

汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资 基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	21
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	21
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.....	23
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	24
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	25
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	26
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	26
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.....	26
§ 5 托管人报告.....	26
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	26
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.....	27
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.....	27
§ 6 审计报告.....	27
6.1 审计报告的基本信息.....	27
6.2 审计报告的基本内容.....	27
§ 7 年度财务报表.....	29
7.1 资产负债表.....	29
7.2 利润表.....	30
7.3 净资产变动表.....	31
7.4 报表附注.....	33
§ 8 投资组合报告.....	63
8.1 期末基金资产组合情况.....	63

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	63
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.....	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	89
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	91
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.....	91
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.....	91
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.....	91
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.....	91
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	91
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	91
8.12 投资组合报告附注.....	91
§ 9 基金份额持有人信息.....	92
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	92
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	93
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	93
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.....	93
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.....	93
§ 10 开放式基金份额变动.....	94
§ 11 重大事件揭示.....	94
11.1 基金份额持有人大会决议.....	94
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.....	94
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	94
11.4 基金投资策略的改变.....	94
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	94
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	94
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	96
11.8 其他重大事件.....	100
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	102
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.....	102
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	102
§ 13 备查文件目录.....	103
13.1 备查文件目录.....	103
13.2 存放地点.....	103
13.3 查阅方式.....	103

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富上证综合 ETF
场内简称	上证综合
基金主代码	510980
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 22 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	287,798,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 12 月 01 日

注：扩位证券简称：上证指数 ETF 汇添富。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金的股票投资主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资方法，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。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。
业绩比较基准	上证综合指数收益率
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，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588

传真	021-28932998	(010) 66105798
注册地址	上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	鲁伟铭	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年 11 月 22 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	68,504,086.89	27,905,284.00	-2,063,758.73
本期利润	68,264,902.50	42,186,684.40	-5,980,718.86
加权平均基金份额本期利润	0.2261	0.1536	-0.0177
本期加权平均净值利润率	18.49%	14.60%	-1.79%
本期基金份额净值增长率	20.50%	15.72%	-1.75%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	104,571,854.48	50,105,856.60	-4,567,365.98

期末可供分配基金份额利润	0.3634	0.1306	-0.0175
期末基金资产净值	394,289,161.91	436,328,069.89	256,230,634.02
期末基金份额净值	1.3700	1.1369	0.9825
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	37.00%	13.69%	-1.75%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去三个月	2.37%	0.72%	2.22%	0.74%	0.15%	-0.02%
过去六个月	15.69%	0.68%	15.23%	0.70%	0.46%	-0.02%
过去一年	20.50%	0.84%	18.41%	0.85%	2.09%	-0.01%
自基金合同生效起至今	37.00%	1.04%	29.37%	1.05%	7.63%	-0.01%

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

汇添富上证综合ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

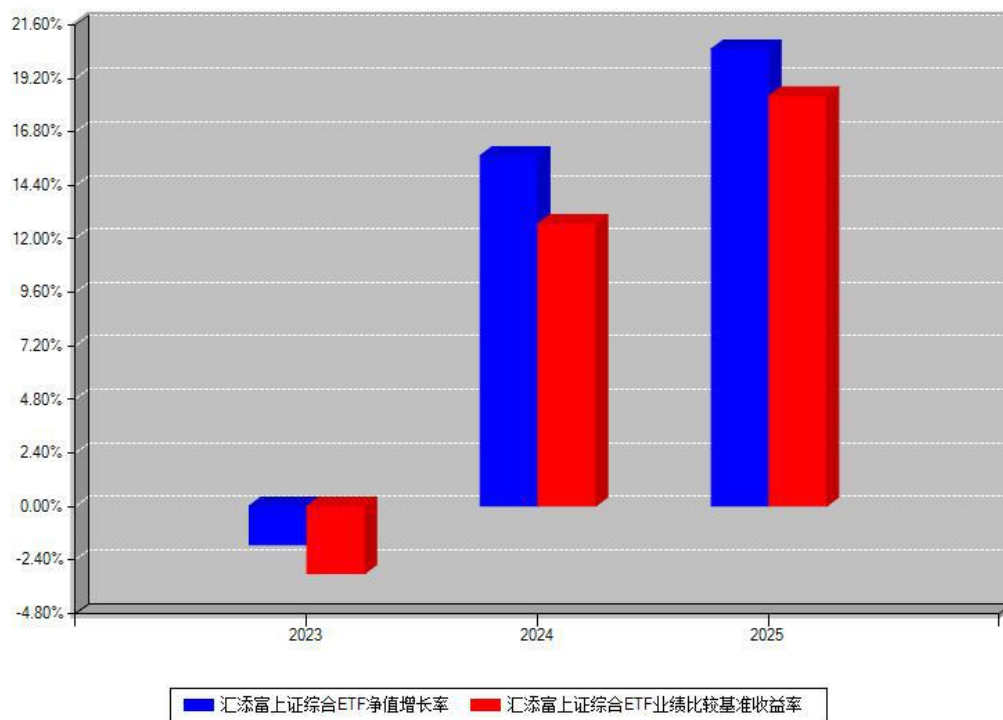


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023年11月22日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

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

汇添富上证综合ETF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2023年11月22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

注：本《基金合同》生效之日为2023年11月22日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

§ 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

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		
孙浩	本基金的基金经理	2023年12月12日	-	5	国籍:中国。学历:北京大学金融硕士。从业资格:证券投资基金从业资格,CFA。从业经历:2020年7月起任汇添富基金管理股份有限公司数量分析师。2023年8月29日至今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。2023年8月29日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023年8月29日至2025年3月18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。2023年8月29日至今

				<p>任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 9 月 28 日至今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。2023 年 11 月 28 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联接基金的基金经理。2023 年 11 月 28 日至今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 12 月 12 日至今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。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指</p>
--	--	--	--	---

				<p>数证券投资基金的基金经理。2024年3月12日至2024年12月26日任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024年3月26日至2025年8月18日任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年4月19日至今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。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年6月4日至2025年8月11日任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024年6月20日至2025年8月18日任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

					<p>2024 年 7 月 9 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2024 年 11 月 18 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 18 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 27 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 10 月 22 日至今任汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2023 年 11 月 22 日	2025 年 03 月 21 日	19	<p>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</p>

				<p>经理、数量投资高级分析师、基金经理助理,现任指数与量化投资部副总监。2010年2月6日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基</p>
--	--	--	--	--

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

					<p>23 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联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</p>
--	--	--	--	--	--

				<p>易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至 2025 年 11 月 10 日任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 22 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

					<p>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。</p> <p>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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。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:3只,离任时间:2025年3月21日、2025年10月30日、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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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,原则上兼任组合同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),公司对兼任组合同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,最长时间窗为 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同间的收益率差异、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

2025 年全年 A 股表现亮眼,上证指数上涨 18.41%。行业层面来看,有色金属、通信、电子和国防军工涨幅居前,食品饮料、煤炭、房地产和交通运输表现相对靠后。风格上,小盘和成长风格占优,大盘和价值风格相对偏弱。

内部环境来看，2025 年 GDP 同比增长 5.0%，圆满完成全年经济增速目标，国民经济顶压前行、向新向优，高质量发展取得新成效。2025 年规模以上工业增加值同比增长 5.9%，装备制造业、高技术制造业增势突出，新质生产力带动作用持续增强。2025 年固定资产投资（不含农户）同比下降 3.8%，分类别看，制造业投资同比增长 0.6%，基础设施投资同比下降 2.2%，房地产开发投资同比下降 17.2%；全年投资整体承压，但高技术产业、新型基础设施投资保持较快增长，12 月房地产投资、销售降幅进一步收窄，在一揽子稳楼市政策支持下，市场筑底企稳迹象显现。2025 年社会消费品零售总额同比增长 3.7%，消费品以旧换新政策加力扩围、绿色智能消费成为主流、服务消费扩容提质，扩内需系列政策落地见效，消费对经济增长的贡献率达到 52%，持续发挥了经济发展主引擎的作用。

