汇添富上证综合指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....6
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....6
3.1 主要会计数据和财务指标.....6
3.2 基金净值表现.....7
§4 管理人报告.....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遵规守信情况的说明.....16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....16
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.....17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....18
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....18
§5 托管人报告.....19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....19
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.....19
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....19
6.1 资产负债表.....19
6.2 利润表.....20
6.3 净资产变动表.....22
6.4 报表附注.....23
§7 投资组合报告.....52
7.1 期末基金资产组合情况.....52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....52
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....75
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....76
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....76
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....76
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....76

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....76
7.12 投资组合报告附注.....76
§8 基金份额持有人信息.....77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....78
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....78
§9 开放式基金份额变动.....78
§10 重大事件揭示.....79
10.1 基金份额持有人大会决议.....79
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....79
10.4 基金投资策略的改变.....79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....79
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....80
10.8 其他重大事件.....83
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....84
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....84
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....84
§12 备查文件目录.....84
12.1 备查文件目录.....84
12.2 存放地点.....85
12.3 查阅方式.....85

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合指数证券投资基金	
基金简称	汇添富上证综合指数	
基金主代码	470007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 07 月 01 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）	892,570,078.94	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C
下属分级基金的交易代码	470007	018536
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	822,930,325.23	69,639,753.71

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 6%，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准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，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。本基金的投资策略主要包括：资产配置、抽样股票组合构建、股票组合调整、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	上证综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

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	郭明
	联系电话	021-28932888	（010）66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号　汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路 728 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日)	
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C
本期已实现收益	39,789,643.57	2,617,094.84
本期利润	30,982,873.33	1,594,762.80
加权平均基金份额本期利润	0.0360	0.0249
本期加权平均净值利润率	3.28%	2.29%
本期基金份额净值增长率	3.40%	3.15%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	115,095,205.65	9,016,082.80
期末可供分配基金份额利润	0.1399	0.1295
期末基金资产净值	938,025,530.88	78,655,836.51
期末基金份额净值	1.140	1.129
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	56.57%	10.02%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富上证综合指数 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.26%	0.52%	2.75%	0.52%	0.51%	0.00%
过去三个月	4.01%	1.04%	3.12%	1.06%	0.89%	-0.02%
过去六个月	3.40%	0.92%	2.66%	0.94%	0.74%	-0.02%
过去一年	16.36%	1.17%	15.34%	1.21%	1.02%	-0.04%
过去三年	9.46%	0.93%	1.51%	0.95%	7.95%	-0.02%
自基金合同生效起至	56.57%	1.23%	17.67%	1.22%	38.90%	0.01%

今						
汇添富上证综合指数 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.20%	0.51%	2.75%	0.52%	0.45%	-0.01%
过去三个月	3.86%	1.03%	3.12%	1.06%	0.74%	-0.03%
过去六个月	3.15%	0.92%	2.66%	0.94%	0.49%	-0.02%
过去一年	15.84%	1.17%	15.34%	1.21%	0.50%	-0.04%
自基金合同生效起至今	10.02%	0.98%	4.83%	1.01%	5.19%	-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

注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2009 年 07 月 01 日）起 3 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。

本基金于 2023 年 05 月 19 日新增 C 类份额。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司、汇添富投资管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2025 上半年,汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 363 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监	2010 年 02 月 06 日	-	19	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的

					基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。

					2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数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 日至今任汇添富中证 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 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 日至今任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 22 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳丰回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024

					年 12 月 10 日至 2024 年 12 月 11 日任汇添富中证 A500 指数型证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 3 月 27 日至今任汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。

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

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	13	18,477,998,430.56	2010 年 2 月 6 日
	私募资产管理计划	1	10,373,627.74	2025 年 3 月 11 日
	其他组合	-	-	
	合计	14	18,488,372,058.30	

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。本报告期内兼任投资人员有产品

离任情况，离任产品情况如下：

吴振翔—离任产品类型：公募基金，离任数量：1 只，离任时间：2025 年 3 月 21 日；离任产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0 只，离任时间：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 4 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易

数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，A 股市场震荡较大的阶段主要是年初和 4 月初，其它阶段都是稳步修复性上涨态势，各宽基指数整体表现较好。风格上小盘优于大盘，成长优于价值，当前经济在结构转型阶段，市场往往也呈现出结构性特征。细分板块方面，科技、创新药等板块是阶段性市场关注焦点。

