0.11
343	600004	白云机场	42,300	410,310.00	0.11
344	601918	新集能	55,500	407,370.00	0.11

		源			
345	600535	天士力	26,700	406,374.00	0.11
346	603688	石英股份	9,650	406,072.00	0.11
347	688318	财富趋势	2,800	406,056.00	0.11
348	600685	中船防务	14,700	405,573.00	0.11
349	600511	国药股份	13,502	401,009.40	0.11
350	600655	豫园股份	69,600	400,896.00	0.11
351	300735	光弘科技	13,700	400,588.00	0.11
352	600483	福能股份	39,700	400,573.00	0.11
353	600872	中炬高新	22,300	400,285.00	0.11
354	000563	陕国投 A	109,620	400,113.00	0.11
355	002439	启明星辰	26,000	399,100.00	0.11
356	300601	康泰生物	23,900	398,652.00	0.11
357	600517	国网英大	61,300	398,450.00	0.11
358	601966	玲珑轮胎	26,200	397,716.00	0.11
359	600859	王府井	28,102	397,362.28	0.11
360	601333	广深铁路	121,200	396,324.00	0.11
361	600131	国网信通	21,500	394,310.00	0.11
362	603000	人民网	19,800	392,832.00	0.11
363	600325	华发股份	78,700	387,204.00	0.11
364	002266	浙富控股	93,300	387,195.00	0.11
365	600848	上海临港	34,200	386,118.00	0.11
366	600546	山煤国际	35,400	384,444.00	0.11
367	000598	兴蓉环	53,300	380,029.00	0.11

		境			
368	000958	电投产融	57,700	379,089.00	0.11
369	600977	中国电影	26,700	378,339.00	0.11
370	003031	中瓷电子	6,460	377,587.00	0.11
371	601598	中国外运	56,300	376,084.00	0.11
372	002507	涪陵榨菜	28,850	375,915.50	0.11
373	002120	韵达股份	51,800	375,550.00	0.11
374	603341	龙旗科技	8,300	374,994.00	0.10
375	688363	华熙生物	7,000	374,850.00	0.10
376	002299	圣农发展	22,200	374,292.00	0.10
377	601399	国机重装	103,100	374,253.00	0.10
378	000709	河钢股份	147,800	373,934.00	0.10
379	000027	深圳能源	50,960	372,517.60	0.10
380	601866	中远海发	140,500	372,325.00	0.10
381	600598	北大荒	25,400	371,602.00	0.10
382	000403	派林生物	23,770	370,812.00	0.10
383	600867	通化东宝	42,000	369,600.00	0.10
384	000951	中国重汽	21,000	367,080.00	0.10
385	603899	晨光股份	13,200	365,508.00	0.10
386	603650	彤程新材	8,600	364,296.00	0.10
387	002831	裕同科技	13,280	363,872.00	0.10
388	600663	陆家嘴	42,200	362,498.00	0.10
389	300212	易华录	17,980	357,802.00	0.10
390	688561	奇安信	9,800	357,798.00	0.10

		集团			
391	601156	东航物流	22,700	356,163.00	0.10
392	600578	京能电力	71,800	356,128.00	0.10
393	600754	锦江酒店	16,300	355,014.00	0.10
394	688297	中航无人机	7,224	354,698.40	0.10
395	600582	天地科技	59,200	350,464.00	0.10
396	301536	星辰科技	6,000	350,340.00	0.10
397	000825	太钢不锈	81,600	347,616.00	0.10
398	300529	健帆生物	17,100	346,275.00	0.10
399	600808	马钢股份	85,600	344,112.00	0.10
400	000543	皖能电力	40,500	343,035.00	0.10
401	603565	中谷物流	30,000	342,300.00	0.10
402	600258	首旅酒店	23,900	341,770.00	0.10
403	601118	海南橡胶	61,200	339,660.00	0.09
404	000883	湖北能源	69,700	339,439.00	0.09
405	300888	稳健医疗	8,360	338,496.40	0.09
406	603858	步长制药	19,800	338,184.00	0.09
407	300070	碧水源	77,700	337,995.00	0.09
408	600906	财达证券	46,400	337,792.00	0.09
409	688520	神州细胞集团公司	6,320	334,707.20	0.09
410	600271	航天信息	39,700	333,877.00	0.09
410	600528	中铁工业	39,700	333,877.00	0.09