外部环境方面，2025 年全球经济温和复苏，主要经济体政策外溢效应趋于缓和。美联储 2025 年累计降息三次共 75 个基点，联邦基金利率回落至 3.50%~3.75% 区间，全球流动性环境改善，美元指数波动趋稳，人民币汇率保持基本稳定，国内货币政策外部约束减轻。中美经贸关系总体平稳，地缘政治扰动仍存，但不确定性较上年收敛，全球产业链、供应链调整更趋理性。

上证指数 ETF 汇添富跟踪上证指数，上证指数是 A 股历史最悠久的股价指数，是宏观经济的晴雨表，经过 2020 年的修订，在新股延迟纳入、剔除风险警示股和纳入科创板证券三个方面进行了全新升级，具有更好的投资属性。本基金采用抽样复制方法，在严控跟踪误差的前提下，通过量化多因子和风险模型来追求稳健适度的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 20.50%，同期业绩比较基准收益率为 18.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，外部需求波动、主要经济体货币政策分化仍是潜在扰动，但国内经济长期向好的基本面没有改变。2025 年 12 月中央政治局会议与中央经济工作会议确立“稳中求进、以进促稳、先立后破”总基调，更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策有望协同发力，扩大内需、化解风险、支持科技创新、壮大民营经济等政策将持续加力显效，政策向宏观经济基本面的传导实效有望逐步显现，宏观经济中长期改善预期持续增强。2026 年 A 股在政策红利下有望维持较好的交投活跃度，随着宏观经济回升向好逐步验证，A 股有望步入盈利修复驱动行情，资本市场长期配置价值进一步凸显，高质量发展与新质生产力主线有望引领市场稳步向好。

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

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

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

3、持续加强稽核工作

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

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_B301 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	汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度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，我们独立于汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计

	意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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上证综合交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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，就可能对汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况</p>

	<p>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上证综合交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <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。</p> <p>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。</p>	
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

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	1,643,268.54	1,148,735.86
结算备付金		308,647.33	179,222.85
存出保证金		3,523.96	9,553.68
交易性金融资产	7.4.7.2	392,859,263.81	435,196,586.49
其中：股票投资		392,859,263.81	435,196,586.49
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	263,553.64

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		394,814,703.64	436,797,652.52
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		64,897.34	42,756.89
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		200,323.80	189,263.28
应付托管费		40,064.77	37,852.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	220,255.82	199,709.82
负债合计		525,541.73	469,582.63
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	287,798,000.00	383,798,000.00
未分配利润	7.4.7.9	106,491,161.91	52,530,069.89
净资产合计		394,289,161.91	436,328,069.89
负债和净资产总计		394,814,703.64	436,797,652.52

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3700 元，基金份额总额 287,798,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日 至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年01月01日 至2024年12月31 日
一、营业总收入		70,649,350.55	44,104,895.38
1.利息收入		6,186.68	14,575.18
其中：存款利息收入	7.4.7.10	6,186.68	14,575.18

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）		70,822,668.09	28,593,489.73
其中：股票投资收益	7.4.7.11	62,062,018.73	22,126,786.09
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	8,760,649.36	6,466,703.64
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	-239,184.39	14,281,400.40
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	59,680.17	1,215,430.07
减：二、营业总支出		2,384,448.05	1,918,210.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,849,358.88	1,460,566.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	369,871.80	292,113.25
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.21	165,217.37	165,531.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,264,902.50	42,186,684.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,264,902.50	42,186,684.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		68,264,902.50	42,186,684.40

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 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	383,798,000.00	52,530,069.89	436,328,069.89
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	383,798,000.00	52,530,069.89	436,328,069.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-96,000,000.00	53,961,092.02	-42,038,907.98
（一）、综合收益总额	-	68,264,902.50	68,264,902.50
（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）	-96,000,000.00	-14,303,810.48	-110,303,810.48
其中：1.基金申购款	963,000,000.00	243,563,958.20	1,206,563,958.20
2.基金赎回款	-1,059,000,000.00	-257,867,768.68	-1,316,867,768.68
（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	287,798,000.00	106,491,161.91	394,289,161.91
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	260,798,000.00	-4,567,365.98	256,230,634.02
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	260,798,000.00	-4,567,365.98	256,230,634.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	123,000,000.00	57,097,435.87	180,097,435.87
（一）、综合收益总额	-	42,186,684.40	42,186,684.40
（二）、本期基	123,000,000.00	14,910,751.47	137,910,751.47

金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	1,332,000,000.00	102,020,038.79	1,434,020,038.79
2.基金赎回款	-1,209,000,000.00	-87,109,287.32	-1,296,109,287.32
（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	383,798,000.00	52,530,069.89	436,328,069.89

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

汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2023〕1732号文《关于准予汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于2023年11月22日生效。首次设立基金募集规模为464,798,000.00份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第70015647_B10号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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 01 月 01 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。

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和托管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、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配采用现金分红;

3、每一基金份额享有同等分配权;

4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;

5、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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	1,643,268.54	1,148,735.86
等于：本金	1,643,062.79	1,148,575.82
加：应计利息	205.75	160.04
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	1,643,268.54	1,148,735.86

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	382,734,007.93	-	392,859,263.81	10,125,255.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	382,734,007.93	-	392,859,263.81	10,125,255.88
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	424,832,146.22	-	435,196,586.49	10,364,440.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		424,832,146.22	-	435,196,586.49	10,364,440.27

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	55,255.82	34,709.82

其中：交易所市场	55,255.82	34,709.82
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	45,000.00	45,000.00
应付信息披露费	120,000.00	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	220,255.82	199,709.82

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	383,798,000.00	383,798,000.00
本期申购	963,000,000.00	963,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,059,000,000.00	-1,059,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	287,798,000.00	287,798,000.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,105,856.60	2,424,213.29	52,530,069.89

加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	50,105,856.60	2,424,213.29	52,530,069.89
本期利润	68,504,086.89	-239,184.39	68,264,902.50
本期基金份额交易产生的变动数	-14,038,089.01	-265,721.47	-14,303,810.48
其中：基金申购款	238,590,138.26	4,973,819.94	243,563,958.20
基金赎回款	-252,628,227.27	-5,239,541.41	-257,867,768.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	104,571,854.48	1,919,307.43	106,491,161.91

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
活期存款利息收入	4,956.61	9,155.15
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	1,209.16	4,775.33
其他	20.91	644.70
合计	6,186.68	14,575.18

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01月01日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	28,436,285.55	-7,109,861.42
股票投资收益——赎回差价收入	33,625,733.18	29,236,647.51
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	62,062,018.73	22,126,786.09

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 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	452,603,602.92	191,445,680.40
减：卖出股票成本总额	423,718,596.59	198,246,888.75
减：交易费用	448,720.78	308,653.07
买卖股票差价收入	28,436,285.55	-7,109,861.42

7.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	1,316,867,768.68	1,296,109,287.32
减：现金支付赎回款总额	4,499,736.49	-3,338,095.68
减：赎回股票成本总额	1,278,742,299.01	1,270,210,735.49
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	33,625,733.18	29,236,647.51

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金无赎回差价收入。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31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	8,760,649.36	6,466,703.64
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	8,760,649.36	6,466,703.64