宏观经济上，外部环境是全球关税政策突发、地缘冲突等不确定因素持续冲击，但国内环境还是处于政策组合效应持续释放，整体上国民经济保持总体平稳、稳中有进的发展态势。货币、财政、房地产、资本市场等一系列政策的推出，对于稳市场、稳预期发挥了重要作用。

虽然有外部环境不确定性的影响，但是在政策支持、基本面改善等因素的驱动下，上半年国内经济增长仍然实现了较好的结果，经济温和修复的背景下，上市公司基本面预期表现稳健，权益资产表现也得到了较好的支撑，当前 A 股主要宽基指数估值适中，具有较好的投资价值。

上证综合指数是 A 股市场代表性宽基指数，汇添富上证综合指数基金则是这一代表性指数的产品化形式，为投资者提供了整体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，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

本报告期汇添富上证综合指数 A 类份额净值增长率为 3.40%，同期业绩比较基准收益率为 2.66%。本报告期汇添富上证综合指数 C 类份额净值增长率为 3.15%，同期业绩比较基准收益率为 2.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前外部环境出现了多方挑战，美国关税政策、地缘冲突等因素对全球的影响存在反复的可能。国内来看，2025 年上半年宏观经济温和修复，预计下半年有望保持韧性，CPI 数据上半年稳步增长，半年末社零数据明显走强，体现出内需修复的韧性。尽管生产端的 PPI 数据仍体现出一定压力，展望下半年，“反内卷”等政策有助于推进全国统一大市场建设，

依法治理企业低价无序竞争，引导企业提升产品品质，相关价格条件或能有所改善。

当前权益市场交投较为活跃，随着经济环境的持续改善，市场风险偏好有望进一步提升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金同一类别内每一基金份额享有同等分配权；收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转帐或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额；本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次至少将可供分配利润的 20%进行收益分配；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，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；在符合上述基金收益分配的前提下，每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20%进行收益分配，且在收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）之后的 15 个工作日之内完成；基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内，本基金于 2025 年 01 月 14 日实施利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.270 元人民币;C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.270 元人民币。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 托管人对中期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 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	79,788,710.40	54,044,331.25
结算备付金		32,563.23	1,859.97
存出保证金		39,071.02	73,619.75
交易性金融资产	6.4.7.2	966,967,534.53	1,031,789,612.90
其中：股票投资		959,075,894.86	1,025,944,595.37
基金投资		-	-
债券投资		7,891,639.67	5,845,017.53
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	4,815,780.73
应收股利		-	-
应收申购款		8,084,752.16	1,749,225.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,054,912,631.34	1,092,474,430.02
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 06 月 30 日**	**上年度末 2024 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		35,242,665.28	-
应付赎回款		2,117,679.99	3,493,375.11
应付管理人报酬		607,169.63	691,600.93
应付托管费		121,433.93	138,320.18
应付销售服务费		17,364.38	26,547.92
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	6.4.7.7	124,950.74	222,296.04
负债合计		38,231,263.95	4,572,140.18
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	892,570,078.94	962,457,344.94
未分配利润	6.4.7.9	124,111,288.45	125,444,944.90
净资产合计		1,016,681,367.39	1,087,902,289.84
负债和净资产总计		1,054,912,631.34	1,092,474,430.02

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 892,570,078.94 份。本基金下属汇添富上证综合指数 A 基金份额净值 1.140 元，基金份额总额 822,930,325.23 份；本基金下属汇添富上证综合指数 C 基金份额净值 1.129 元，基金份额总额 69,639,753.71 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		**37,328,124.17**	**28,031,737.07**
1.利息收入		91,137.13	96,937.14
其中：存款利息收入	6.4.7.10	91,137.13	96,937.14
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）		46,859,225.52	11,156,068.60
其中：股票投资收益	6.4.7.11	32,196,724.00	-1,381,787.73
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	48,589.81	9,908.99
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	14,613,911.71	12,527,947.34
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-9,829,102.28	16,567,361.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	206,863.80	211,369.93
减：二、营业总支出		**4,750,488.04**	**4,280,884.74**
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,770,682.96	3,429,776.79
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	754,136.54	685,955.35
3．销售服务费		139,157.22	73,835.60
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.21	86,511.32	91,317.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**32,577,636.13**	**23,750,852.33**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**32,577,636.13**	**23,750,852.33**

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		**32,577,636.13**	**23,750,852.33**