412	688387	中信科移动	48,979	330,608.25	0.09
413	000032	深桑达 A	16,300	329,912.00	0.09
414	600566	济川药业	13,200	326,832.00	0.09
415	600871	石化油服	145,200	326,700.00	0.09
416	601106	中国一重	98,000	325,360.00	0.09
417	688248	南方电网电力科技	6,100	325,069.00	0.09
418	002508	老板电器	16,900	323,973.00	0.09
419	600959	江苏有线	89,400	323,628.00	0.09
420	000739	普洛药业	20,900	320,606.00	0.09
421	300595	欧普康视	19,200	317,184.00	0.09
422	600764	中国海防	10,200	312,732.00	0.09
423	601098	中南传媒	25,700	308,657.00	0.09
424	000967	盈峰环境	45,300	308,040.00	0.09
425	688425	铁建重工	57,149	307,461.62	0.09
426	600707	彩虹股份	51,300	300,618.00	0.08
427	600056	中国医药	26,760	298,909.20	0.08
428	603233	大参林	16,252	296,599.00	0.08
429	000582	北部湾港	33,300	292,707.00	0.08
430	603529	爱玛科技	9,200	292,008.00	0.08
431	600062	华润双鹤	14,900	285,037.00	0.08
432	600968	海油发展	72,700	284,984.00	0.08
433	003022	联泓新科	14,300	284,141.00	0.08

434	002153	石基信息	29,278	283,411.04	0.08
435	688281	华秦科技实业	3,892	280,457.52	0.08
436	601928	凤凰传媒	27,300	273,819.00	0.08
437	688172	燕东微电子股份	10,200	273,258.00	0.08
438	300957	贝泰妮	6,100	271,755.00	0.08
439	301301	川宁生物	23,900	269,114.00	0.08
440	001286	陕西能源	26,800	265,320.00	0.07
441	600606	绿地控股	150,700	265,232.00	0.07
442	002572	索菲亚	20,600	262,238.00	0.07
443	600098	广州发展	37,600	262,072.00	0.07
444	688349	三一重能	8,776	261,349.28	0.07
445	000537	中绿电	29,500	259,305.00	0.07
446	688563	航空材料股份	4,800	256,752.00	0.07
447	301165	锐捷网络	3,380	254,852.00	0.07
448	600373	中文传媒	24,900	253,233.00	0.07
449	000785	居然智家	89,000	251,870.00	0.07
450	601965	中国汽研	14,300	250,250.00	0.07
451	600925	苏能股份	49,200	241,080.00	0.07
452	600295	鄂尔多斯	21,200	240,832.00	0.07
453	600361	创新新材	53,700	240,039.00	0.07
454	601061	中信金属	19,300	237,776.00	0.07
455	603556	海兴电力	7,000	236,950.00	0.07
456	000959	首钢股	55,600	234,076.00	0.07

		份			
457	000898	鞍钢股份	85,300	233,722.00	0.07
458	000937	冀中能源	37,900	231,569.00	0.06
459	603658	安图生物	6,100	231,434.00	0.06
460	002372	伟星新材	22,580	230,993.40	0.06
461	002608	江苏国信	27,000	224,640.00	0.06
462	601568	北元集团	56,790	223,184.70	0.06
463	603786	科博达	2,900	222,285.00	0.06
464	000429	粤高速 A	18,700	219,912.00	0.06
465	600339	中油工程	59,900	219,234.00	0.06
466	600612	老凤祥	4,500	217,260.00	0.06
467	600688	上海石化	78,600	216,150.00	0.06
468	301498	乖宝宠物	2,900	208,423.00	0.06
469	688375	国博电子	2,870	208,075.00	0.06
470	601139	深圳燃气	30,800	206,976.00	0.06
471	600032	浙江新能	25,800	204,852.00	0.06
472	003035	南网能源	40,600	200,970.00	0.06
473	600928	西安银行	47,600	197,540.00	0.06
474	688100	威胜信息	5,200	191,724.00	0.05
475	600720	中交设计	24,600	191,142.00	0.05
476	688032	禾迈股份	1,731	184,489.98	0.05
477	601228	广州港	53,900	184,338.00	0.05
478	688475	萤石网络	5,600	180,992.00	0.05
479	603707	健友股	17,359	172,895.64	0.05