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12 月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12 月31日
1.交易性金融资产	-239,184.39	14,281,400.40
——股票投资	-239,184.39	14,281,400.40
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品 公允价值变动产生的 预估增值税	-	-

合计	-239,184.39	14,281,400.40
----	-------------	---------------

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12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	59,680.17	1,215,430.07
其他	-	-
合计	59,680.17	1,215,430.07

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12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	195.00	131.00
指数使用费	-	-
登记结算服务费	-	-
IOPV 计算与发布费	-	-
持有人大会-公证费	-	-
持有人大会-律师费	-	-
开户费	-	400.00
上市费	-	-
或有管理费	-	-
其他	22.37	-
合计	165,217.37	165,531.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人,基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("工商银行")	基金托管人
东方证券股份有限公司("东方证券")	基金管理人的股东
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

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 12 月 31 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 (%)
东方证券	-	-	194,742,689.65	45.00

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 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 (%)
	-	-	-	-
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 (%)
东方证券	143,311.26	77.39	-	-

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	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至

	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,849,358.88	1,460,566.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	477,483.89	174,856.09
应支付基金管理人的净管理费	1,371,874.99	1,285,710.64

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

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

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

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 12 月 31 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	369,871.80	292,113.25

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人

协商解决。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	1,669,000.00	0.58	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,643,268.54	4,956.61	1,148,735.86	9,155.15

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

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
688012	中微半导体设备	2025 年 12 月 19 日	重大事项停牌	272.72	2026 年 01 月 05 日	278.00	5,559	1,413,282.08	1,516,050.48	

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	1,643,268.54	-	-	-	-	-	1,643,268.54
结算 备付 金	308,647.33	-	-	-	-	-	308,647.33
存出 保证 金	3,523.96	-	-	-	-	-	3,523.96
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	392,859,263.81	392,859,263.81
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得	-	-	-	-	-	-	-

税资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,955,439.83	-	-	-	-	392,859,263.81	394,814,703.64
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	-	-	-	-	-	64,897.34	64,897.34
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	200,323.80	200,323.80
应付托管费	-	-	-	-	-	40,064.77	40,064.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	220,255.82	220,255.82
负债总计	-	-	-	-	-	525,541.73	525,541.73
利率敏感度缺口	1,955,439.83	-	-	-	-	392,333,722.08	394,289,161.91
上年度末 2024年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,148,735.86	-	-	-	-	-	1,148,735.86
结算备付金	179,222.85	-	-	-	-	-	179,222.85
存出保证金	9,553.68	-	-	-	-	-	9,553.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	435,196,586.49	435,196,586.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算	-	-	-	-	-	263,553.64	263,553.64

款							
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,337,512.39	-	-	-	-	435,460,140.13	436,797,652.52
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	-	-	-	-	-	42,756.89	42,756.89
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	189,263.28	189,263.28
应付托管费	-	-	-	-	-	37,852.64	37,852.64
应付销售	-	-	-	-	-	-	-

服务费							
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	199,709.82	199,709.82
负债总计	-	-	-	-	-	469,582.63	469,582.63
利率敏感度缺口	1,337,512.39	-	-	-	-	434,990,557.50	436,328,069.89

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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		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	392,859,263.81	99.64	435,196,586.49	99.74
交易性金融资产 - 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 - 债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产 - 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产 - 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	392,859,263.81	99.64	435,196,586.49	99.74

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	上证综合指数 上涨 5%	19,201,267.91	21,405,161.80
	上证综合指数 下跌 5%	-19,201,267.91	-21,405,161.80

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	391,343,213.33	435,196,586.49
第二层次	1,516,050.48	-
第三层次	-	-
合计	392,859,263.81	435,196,586.49

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-报告期内管理人对本基金持有人数或基

金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

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	392,859,263.81	99.50
	其中：股票	392,859,263.81	99.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,951,915.87	0.49
8	其他各项资产	3,523.96	0.00
9	合计	394,814,703.64	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	710,060.00	0.18
B	采矿业	36,181,211.00	9.18
C	制造业	171,302,195.64	43.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,225,246.03	4.12
E	建筑业	5,529,441.00	1.40
F	批发和零售业	5,899,385.32	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	15,342,660.00	3.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,276,339.92	6.66
J	金融业	99,414,932.60	25.21
K	房地产业	4,181,278.00	1.06
L	租赁和商务服务业	1,841,368.10	0.47
M	科学研究和技术服务业	5,171,721.63	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	2,787,468.95	0.71

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	459,165.00	0.12
Q	卫生和社会工作	358,753.62	0.09
R	文化、体育和娱乐业	923,637.00	0.23
S	综合	254,400.00	0.06
	合计	392,859,263.81	99.64

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	601288	农业银行	2,538,000	19,491,840.00	4.94
2	601988	中国银行	2,206,900	12,645,537.00	3.21
3	601857	中国石油	1,086,600	11,311,506.00	2.87
4	600519	贵州茅台	7,900	10,879,722.00	2.76
5	601138	工业富联	126,800	7,867,940.00	2.00
6	601628	中国人寿	141,000	6,415,500.00	1.63
7	600036	招商银行	137,800	5,801,380.00	1.47
8	601318	中国平安	73,200	5,006,880.00	1.27
9	601088	中国神华	115,700	4,685,850.00	1.19

10	601899	紫金矿业	134,800	4,646,556.00	1.18
11	600900	长江电力	164,700	4,478,193.00	1.14
12	688256	寒武纪科技	3,298	4,470,603.90	1.13
13	600028	中国石化	639,600	3,952,728.00	1.00
14	601328	交通银行	473,200	3,430,700.00	0.87
15	601658	邮储银行	623,900	3,400,255.00	0.86
16	601728	中国电信	537,100	3,383,730.00	0.86
17	688041	海光信息	14,782	3,317,228.62	0.84
18	601166	兴业银行	142,100	2,992,626.00	0.76
19	600276	恒瑞医药	41,800	2,490,026.00	0.63
20	600030	中信证券	85,100	2,443,221.00	0.62
21	600000	浦发银行	192,800	2,398,432.00	0.61
22	603993	洛阳钼业	117,873	2,357,460.00	0.60
23	601601	中国太保	53,700	2,250,567.00	0.57
24	603259	药明康德	24,400	2,211,616.00	0.56
25	601998	中信银行	268,600	2,068,220.00	0.52
26	601319	中国人保	229,200	2,051,340.00	0.52
27	600989	宝丰能源	97,700	1,917,851.00	0.49
28	601211	国泰海通	89,502	1,839,266.10	0.47
29	600183	生益科技	25,400	1,813,814.00	0.46
30	600406	国电南瑞	75,200	1,690,496.00	0.43
31	601066	中信建投	60,900	1,630,293.00	0.41

32	600309	万华化学	20,500	1,571,940.00	0.40
33	601816	京沪高铁	303,300	1,561,995.00	0.40
34	600547	山东黄金	39,500	1,529,045.00	0.39
35	688012	中微半导体设备	5,559	1,516,050.48	0.38
36	601668	中国建筑	281,900	1,446,147.00	0.37
37	601225	陕西煤业	66,700	1,422,044.00	0.36
38	601012	隆基绿能	78,100	1,421,420.00	0.36
39	601005	重庆钢铁	948,000	1,384,080.00	0.35
40	601919	中远海控	90,700	1,376,826.00	0.35
41	600809	山西汾酒	8,000	1,373,600.00	0.35
42	603288	海天味业	37,100	1,373,442.00	0.35
43	601336	新华保险	19,400	1,352,180.00	0.34
44	601939	建设银行	140,600	1,304,768.00	0.33
45	601366	利群股份	267,300	1,304,424.00	0.33
46	601818	光大银行	370,800	1,294,092.00	0.33
47	600160	巨化股份	33,500	1,287,070.00	0.33
48	600919	江苏银行	123,000	1,279,200.00	0.32
49	601633	长城汽车	55,700	1,260,491.00	0.32
50	600887	伊利股份	44,000	1,258,400.00	0.32
51	605118	力鼎光电	40,800	1,228,488.00	0.31
52	688172	燕东微电子股份	41,916	1,213,049.04	0.31