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	962,457,344.94	125,444,944.90	1,087,902,289.84
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	962,457,344.94	125,444,944.90	1,087,902,289.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-69,887,266.00	-1,333,656.45	-71,220,922.45
（一）、综合收益总额	-	32,577,636.13	32,577,636.13
（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）	-69,887,266.00	-7,782,416.06	-77,669,682.06
其中：1.基金申购款	255,614,255.94	22,551,248.27	278,165,504.21
2.基金赎回款	-325,501,521.94	-30,333,664.33	-355,835,186.27
（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）	-	-26,128,876.52	-26,128,876.52
四、本期期末净资产	892,570,078.94	124,111,288.45	1,016,681,367.39
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	892,624,305.06	-15,823,518.78	876,800,786.28

加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	892,624,305.06	-15,823,518.78	876,800,786.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	65,290,023.28	20,640,789.44	85,930,812.72
（一）、综合收益总额	-	23,750,852.33	23,750,852.33
（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）	65,290,023.28	-3,110,062.89	62,179,960.39
其中：1.基金申购款	413,793,455.71	-1,782,428.33	412,011,027.38
2.基金赎回款	-348,503,432.43	-1,327,634.56	-349,831,066.99
（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	957,914,328.34	4,817,270.66	962,731,599.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富上证综合指数证券投资基金（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[2009]371 号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》准予注册，由汇添富基金管理有限公司（现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 2009 年 7 月 1 日生效。首次设立基金募集规模为 9,097,758,651.47 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（2009）验字第 60466941_B02 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自 2023 年 5 月 19 日起，本基金增设 C 类基金份额，原基金份额变更为 A 类基金份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

2.增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点

的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3.城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4.企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权

的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	79,788,710.40
等于：本金	79,783,580.18
加：应计利息	5,130.22
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	79,788,710.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		857,937,807.83	-	959,075,894.86	101,138,087.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,816,040.00	91,839.67	7,891,639.67	-16,240.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	7,816,040.00	91,839.67	7,891,639.67	-16,240.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		865,753,847.83	91,839.67	966,967,534.53	101,121,847.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,263.60
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	33,400.82
其中：交易所市场	33,400.82
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	26,778.95
应付信息披露费	59,507.37
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	124,950.74

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富上证综合指数 A		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	878,654,902.79	878,654,902.79
本期申购	137,648,914.34	137,648,914.34
本期赎回（以“-”号填列）	-193,373,491.90	-193,373,491.90
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	822,930,325.23	822,930,325.23
汇添富上证综合指数 C		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,802,442.15	83,802,442.15
本期申购	117,965,341.60	117,965,341.60
本期赎回（以“-”号填列）	-132,128,030.04	-132,128,030.04
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	69,639,753.71	69,639,753.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富上证综合指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	367,784,934.75	-252,653,489.63	115,131,445.12
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	367,784,934.75	-252,653,489.63	115,131,445.12
本期利润	39,789,643.57	-8,806,770.24	30,982,873.33
本期基金份额交易产生的变动数	-23,131,663.11	16,081,410.57	-7,050,252.54
其中：基金申购款	57,129,460.11	-45,470,045.87	11,659,414.24
基金赎回款	-80,261,123.22	61,551,456.44	-18,709,666.78
本期已分配利润	-23,968,860.26	-	-23,968,860.26
本期末	360,474,054.95	-245,378,849.30	115,095,205.65
汇添富上证综合指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,425,437.45	-24,111,937.67	10,313,499.78
加：会计政策变更	-	-	-

本期期初	34,425,437.45	-24,111,937.67	10,313,499.78
本期利润	2,617,094.84	-1,022,332.04	1,594,762.80
本期基金份额交易产生的变动数	-5,089,812.55	4,357,649.03	-732,163.52
其中：基金申购款	48,695,120.69	-37,803,286.66	10,891,834.03
基金赎回款	-53,784,933.24	42,160,935.69	-11,623,997.55
本期已分配利润	-2,160,016.26	-	-2,160,016.26
本期末	29,792,703.48	-20,776,620.68	9,016,082.80

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	90,085.46
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	654.61
其他	397.06
合计	91,137.13

注:“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	392,086,165.65
减：卖出股票成本总额	359,528,859.36
减：交易费用	360,582.29
买卖股票差价收入	32,196,724.00

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

债券投资收益——利息收入	48,589.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	48,589.81

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	14,613,911.71
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	14,613,911.71

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	-9,829,102.28
——股票投资	-9,819,822.28
——债券投资	-9,280.00
——资产支持证券投资	-

——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,829,102.28

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	206,863.80
替代损益	-
其他	-
合计	206,863.80

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	26,778.95
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	225.00
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	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	-