		份			
480	301267	华夏眼科	9,000	172,800.00	0.05
481	601019	山东出版	22,400	170,240.00	0.05
482	688819	天能电池集团股份	4,925	163,854.75	0.05
483	600927	永安期货	10,400	161,408.00	0.05
484	002945	华林证券	9,600	157,824.00	0.04
485	000539	粤电力 A	31,800	157,410.00	0.04
486	002563	森马服饰	28,900	152,303.00	0.04
487	002461	珠江啤酒	15,800	147,414.00	0.04
488	600007	中国国贸	7,200	144,936.00	0.04
489	300140	节能环保	22,200	138,306.00	0.04
490	600299	安迪苏	14,400	136,944.00	0.04
491	001213	中铁特货	31,800	135,150.00	0.04
492	603826	坤彩科技	7,040	128,268.80	0.04
493	601921	浙版传媒	15,900	126,564.00	0.04
494	688153	唯捷创芯	3,100	116,467.00	0.03
495	001389	广合科技	1,400	108,500.00	0.03
496	601858	中国科传	5,700	108,186.00	0.03
497	688295	中复神鹰碳纤维	3,629	98,454.77	0.03
498	601158	重庆水务	20,600	98,262.00	0.03
499	600956	新天绿能	11,033	87,712.35	0.02
500	603868	飞科电器	1,700	60,707.00	0.02

### 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

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	600930	华电新能源集团	70,549	445,869.68	0.12
2	688775	影石创新	295	87,039.75	0.02
3	301656	联合动力	3,235	73,628.60	0.02
4	688729	屹唐半导体股份	1,676	42,503.36	0.01
5	301678	新恒汇	382	25,853.76	0.01
6	603334	丰倍生物	879	21,526.71	0.01
7	301563	云汉芯城	110	17,776.00	0.00
8	603376	大明电子	1,106	13,880.30	0.00
9	301609	山大电力	277	12,908.20	0.00
10	301590	优优绿能	73	12,441.39	0.00
11	301584	建发致新	447	11,170.53	0.00
12	603175	超颖电子	169	9,871.29	0.00
13	603049	中策橡胶	174	9,129.78	0.00
14	603418	友升股份	139	7,443.45	0.00
15	601026	道生天合材料科技	451	7,418.95	0.00
16	301668	昊创瑞通	165	7,367.25	0.00
17	603406	天富龙	153	5,579.91	0.00
18	301575	艾芬达	126	5,496.12	0.00
19	603370	华新精科	82	3,033.18	0.00
20	400174	中天 3	283,500	2,835.00	0.00
21	603317	天味食品	16	182.56	0.00
22	688063	派能科技	1	66.92	0.00

### 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	300476	胜宏科技	5,868,935.00	1.47
2	300450	先导智能	2,694,999.00	0.68
3	000988	华工科技	2,649,210.00	0.66
4	688608	恒玄科技	2,638,075.89	0.66
5	688235	百济神州	2,453,779.32	0.61
6	000933	神火股份	2,354,851.00	0.59
7	002851	麦格米特	2,312,630.00	0.58
8	002837	英维克	2,264,936.50	0.57
9	300454	深信服	2,156,592.00	0.54
10	300458	全志科技	2,069,138.00	0.52
11	002130	沃尔核材	2,042,676.00	0.51
12	688521	芯原微电子	1,999,903.15	0.50
13	300857	协创数据	1,981,597.08	0.50
14	300339	润和软件	1,980,902.00	0.50
15	300803	指南针	1,942,109.00	0.49
16	300346	南大光电	1,892,018.00	0.47
17	300115	长盈精密	1,863,952.00	0.47
18	600363	联创光电	1,853,631.00	0.46
19	002558	巨人网络	1,814,214.00	0.45
20	603893	瑞芯微	1,750,233.00	0.44