53	600104	上汽集团	79,100	1,203,902.00	0.31
54	600690	海尔智家	45,600	1,189,704.00	0.30
55	601985	中国核电	135,100	1,168,615.00	0.30
56	600038	中直股份	32,300	1,166,999.00	0.30
57	603501	豪威集团	9,200	1,158,280.00	0.29
58	600029	南方航空	144,300	1,155,843.00	0.29
59	600031	三一重工	54,400	1,149,472.00	0.29
60	601127	赛力斯	9,300	1,124,928.00	0.29
61	601766	中国中车	164,100	1,119,162.00	0.28
62	600115	中国东航	186,300	1,117,800.00	0.28
63	601009	南京银行	97,100	1,109,853.00	0.28
64	601065	江西省盐业集团	133,381	1,107,062.30	0.28
65	603380	易德龙	28,800	1,094,400.00	0.28
66	600025	华能水电	120,300	1,092,324.00	0.28
67	600019	宝钢股份	146,500	1,091,425.00	0.28
68	601600	中国铝业	88,900	1,086,358.00	0.28
69	600699	均胜电子	33,900	1,063,104.00	0.27
70	600050	中国联通	206,800	1,056,748.00	0.27
71	605499	东鹏饮料	3,920	1,048,168.80	0.27
72	688103	国力电子	17,297	1,048,025.23	0.27
73	600549	厦门钨业	25,300	1,038,818.00	0.26
74	600739	辽宁成大	91,000	1,017,380.00	0.26

75	688008	澜起科技	8,625	1,016,025.00	0.26
76	601168	西部矿业	35,800	989,512.00	0.25
77	600760	中航沈飞	17,600	988,240.00	0.25
78	601229	上海银行	97,600	985,760.00	0.25
79	688681	科汇电力自动化	55,488	975,479.04	0.25
80	605376	博迁新材	14,800	967,920.00	0.25
81	600075	新疆天业	190,100	940,995.00	0.24
82	688002	睿创微纳	9,334	940,867.20	0.24
83	600415	小商品城	56,800	905,960.00	0.23
84	600660	福耀玻璃	13,800	893,826.00	0.23
85	600150	中国船舶	26,814	891,833.64	0.23
86	600999	招商证券	53,500	890,240.00	0.23
87	600936	广西广电	210,400	887,888.00	0.23
88	601898	中煤能源	70,900	881,996.00	0.22
89	688188	上海柏楚电子科技	6,452	876,762.28	0.22
90	688506	百利天恒药业	2,709	875,277.90	0.22
91	688027	科大国盾量子	1,731	872,060.49	0.22
92	688111	金山办公	2,818	865,323.26	0.22
93	600489	中金黄金	36,900	861,984.00	0.22
94	688521	芯原微电子	6,249	855,925.53	0.22
95	601727	上海电气	98,900	851,529.00	0.22

96	600512	腾达建设	346,800	839,256.00	0.21
97	603267	鸿远电子	15,400	838,222.00	0.21
98	688207	格灵深瞳	55,096	837,459.20	0.21
99	600346	恒力石化	37,100	835,863.00	0.21
100	600018	上港集团	154,100	835,222.00	0.21
101	603050	科林电气	45,600	821,712.00	0.21
102	601528	瑞丰银行	144,100	821,370.00	0.21
103	600116	三峡水利	124,800	816,192.00	0.21
104	603085	天成自控	67,600	801,060.00	0.20
105	688259	创耀通信科技	18,980	793,364.00	0.20
106	688512	慧智微电子	70,415	785,831.40	0.20
107	600089	特变电工	35,200	782,144.00	0.20
108	688261	东微半导体	9,523	780,981.23	0.20
109	601169	北京银行	142,300	779,804.00	0.20
110	600926	杭州银行	50,300	768,584.00	0.19
111	600905	三峡能源	187,300	766,057.00	0.19
112	600675	中华企业	282,500	765,575.00	0.19
113	688533	上声电子股份	26,054	761,818.96	0.19
114	688023	安恒信息	14,803	761,022.23	0.19
115	601607	上海医药	42,500	759,050.00	0.19
116	688380	中微半导	23,559	757,421.85	0.19
117	688015	交控科技	33,108	754,200.24	0.19

118	603323	苏农银行	148,670	750,783.50	0.19
119	600875	东方电气	30,900	750,252.00	0.19
120	688295	中复神鹰碳纤维	22,857	749,938.17	0.19
121	688981	中芯国际	6,099	749,140.17	0.19
122	600015	华夏银行	108,400	744,708.00	0.19
123	601881	中国银河	47,300	743,556.00	0.19
124	601375	中原证券	171,700	738,310.00	0.19
125	600909	华安证券	108,600	736,308.00	0.19
126	601688	华泰证券	31,000	731,290.00	0.19
127	603893	瑞芯微	4,100	730,948.00	0.19
128	688566	吉贝尔药业	24,419	728,907.15	0.18
129	603160	汇顶科技	9,200	726,800.00	0.18
130	688114	华大智造	11,825	718,487.00	0.18
131	600210	紫江企业	97,600	717,360.00	0.18
132	688001	苏州华兴源创科技	23,762	717,137.16	0.18
133	600064	南京高科	82,600	716,968.00	0.18
134	600332	白云山	27,700	712,998.00	0.18
135	688515	裕太微电子	6,811	698,468.05	0.18
136	603797	联泰环保	148,700	694,429.00	0.18
137	601877	正泰电器	24,600	686,094.00	0.17
138	600886	国投电力	52,200	684,864.00	0.17
139	688549	中巨芯科技	74,469	679,157.28	0.17

140	688213	思特威 电子科 技	7,140	678,942.60	0.17
141	600166	福田汽 车	231,700	676,564.00	0.17
142	603167	渤海轮 渡	71,500	674,245.00	0.17
142	603629	利通电 子	25,300	674,245.00	0.17
144	603328	依顿电 子	61,200	670,752.00	0.17
145	688063	派能科 技	11,747	667,464.54	0.17
146	600585	海螺水 泥	30,500	666,730.00	0.17
147	601669	中国电 建	128,200	666,640.00	0.17
148	600716	凤凰股 份	171,800	664,866.00	0.17
149	688158	优刻得 科技	23,665	664,749.85	0.17
150	600496	精工钢 构	159,800	663,170.00	0.17
151	688113	联测科 技	16,689	659,716.17	0.17
152	600893	航发动 力	16,200	648,486.00	0.16
153	600741	华域汽 车	32,400	648,000.00	0.16
154	603199	九华旅 游	17,500	643,300.00	0.16
155	600590	泰豪科 技	68,200	641,762.00	0.16
156	603071	物产环 能	48,500	641,170.00	0.16
157	603927	中科软	33,480	639,133.20	0.16
158	603519	立霸股 份	53,100	638,793.00	0.16
159	688077	大地熊 新材料	20,844	636,784.20	0.16
160	600061	国投资 本	83,100	635,715.00	0.16
161	688093	世华科 技	17,242	635,367.70	0.16