合计	86,511.32

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告和实施的利润分配的情况如下：

本基金向截止 2025 年 07 月 11 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，汇添富上证综合指数 A 份额每 10 份基金份额派发红利 0.2800 元;汇添富上证综合指数 C 份额每 10 份基金份额派发红利 0.2600 元。

截至财务报表批准日，除上述事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	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	47,194,544.13	6.84	6,681,642.27	3.88

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	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	8,301.98	6.84	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	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	4,916.76	3.88	-	-

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,770,682.96	3,429,776.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,310,168.18	1,173,844.58
应支付基金管理人的净管理费	2,460,514.78	2,255,932.21

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.75%÷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基金管理人的授权委托书，于次月前 2 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、公休假等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	754,136.54	685,955.35

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%÷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，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 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、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	合计

汇添富基金管理股份有限公司	-	4,921.70	4,921.70
东方证券股份有限公司	-	17.25	17.25
合计	-	4,938.95	4,938.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	3,372.03	3,372.03
合计	-	3,372.03	3,372.03

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.4%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4%年费率计提。

计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限

费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	79,788,710.40	90,085.46	55,881,222.18	94,498.29

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

汇添富上证综合指数 A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 01 月 14 日		2025 年 01 月 14 日	0.2700	14,355,765.58	9,613,094.68	23,968,860.26	
合计	-	-		0.2700	14,355,765.58	9,613,094.68	23,968,860.26	
汇添富上证综合指数 C								
序号	权益登记	除息日		每 10 份基金份	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场	场外					

	日	内		额分红数				
1	2025 年 01 月 14 日		2025 年 01 月 14 日	0.2700	1,981,052.54	178,963.72	2,160,016.26	
合计	-	-		0.2700	1,981,052.54	178,963.72	2,160,016.26	

注：于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
603049	中策橡胶	2025 年 05 月 27 日	6 个月	新股流通受限	46.50	42.85	478	22,227.00	20,482.30	
688775	影石创新	2025 年 06 月 04 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	
6.4.12.1.2 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
					-	-	-	-	-	

6.4.12.2 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
603758	秦安股份	2025 年 06 月 30 日	重大事项停牌	16.48	2025 年 07 月 11 日	16.00	83,900	1,033,712.19	1,382,672.00	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2025年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	79,788,710.40	-	-	-	-	-	79,788,710.40
结算备付金	32,563.23	-	-	-	-	-	32,563.23
存出保证金	39,071.02	-	-	-	-	-	39,071.02
交易	5,873,693.37	-	2,017,946.30	-	-	959,075,894.86	966,967,534.53

性金融资产							
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	-	-	-	-	-	8,084,752.16	8,084,752.16
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	85,734,038.02	-	2,017,946.30	-	-	967,160,647.02	1,054,912,631.34
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	-	-	-	-	-	35,242,665.28	35,242,665.28
应付赎	-	-	-	-	-	2,117,679.99	2,117,679.99

回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	607,169.63	607,169.63
应付托管费	-	-	-	-	-	121,433.93	121,433.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,364.38	17,364.38
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其	-	-	-	-	-	124,950.74	124,950.74

他负债							
负债总计	-	-	-	-	-	38,231,263.95	38,231,263.95
利率敏感度缺口	85,734,038.02	-	2,017,946.30	-	-	928,929,383.07	1,016,681,367.39
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	54,044,331.25	-	-	-	-	-	54,044,331.25
结算备付金	1,859.97	-	-	-	-	-	1,859.97
存出保证金	73,619.75	-	-	-	-	-	73,619.75
交易性金	-	-	5,845,017.53	-	-	1,025,944,595.37	1,031,789,612.90

融资产							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	4,815,780.73	4,815,780.73
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,749,225.42	1,749,225.42
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-

资产							
资产总计	54,119,810.97	-	5,845,017.53	-	-	1,032,509,601.52	1,092,474,430.02
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	-	-	-	-	-	3,493,375.11	3,493,375.11

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	691,600.93	691,600.93
应付托管费	-	-	-	-	-	138,320.18	138,320.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-	26,547.92	26,547.92
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	-	-	-	-	-	222,296.04	222,296.04

债							
负债总计	-	-	-	-	-	4,572,140.18	4,572,140.18
利率敏感度缺口	54,119,810.97	-	5,845,017.53	-	-	1,027,937,461.34	1,087,902,289.84

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4.银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5.该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	2,616.13	8,162.03
	基准利率增加 25 个基点	-2,613.15	-8,139.16

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格

因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	959,075,894.86	94.33	1,025,944,595.37	94.30
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	7,891,639.67	0.78	5,845,017.53	0.54
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	966,967,534.53	95.11	1,031,789,612.90	94.84