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	300476	胜宏科技	7,678,540.00	1.92
2	600418	江淮汽车	4,027,077.00	1.01
3	000988	华工科技	3,951,593.00	0.99
4	002625	光启技术	3,219,853.00	0.81
5	688521	芯原微电子	2,725,361.47	0.68
6	600988	赤峰黄金	2,676,950.00	0.67
7	300339	润和软件	2,616,225.00	0.66
8	002558	巨人网络	2,610,919.00	0.65
9	300450	先导智能	2,608,336.00	0.65
10	300803	指南针	2,520,343.26	0.63
11	002156	通富微电	2,416,491.00	0.61
12	600580	卧龙电驱	2,403,882.00	0.60
13	002384	东山精密	2,360,720.00	0.59
14	300207	欣旺达	2,276,668.00	0.57
15	002340	格林美	2,260,065.00	0.57

16	002195	岩山科技	2,177,451.00	0.55
17	600487	亨通光电	2,168,659.00	0.54
18	601555	东吴证券	2,160,669.00	0.54
19	002517	恺英网络	2,127,607.00	0.53
20	000831	中国稀土	2,114,851.00	0.53

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	376,023,225.24
卖出股票收入（成交）总额	511,215,099.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,485,673.29	3.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	462,076.96	0.13
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	12,947,750.25	3.62

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019773	25 国债 08	101,000	10,177,460.08	2.85
2	019785	25 国债 13	23,000	2,308,213.21	0.65
3	113699	金 25 转	870	137,910.37	0.04

		债			
4	113696	伯 25 转 债	910	127,160.43	0.04
5	127108	太能转 债	1,014	123,601.66	0.03

### 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,以降低交易成本和组合风险,提高投资效率。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

### 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	1,273,636.30
2	应收清算款	2,855,568.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,298,438.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,427,643.76

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

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

#### 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

金额单位：人民币元

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

## § 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 500ETF 联接 (LOF) A	9,857	16,088.57	9,555,839.88	6.03	149,029,193.85	93.97
汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C	11,306	6,922.12	6,993,183.13	8.94	71,268,263.80	91.06
合计	21,163	11,191.54	16,549,023.01	6.99	220,297,457.65	93.01

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	蓝德安	702,600.00	9.64
2	王磊	546,300.00	7.49
3	施丽丽	425,238.00	5.83
4	谢晓明	293,912.00	4.03
5	周伟忠	200,000.00	2.74
6	钟爱民	166,061.00	2.28
7	高明英	137,684.00	1.89
8	周洁	108,300.00	1.49
9	王轶轮	104,512.00	1.43
10	金顶佳	101,900.00	1.40
汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	曹春峰	482,083.00	20.87
2	赵丽妹	200,018.00	8.66
3	欧阳东	150,000.00	6.49
4	郑凯鹏	114,534.00	4.96
5	杨莹	100,000.00	4.33
6	王建华	86,700.00	3.75
7	杨凯	67,500.00	2.92

8	宋汶鲜	54,800.00	2.37
9	王婧靓	50,500.00	2.19
10	程婕	50,029.00	2.17

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

### 9.3 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 500ETF 联接 (LOF) A	11,482.48	0.01
	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C	19.32	0.00
	合计	11,501.80	0.00

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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 500ETF 联接(LOF) A	0
	汇添富中证 500ETF 联接(LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 500ETF 联接(LOF) A	0
	汇添富中证 500ETF 联接(LOF) C	0
	合计	0

### 9.5 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

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 (%)
汇添富中证 500 指数 (LOF) A	10,128	17,137.36	9,555,439.13	5.51	164,011,769.51	94.49
汇添富中证 500 指数 (LOF) C	11,772	7,058.73	5,633,711.87	6.78	77,461,672.40	93.22
合计	21,900	11,719.75	15,189,151.00	5.92	241,473,441.91	94.08