162	601390	中国中铁	116,700	631,347.00	0.16
163	688200	华峰测控	3,315	630,513.00	0.16
164	601226	华电科工	80,300	629,552.00	0.16
165	600795	国电电力	124,900	629,496.00	0.16
166	688080	映翰通网络	12,463	629,381.50	0.16
167	600497	驰宏锌锗	85,800	627,198.00	0.16
168	603166	福达股份	39,900	626,430.00	0.16
169	601577	长沙银行	63,800	618,860.00	0.16
170	688183	生益电子	6,455	617,678.95	0.16
171	600269	赣粤高速	118,100	612,939.00	0.16
172	600098	广州发展	93,700	612,798.00	0.16
173	688677	青岛海泰新光	14,151	610,757.16	0.15
174	601901	方正证券	78,300	610,740.00	0.15
175	688616	西力科技	49,755	608,503.65	0.15
176	603799	华友钴业	8,900	607,514.00	0.15
177	600499	科达制造	43,700	606,119.00	0.15
178	600642	申能股份	77,900	606,062.00	0.15
179	601018	宁波港	166,900	605,847.00	0.15
180	601880	辽港股份	377,500	604,000.00	0.15
181	603187	海容冷链	38,300	600,927.00	0.15
182	600004	白云机场	63,200	597,872.00	0.15
183	600011	华能国际	80,100	597,546.00	0.15

184	688208	道通科技	16,192	595,865.60	0.15
185	603989	艾华集团	35,500	595,690.00	0.15
186	601995	中金公司	17,000	595,000.00	0.15
187	603444	吉比特	1,400	593,390.00	0.15
188	601555	东吴证券	64,900	587,994.00	0.15
189	600522	中天科技	32,200	583,464.00	0.15
190	603019	中科曙光	6,800	582,352.00	0.15
191	600048	保利发展	95,200	580,720.00	0.15
192	600908	无锡银行	97,500	578,175.00	0.15
193	600584	长电科技	15,600	573,768.00	0.15
194	600177	雅戈尔	75,400	573,040.00	0.15
195	603661	恒林股份	17,900	572,979.00	0.15
196	688052	纳芯微电子	3,613	571,504.34	0.14
197	600282	南钢股份	107,600	565,976.00	0.14
198	603197	保隆科技	15,300	565,947.00	0.14
199	600016	民生银行	147,500	564,925.00	0.14
200	601108	财通证券	63,900	557,208.00	0.14
201	600020	中原高速	130,500	555,930.00	0.14
202	688419	耐科装备	19,831	555,069.69	0.14
203	600111	北方稀土	12,000	553,440.00	0.14
204	688182	灿勤科技	18,694	551,846.88	0.14
205	600037	歌华有线	74,800	546,040.00	0.14
206	603885	吉祥航	36,200	538,656.00	0.14

		空			
207	688100	威胜信息	13,695	538,213.50	0.14
208	600776	东方通信	32,600	537,900.00	0.14
209	688072	拓荆科技	1,629	537,570.00	0.14
210	603317	天味食品	42,900	537,108.00	0.14
211	601963	重庆银行	49,500	536,085.00	0.14
212	688069	德林海环保	23,665	530,805.95	0.13
213	603195	公牛集团	12,995	530,585.85	0.13
214	600420	国药现代	52,300	528,230.00	0.13
215	688799	华纳大药厂	11,074	528,229.80	0.13
216	603920	世运电路	10,900	527,669.00	0.13
217	600803	新奥股份	25,000	519,000.00	0.13
218	600469	风神股份	74,500	517,030.00	0.13
219	601111	中国国航	54,500	510,665.00	0.13
220	600641	先导基电	28,900	509,796.00	0.13
221	600352	浙江龙盛	47,100	502,086.00	0.13
222	688439	振华风光	7,756	501,037.60	0.13
223	600109	国金证券	53,800	500,340.00	0.13
224	601677	明泰铝业	33,700	498,423.00	0.13
225	601128	常熟银行	70,600	497,024.00	0.13
226	603038	华立股份	30,800	495,880.00	0.13
227	688508	芯朋微电子	8,097	493,107.30	0.13

228	600517	国网英大	82,000	492,820.00	0.12
229	603986	兆易创新	2,300	492,775.00	0.12
230	603105	芯能科技	53,100	487,989.00	0.12
231	600035	楚天高速	125,400	486,552.00	0.12
232	603057	上海紫燕食品	23,600	480,024.00	0.12
233	601006	大秦铁路	93,000	479,880.00	0.12
234	600918	中泰证券	73,800	479,700.00	0.12
235	688557	兰剑智能	13,166	479,637.38	0.12
236	600988	赤峰黄金	15,300	477,972.00	0.12
237	601868	中国能建	203,000	477,050.00	0.12
238	600966	博汇纸业	69,800	476,734.00	0.12
239	688550	瑞联新材料	10,409	471,631.79	0.12
240	688558	国盛智科股份	16,273	470,777.89	0.12
241	600266	城建发展	92,700	469,989.00	0.12
242	603678	火炬电子	13,300	469,756.00	0.12
243	688185	康希诺生物	7,414	465,969.90	0.12
244	600009	上海机场	14,200	465,192.00	0.12
245	603982	泉峰汽车	55,400	463,698.00	0.12
246	600339	中油工程	138,200	462,970.00	0.12
247	600997	开滦股份	80,500	462,875.00	0.12
248	601117	中国化学	61,300	461,589.00	0.12
249	603383	顶点软件	12,756	460,619.16	0.12

250	601958	金铂股份	29,400	458,052.00	0.12
251	601825	沪农商行	49,200	457,068.00	0.12
252	603111	康尼机电	66,300	454,155.00	0.12
253	600598	北大荒	30,200	451,490.00	0.11
254	603456	九洲药业	25,200	451,080.00	0.11
255	688223	晶科能源	79,828	450,229.92	0.11
256	603118	共进股份	39,000	448,500.00	0.11
257	600310	广西能源	117,400	447,294.00	0.11
258	688819	天能电池集团股份	13,436	446,343.92	0.11
259	688202	美迪西生物医药	7,913	446,293.20	0.11
260	688267	中触媒股份	15,501	436,663.17	0.11
261	601860	紫金银行	157,400	434,424.00	0.11
262	603309	维力医疗	31,500	428,085.00	0.11
263	688526	武汉科前生物	27,968	426,791.68	0.11
264	603916	苏博特	44,900	424,754.00	0.11
265	603310	魏华新材	25,200	423,612.00	0.11
266	603737	三棵树	9,100	421,057.00	0.11
267	688132	邦彦技术股份	22,794	419,865.48	0.11
268	601100	恒立液压	3,800	417,658.00	0.11
269	603237	五芳斋实业	24,900	415,332.00	0.11
270	688519	南亚新材料	5,126	414,488.36	0.11
271	601997	贵阳银行	70,000	410,900.00	0.10

272	601368	绿城水务	82,800	410,688.00	0.10
273	600032	浙江新能	55,200	409,032.00	0.10
274	688668	鼎通科技	3,288	407,712.00	0.10
275	603390	通达电气	31,100	406,477.00	0.10
276	601827	三峰环境	47,800	404,866.00	0.10
277	603368	柳药集团	22,700	404,514.00	0.10
278	603018	华设集团	52,800	401,808.00	0.10
279	600655	豫园股份	78,200	401,166.00	0.10
280	600186	莲花控股	66,900	400,062.00	0.10
281	688629	四川华丰科技	3,988	399,039.28	0.10
282	688552	航天南湖	10,898	395,815.36	0.10
283	603025	大豪科技	22,000	395,120.00	0.10
284	600863	内蒙华电	87,300	391,104.00	0.10
285	600436	片仔癀	2,300	388,194.00	0.10
286	600845	宝信软件	18,640	386,034.40	0.10
287	688459	哈铁科技	39,878	384,822.70	0.10
288	605168	三人行	9,945	383,678.10	0.10
289	603788	宁波高发	23,200	379,088.00	0.10
290	600548	深高速	43,000	378,400.00	0.10
291	600643	爱建集团	68,300	377,699.00	0.10
292	600995	南网储能	29,900	375,843.00	0.10
293	600372	中航机载	27,900	374,418.00	0.09
294	688060	江苏云涌电子	8,806	372,757.98	0.09

		科技			
295	601003	柳钢股份	73,700	370,711.00	0.09
296	600562	国睿科技	13,100	370,206.00	0.09
297	603558	健盛集团	32,900	369,467.00	0.09
298	688067	爱威科技	14,907	366,115.92	0.09
299	600261	阳光照明	108,300	364,971.00	0.09
300	603416	信捷电气	6,600	364,518.00	0.09
301	689009	九号公司	6,515	362,168.85	0.09
302	600188	兖矿能源	27,380	360,047.00	0.09
303	603387	基蛋生物	43,000	359,910.00	0.09
304	600763	通策医疗	8,922	358,753.62	0.09
305	600998	九州通	69,986	358,328.32	0.09
306	600132	重庆啤酒	6,800	355,232.00	0.09
307	688105	诺唯赞生物	17,708	354,514.16	0.09
308	603170	宝立食品科技	24,800	354,144.00	0.09
309	688686	奥普特科技	2,850	353,770.50	0.09
310	603786	科博达	4,500	351,450.00	0.09
311	601717	中创智领	14,300	351,065.00	0.09
312	600623	华谊集团	45,500	350,805.00	0.09
313	600377	宁沪高速	28,900	349,979.00	0.09
314	603325	博隆技术	4,500	349,965.00	0.09
315	601808	中海油服	24,900	349,596.00	0.09
316	603766	隆鑫通用	21,700	349,587.00	0.09

317	600597	光明乳业	43,200	349,488.00	0.09
318	600600	青岛啤酒	5,700	348,840.00	0.09
319	688591	泰凌微	8,193	348,694.08	0.09
320	603569	长久物流	45,500	348,075.00	0.09
321	603936	博敏电子	27,400	347,980.00	0.09
322	600867	通化东宝	42,500	347,225.00	0.09
323	600583	海油工程	63,000	345,870.00	0.09
324	601788	光大证券	19,700	345,735.00	0.09
325	600862	中航高科	14,500	342,635.00	0.09
326	688123	聚辰半导体	2,726	342,331.08	0.09
327	688522	纳睿雷达科技	8,559	341,760.87	0.09
328	688702	盛科通信	2,412	341,756.28	0.09
329	603899	晨光股份	12,600	340,956.00	0.09
330	603379	三美股份	5,600	340,032.00	0.09
331	688355	明志科技	19,089	339,784.20	0.09
332	688271	联影医疗	2,707	339,728.50	0.09
333	688390	固德威电源	5,466	339,602.58	0.09
334	603005	晶方科技	12,200	337,452.00	0.09
335	603578	三星新材	27,800	335,824.00	0.09
336	600131	国网信通	20,800	335,712.00	0.09
337	600410	华胜天成	18,700	334,356.00	0.08
338	605020	永和股份	12,400	333,436.00	0.08

339	601991	大唐发电	95,500	333,295.00	0.08
340	603707	健友股份	36,700	331,401.00	0.08
341	688363	华熙生物	7,574	330,832.32	0.08
342	600307	酒钢宏兴	199,500	329,175.00	0.08
343	600196	复星医药	12,300	325,827.00	0.08
344	600251	冠农股份	35,300	325,819.00	0.08
345	600827	百联股份	36,100	324,539.00	0.08
346	688050	爱博诺德医疗	5,282	320,406.12	0.08
347	600449	宁夏建材	25,900	320,124.00	0.08
348	688428	诺诚健华	15,587	319,845.24	0.08
349	688029	南微医学科技	3,919	319,633.64	0.08
350	600873	梅花生物	31,500	319,095.00	0.08
351	603345	安井食品	4,000	317,120.00	0.08
352	603596	伯特利	6,180	316,848.60	0.08
353	600330	天通股份	24,120	316,695.60	0.08
354	601158	重庆水务	70,800	316,476.00	0.08
355	603043	广州酒家	17,800	313,814.00	0.08
356	601966	玲珑轮胎	21,500	312,395.00	0.08
357	603639	海利尔	24,587	312,254.90	0.08
358	601163	三角轮胎	21,800	311,522.00	0.08
359	603500	祥和实业	26,000	311,480.00	0.08
360	603035	常熟汽饰	20,100	310,947.00	0.08
361	688180	君实生	9,097	310,753.52	0.08

		物			
362	600848	上海临港	26,500	310,050.00	0.08
363	688429	时创能源	23,616	309,133.44	0.08
364	600363	联创光电	4,900	308,994.00	0.08
365	600523	贵航股份	19,500	306,345.00	0.08
366	603700	宁水集团	22,500	305,775.00	0.08
367	688636	智明达电子	7,091	303,778.44	0.08
368	600500	中化国际	77,000	301,840.00	0.08
369	601702	华峰铝业	14,662	300,131.14	0.08
370	600987	航民股份	43,300	298,337.00	0.08
371	601882	海天精工	15,300	297,738.00	0.08
372	600582	天地科技	50,900	296,747.00	0.08
373	603728	鸣志电器	4,100	296,635.00	0.08
374	600885	宏发股份	9,680	294,272.00	0.07
375	601866	中远海发	116,700	294,084.00	0.07
376	601888	中国中免	3,100	293,136.00	0.07
377	600661	昂立教育	28,500	292,125.00	0.07
378	605123	派克新材	2,800	290,920.00	0.07
379	688006	浙江杭可科技	9,920	290,556.80	0.07
380	603305	旭升集团	17,800	288,004.00	0.07
381	600392	盛和资源	13,300	286,349.00	0.07
382	600100	同方股份	31,900	284,548.00	0.07

383	603713	密尔克卫	5,100	284,427.00	0.07
384	600563	法拉电子	2,700	283,365.00	0.07
385	600323	瀚蓝环境	9,900	283,140.00	0.07
386	600854	春兰股份	55,700	277,943.00	0.07
387	688653	康希通信	22,855	277,688.25	0.07
388	601101	昊华能源	38,500	275,660.00	0.07
389	600114	东睦股份	9,000	274,950.00	0.07
390	603297	永新光学	2,600	273,780.00	0.07
391	601198	东兴证券	19,600	272,048.00	0.07
392	600378	昊华科技	8,400	268,464.00	0.07
393	688538	和辉光电	100,714	267,899.24	0.07
394	600985	淮北矿业	24,100	267,751.00	0.07
395	601990	南京证券	33,700	266,904.00	0.07
396	600780	通宝能源	46,800	265,824.00	0.07
397	688238	和元生物	39,506	263,109.96	0.07
398	688443	智翔金泰	9,629	262,293.96	0.07
399	603897	长城科技	9,600	261,120.00	0.07
400	600380	健康元	22,600	261,030.00	0.07
401	688020	方邦股份	3,833	260,720.66	0.07
402	603330	天洋新材	36,000	260,640.00	0.07
403	688798	艾为电子	3,422	260,448.42	0.07
404	600820	隧道股份	40,100	260,249.00	0.07