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	蓝德安	1,001,100.00	12.30
2	王磊	546,300.00	6.71
3	施丽丽	425,238.00	5.22
4	谢晓明	293,912.00	3.61
5	郑凯鹏	283,317.00	3.48
6	周伟忠	200,000.00	2.46
7	钟爱民	166,061.00	2.04
8	高明英	137,684.00	1.69
9	苗青	120,200.00	1.48
10	周洁	108,300.00	1.33
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	黄晖	410,915.00	16.71
2	赵丽妹	200,018.00	8.13
3	欧阳东	150,000.00	6.10
4	郑凯鹏	144,428.00	5.87
5	陶晋	110,022.00	4.47
6	杨莹	100,000.00	4.07
7	王建华	86,700.00	3.53
8	杨凯	67,500.00	2.75

9	宋汶鲜	54,800.00	2.23
10	程婕	50,029.00	2.03

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	15,543.01	0.01
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	19.32	0.00
	合计	15,562.33	0.01

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### 9.5 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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产 品份额总量的数量区间 (万份)
吴振翔	公募基金	10~50
	私募资产管理计划	0
	合计	10~50

### 9.6 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,002,700.27 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 08

月 10 日起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

### § 10 开放式基金份额变动 (转型后)

单位：份

项目	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) A	汇添富中证 500ETF 联接 (LOF) C
基金合同生效日 (2025 年 10 月 31 日) 基金份额总额	173,567,208.64	83,095,384.27
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,731,528.86	16,856,692.47
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	24,713,703.77	21,690,629.81
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	158,585,033.73	78,261,446.93

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### § 10 开放式基金份额变动 (转型前)

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份额总额	255,083,544.06	114,915,238.25
本报告期基金总申购份额	72,090,000.77	322,545,435.34
减：本报告期基金总赎回份额	153,606,336.19	354,365,289.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	173,567,208.64	83,095,384.27

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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。

2025 年 2 月 20 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去蒋伟担任的托管部副总经理职务，另有任用。

2025 年 5 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘王鑫担任托管部副总经理。

### 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。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

2025 年 10 月 31 日原“汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)”转型为“汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)”。汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的投资策略请详见 2025 年 10 月 30 日刊登在本公司网站的《汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》。

### 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 (2017 年 08 月 10 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

注: 本报告期内, 基金托管人未受调查或处罚。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注: 本报告期内, 基金托管人相关从业人员未受调查或处罚。

## 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	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	3	231,205,163.87	100.00	40,673.13	100.00	

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 (%)
招商证券	487,299.85	100.00	-	-	-	-	40,541,268.10	100.00

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(%)	
招商证券	3	885,930,275.01	100.00	155,881.18	100.00	

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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
---	------	--------	------	------

商名称	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
招商证券	15,603,557.00	100.00	5,759,000.00	100.00	-	-	-	-

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	汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 招募说明书	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所	2025 年 10 月 31 日
2	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	中国证监会基金电子披露网站,公司网	2025 年 12 月 24 日

	公司的公告	站,深交所,上交所,上证报	
--	-------	---------------	--

### 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部分基金更新法律文件	公司网站,中国证监会基金电子披露网站,上交所,深交所	2025 年 03 月 20 日
3	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数许可使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上证报,上交所,深交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 20 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	上交所,深交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新产品资料概要	上交所,深交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 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
7	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
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告	上交所,深交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 22 日
9	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 16 日
10	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行(中国)有限公司合作关系的公告	上证报,中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025 年 06 月 26 日
11	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	2025 年 07 月 15 日

		电子披露网站,公司网站	
12	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
13	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
14	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
15	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 08 月 15 日
16	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 08 月 15 日
17	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,上证报	2025 年 08 月 29 日
18	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
19	关于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 转型为汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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,上交所,中证报,公司网站	2025 年 10 月 30 日
20	汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 托管协议	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所	2025 年 10 月 30 日
21	汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所	2025 年 10 月 30 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2025 年 8 月 27 日至 2025 年 10 月 16 日	-	172,670,566.79	172,670,566.79	-	-
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。</p>							

## 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 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 募集的文件；

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

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 03 月 31 日