405	600176	中国巨石	15,200	259,920.00	0.07
406	688389	深圳普门科技	19,946	258,899.08	0.07
407	600861	北京人力	14,100	258,594.00	0.07
408	601118	海南橡胶	44,200	258,570.00	0.07
409	600125	铁龙物流	40,100	258,244.00	0.07
410	600834	申通地铁	30,000	254,400.00	0.06
411	601689	拓普集团	3,255	251,220.90	0.06
412	601900	南方传媒	18,700	250,767.00	0.06
413	600935	华塑股份	102,100	250,145.00	0.06
414	603213	镇洋发展	19,000	249,470.00	0.06
415	603995	甬金股份	13,700	247,696.00	0.06
416	601083	锦江航运	22,100	246,636.00	0.06
417	688321	微芯生物	8,379	244,834.38	0.06
418	688619	罗普特科技	17,780	241,808.00	0.06
419	601096	宏盛华源铁塔集团	57,900	240,285.00	0.06
420	688106	金宏气体	12,220	239,389.80	0.06
421	688112	鼎阳科技	6,389	239,268.05	0.06
422	688689	常州银河微电	8,386	237,994.68	0.06
423	688571	杭华油墨股份	31,862	237,371.90	0.06
424	688582	芯动联科	3,579	236,607.69	0.06
425	688092	爱科科技股份	9,365	235,436.10	0.06
426	605258	协和电	7,500	234,525.00	0.06

		子			
427	600732	爱旭股份	17,500	234,500.00	0.06
428	601800	中国交建	28,400	234,016.00	0.06
429	600395	盘江股份	49,600	231,136.00	0.06
430	601518	吉林高速	81,900	230,958.00	0.06
431	600054	黄山旅游	20,400	230,928.00	0.06
432	688018	乐鑫科技	1,335	226,950.00	0.06
433	600391	航发科技	6,100	226,310.00	0.06
434	688391	钜泉科技	7,977	225,988.41	0.06
435	600612	老凤祥	5,000	222,350.00	0.06
436	688222	成都先导	9,429	221,110.05	0.06
437	603699	纽威股份	4,200	218,274.00	0.06
438	603006	黎明股份	16,600	217,792.00	0.06
439	688303	大全能源	8,081	216,732.42	0.05
440	603876	鼎胜新材	14,400	216,144.00	0.05
441	600039	四川路桥	21,700	215,915.00	0.05
442	688133	泰坦股份	9,698	214,713.72	0.05
443	688565	力源科技	19,171	214,523.49	0.05
444	600535	天士力	14,100	212,487.00	0.05
445	688613	奥精医疗	10,436	211,955.16	0.05
446	688187	时代电气	4,125	211,571.25	0.05
447	601236	红塔证券	25,400	208,026.00	0.05
448	688025	杰普特光电	1,464	207,258.48	0.05

449	600633	浙数文化	16,100	207,046.00	0.05
450	603233	大参林	11,600	204,392.00	0.05
451	688249	晶合集成	6,105	202,624.95	0.05
452	603887	城地香江	14,900	201,448.00	0.05
453	600906	财达证券	30,100	200,767.00	0.05
454	601865	福莱特	12,800	200,576.00	0.05
455	603070	万控智造	15,300	198,288.00	0.05
456	600717	天津港	44,300	198,021.00	0.05
457	601928	凤凰传媒	19,600	196,784.00	0.05
458	603867	新化股份	7,700	195,580.00	0.05
459	600961	株冶集团	12,100	194,810.00	0.05
460	600023	浙能电力	38,500	190,575.00	0.05
461	688126	上海硅产业集团	8,748	189,306.72	0.05
462	603861	白云电器	15,500	188,635.00	0.05
463	600787	中储股份	33,400	187,708.00	0.05
464	603151	邦基科技股份	10,400	187,408.00	0.05
465	688163	赛伦生物	8,530	185,698.10	0.05
466	600486	扬农化工	2,674	185,548.86	0.05
467	603408	建霖家居	13,700	185,498.00	0.05
468	603663	三祥新材	5,200	183,820.00	0.05
469	603638	艾迪精密	9,700	183,621.00	0.05
470	600821	金开新能	35,900	183,090.00	0.05
471	601061	中信金	12,700	182,880.00	0.05

		属			
472	600570	恒生电子	5,900	177,885.00	0.05
473	600928	西安银行	47,600	176,120.00	0.04
474	601858	中国科传	9,700	176,055.00	0.04
475	688311	盟升电子	3,858	175,924.80	0.04
476	600628	新世界	22,200	174,492.00	0.04
477	688326	经纬恒润	1,483	174,252.50	0.04
478	600983	惠而浦	18,000	172,080.00	0.04
479	605006	山东玻纤	23,500	171,550.00	0.04
480	603659	璞泰来	6,200	169,508.00	0.04
481	603201	常润股份	9,920	167,449.60	0.04
482	600718	东软集团	16,600	167,162.00	0.04
483	605098	行动教育	4,000	167,040.00	0.04
484	600609	金杯汽车	35,800	165,754.00	0.04
485	603689	皖天然气	20,173	163,603.03	0.04
486	605577	龙版传媒	12,500	163,375.00	0.04
487	600325	华发股份	38,700	163,314.00	0.04
488	603816	顾家家居	5,300	162,922.00	0.04
489	600382	广东明珠	22,800	162,564.00	0.04
490	600853	龙建股份	37,400	161,942.00	0.04
491	603602	纵横通信	11,100	161,616.00	0.04
492	603611	诺力股份	6,600	161,370.00	0.04
493	600588	用友网络	12,000	159,120.00	0.04
494	688088	虹软科	3,211	158,944.50	0.04

		技			
495	603357	设计总院	19,400	158,110.00	0.04
496	600010	包钢股份	66,400	158,032.00	0.04
497	603583	捷昌驱动	4,100	156,087.00	0.04
498	603787	新日股份	11,100	156,066.00	0.04
499	603311	金海高科	10,200	155,856.00	0.04
500	605001	威奥股份	20,100	153,363.00	0.04
501	603282	亚光科技股份	7,700	152,768.00	0.04
502	600356	恒丰纸业	17,300	151,894.00	0.04
503	600968	海油发展	39,300	150,912.00	0.04
504	600770	综艺股份	28,800	148,896.00	0.04
505	600221	海航控股	82,100	148,601.00	0.04
506	603855	华荣股份	7,500	145,125.00	0.04
507	688599	天合光能	8,747	144,762.85	0.04
508	688590	新致软件	7,739	144,409.74	0.04
509	600480	凌云股份	11,700	143,793.00	0.04
510	603236	移远通信	1,500	143,115.00	0.04
511	603172	浙江万丰股份	8,000	142,400.00	0.04
512	688131	皓元医药	1,968	141,853.44	0.04
513	600429	三元股份	26,900	139,342.00	0.04
514	603270	金帝精密科技股份	5,100	137,853.00	0.03
515	603466	风语筑	14,600	136,656.00	0.03

516	600195	中牧股份	17,200	135,364.00	0.03
517	600606	绿地控股	81,500	135,290.00	0.03
518	688343	云天励飞股份	1,754	133,444.32	0.03
519	600866	星湖科技	19,000	132,050.00	0.03
520	601016	节能风电	44,200	130,390.00	0.03
521	688382	益方生物科技	4,765	129,798.60	0.03
522	688137	近岸蛋白	3,222	129,041.10	0.03
523	688584	上海合晶硅材料	5,877	128,941.38	0.03
524	688416	恒烁股份	2,338	128,893.94	0.03
525	688305	科德数控	2,081	128,605.80	0.03
526	605056	咸亨国际	7,700	127,050.00	0.03
527	688327	云从科技	8,813	126,642.81	0.03
528	688128	中国电器研究院	4,308	125,276.64	0.03
529	600398	海澜之家	20,700	125,235.00	0.03
530	601156	东航物流	6,800	125,188.00	0.03
531	603185	弘元绿能	4,100	125,050.00	0.03
532	688379	华光新材	2,260	124,435.60	0.03
533	600300	维维股份	34,400	120,744.00	0.03
534	600438	通威股份	5,800	119,016.00	0.03
535	600764	中国海防	4,300	117,562.00	0.03
536	688435	英方软件	2,506	117,205.62	0.03

537	688579	山大地纬软件	10,778	116,186.84	0.03
538	600750	江中药业	5,000	115,850.00	0.03
539	603511	爱慕股份	7,400	114,626.00	0.03
540	688318	财富趋势	866	114,589.12	0.03
541	603256	宏和科技	3,100	114,111.00	0.03
542	600369	西南证券	25,400	113,792.00	0.03
543	603066	音飞储存	10,500	112,875.00	0.03
544	688678	福立旺精密	4,639	112,171.02	0.03
545	688022	瀚川智能	7,331	112,164.30	0.03
546	688609	广东九联科技	10,898	111,268.58	0.03
547	688728	格科微有限公司	7,347	109,764.18	0.03
548	600529	山东药玻	5,500	109,615.00	0.03
549	600572	康恩贝	24,500	109,270.00	0.03

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688256	寒武纪科技	12,466,745.55	2.86
2	601288	农业银行	8,475,160.00	1.94
3	600519	贵州茅台	7,785,017.00	1.78

4	601988	中国银行	5,513,097.00	1.26
5	601328	交通银行	4,894,328.00	1.12
6	688981	中芯国际	3,642,899.77	0.83
7	605499	东鹏饮料	3,584,166.00	0.82
8	688008	澜起科技	3,416,711.38	0.78
9	600436	片仔癀	3,133,189.61	0.72
10	688012	中微半导体设备	3,007,639.14	0.69
11	688111	金山办公	2,829,065.82	0.65
12	688506	百利天恒药业	2,822,414.66	0.65
13	603893	瑞芯微	2,810,722.00	0.64
14	603444	吉比特	2,757,639.00	0.63
15	688041	海光信息	2,745,895.88	0.63
16	601360	三六零	2,599,966.00	0.60
17	688261	东微半导体	2,284,050.50	0.52
18	688271	联影医疗	2,203,841.48	0.51
19	600415	小商品城	2,163,575.00	0.50
20	688305	科德数控	2,161,114.43	0.50

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	688256	寒武纪科技	10,382,271.80	2.38
2	601288	农业银行	8,924,119.00	2.05
3	600519	贵州茅台	7,748,641.00	1.78
4	601939	建设银行	4,112,795.00	0.94
5	603444	吉比特	3,647,559.00	0.84
6	603757	大元泵业	3,642,694.71	0.83
7	600436	片仔癀	3,396,401.00	0.78
8	688111	金山办公	3,334,924.96	0.76
9	605499	东鹏饮料	3,156,770.00	0.72
10	601231	环旭电子	3,114,459.50	0.71
11	688219	会通股份	2,979,296.62	0.68
12	688012	中微半导体设备	2,965,682.24	0.68
13	603639	海利尔	2,965,255.00	0.68
14	601360	三六零	2,925,634.00	0.67
15	603893	瑞芯微	2,867,447.00	0.66

16	688041	海光信息	2,812,488.55	0.64
17	688271	联影医疗	2,775,168.70	0.64
18	688981	中芯国际	2,716,275.23	0.62
19	600563	法拉电子	2,695,348.14	0.62
20	600113	浙江东日	2,520,111.00	0.58

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	478,448,290.59
卖出股票收入（成交）总额	452,603,602.92

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

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	3,523.96
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,523.96

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
24,953	11,533.60	20,405,299.00	7.09	267,392,701.00	92.91

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	李亨卫	3,668,700.00	1.27
2	UBS AG	2,844,600.00	0.99
3	中信证券股份有限公司	2,617,001.00	0.91
4	贺小军	2,597,200.00	0.90
5	浙商证券股份有限公司	2,510,100.00	0.87
6	国信证券股份有限公司	2,404,600.00	0.84
7	方旭儒	2,186,100.00	0.76
8	何维	2,125,600.00	0.74
9	广发证券股份有限公司	2,054,998.00	0.71
10	郑泽海	2,000,000.00	0.69

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.5 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情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年11月22日） 基金份额总额	464,798,000.00
本报告期期初基金份额总额	383,798,000.00
本报告期基金总申购份额	963,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,059,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	287,798,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

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（2023年11月22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。公司将从从严加强内控及各业务管理，持续提升管理质效。
其他	无

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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（%）	
光大证券	1	928,377,514.43	99.94	163,310.36	99.94	
招商证券	4	522,421.78	0.06	91.91	0.06	
长江证券	1	-	-	-	-	
东方证券	4	-	-	-	-	
东吴证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	
高盛中国	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	

国都证 券	1	-	-	-	-	
国金证 券	2	-	-	-	-	
国泰海 通	4	-	-	-	-	
国投证 券	2	-	-	-	-	
国新证 券	2	-	-	-	-	
国信证 券	2	-	-	-	-	
华泰证 券	2	-	-	-	-	
华鑫证 券	3	-	-	-	-	
上海证 券	1	-	-	-	-	
申万宏 源证券	1	-	-	-	-	
西南证 券	1	-	-	-	-	
兴业证 券	1	-	-	-	-	
银河证 券	5	-	-	-	-	
中金财 富	1	-	-	-	-	
中金公 司	2	-	-	-	-	
中泰证 券	1	-	-	-	-	
中信建 投证券	1	-	-	-	-	
中信证 券	1	-	-	-	-	
中银国 际	1	-	-	-	-	

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

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 (%)
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万	-	-	-	-	-	-	-	-

宏源 证券									
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

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

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券为申购赎回代理券商的公告	上证报,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 01 月 14 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第四季度报告	上交所,深交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站,上证报	2025 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券为申购赎回代理券商的公告	上证报,上交所,深交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 13 日
4	汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	上交所,中证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日
5	汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2025 年 3 月 26 日更新）	上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 26 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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	公司网站,中国证监会基金电子披露网站,上证报,上交所,深交所	2025 年 04 月 30 日
10	关于汇添富基金管理股份有限公	上证报,公司网站,中	2025 年 06 月 16 日

	司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	中国证监会基金电子披露网站	
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,深交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年06月23日
12	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行(中国)有限公司合作关系的公告	上证报,中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025年06月26日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	深交所,上交所,上证报,中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025年07月15日
14	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
15	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
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西部证券为申购赎回代理券商的公告	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08月06日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东方证券为申购赎回代理券商的公告	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08月06日
18	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
19	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
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西南证券为申购赎回代理券商的公告	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09月10日
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加甬兴证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站,深交所,上交所,公司网站,上证报	2025年09月15日

22	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加民生证券为申购赎回代理券商的公告	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 10 月 27 日
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国联民生为申购赎回代理券商的公告	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 10 月 27 日
24	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
25	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2025 年 11 月 14 日
26	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2025 年 11 月 14 日
27	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,上证报	2025 年 11 月 17 日
28	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,上交所	2025 年 11 月 20 日
29	汇添富基金管理股份有限公司关于设立汇添富基金销售(上海)有限公司的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所,上证报	2025 年 12 月 24 日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所基金变更扩位证券简称的公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上交所,上证报	2025 年 12 月 29 日
31	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 12 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

注：无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

13.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 03 月 31 日