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	上证综合指数上涨 5%	46,861,307.08	49,601,319.30
	上证综合指数下跌 5%	-46,861,307.08	-49,601,319.30

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 06 月 30 日
第一层次	957,601,596.88
第二层次	9,274,311.67
第三层次	91,625.98
合计	966,967,534.53

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	959,075,894.86	90.92
	其中：股票	959,075,894.86	90.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,891,639.67	0.75
	其中：债券	7,891,639.67	0.75
	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	79,821,273.63	7.57
8	其他各项资产	8,123,823.18	0.77
9	合计	1,054,912,631.34	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,333,777.90	0.13
B	采矿业	76,563,508.83	7.53
C	制造业	384,754,462.18	37.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,830,073.83	4.80
E	建筑业	24,402,170.15	2.40
F	批发和零售业	11,748,075.21	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	44,992,430.64	4.43
H	住宿和餐饮业	1,128,987.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,298,365.81	6.23
J	金融业	271,841,016.01	26.74
K	房地产业	9,208,484.10	0.91
L	租赁和商务服务业	7,849,321.85	0.77
M	科学研究和技术服务业	4,354,277.89	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	4,425,080.20	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,038,976.32	0.10

R	文化、体育和娱乐业	3,215,260.96	0.32
S	综合	-	-
	合计	958,984,268.88	94.32

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	91,625.98	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	91,625.98	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	7,576,073	44,547,309.24	4.38
2	600519	贵州茅	23,929	33,728,404.08	3.32

		台			
3	601988	中国银行	5,594,072	31,438,684.64	3.09
4	601857	中国石油	3,108,557	26,578,162.35	2.61
5	600036	招商银行	384,615	17,673,059.25	1.74
6	601628	中国人寿	392,271	16,157,642.49	1.59
7	601328	交通银行	1,952,717	15,621,736.00	1.54
8	601939	建设银行	1,453,411	13,720,199.84	1.35
9	600900	长江电力	452,511	13,638,681.54	1.34
10	601088	中国神华	306,815	12,438,280.10	1.22
11	601728	中国电信	1,481,800	11,483,950.00	1.13
12	601318	中国平安	202,123	11,213,784.04	1.10
13	600028	中国石化	1,868,277	10,537,082.28	1.04
14	601166	兴业银行	405,406	9,462,176.04	0.93
15	601658	邮储银行	1,499,168	8,200,448.96	0.81
16	601138	工业富联	377,300	8,066,674.00	0.79
17	600000	浦发银行	545,492	7,571,428.96	0.74
18	601899	紫金矿业	383,742	7,482,969.00	0.74
19	600030	中信证券	229,950	6,351,219.00	0.62
20	600276	恒瑞医药	119,692	6,212,014.80	0.61
21	601998	中信银行	726,472	6,175,012.00	0.61
22	688041	海光信息	43,608	6,161,374.32	0.61
23	601319	中国人保	662,200	5,767,762.00	0.57

24	688093	世华科技	179,203	5,564,253.15	0.55
25	601816	京沪高铁	910,800	5,237,100.00	0.52
26	600512	腾达建设	2,132,100	4,818,546.00	0.47
27	601601	中国太保	127,978	4,800,454.78	0.47
28	688256	寒武纪科技	7,666	4,611,099.00	0.45
29	601668	中国建筑	774,585	4,469,355.45	0.44
30	603288	海天味业	106,360	4,138,467.60	0.41
31	688589	力合微电子	191,840	4,103,457.60	0.40
32	600919	江苏银行	337,940	4,035,003.60	0.40
33	600809	山西汾酒	22,767	4,015,871.13	0.39
34	603757	大元泵业	171,000	3,895,380.00	0.38
35	601127	赛力斯	29,000	3,895,280.00	0.38
36	601919	中远海控	253,948	3,819,377.92	0.38
37	601225	陕西煤业	190,281	3,661,006.44	0.36
38	603456	九洲药业	237,800	3,616,938.00	0.36
39	601985	中国核电	384,600	3,584,472.00	0.35
40	601818	光大银行	858,567	3,563,053.05	0.35
41	600887	伊利股份	124,061	3,458,820.68	0.34
42	600104	上汽集团	213,800	3,431,490.00	0.34
43	600406	国电南瑞	153,006	3,428,864.46	0.34
44	603259	药明康德	49,120	3,416,296.00	0.34
45	688981	中芯国际	38,023	3,352,487.91	0.33

46	600050	中国联通	613,442	3,275,780.28	0.32
47	600025	华能水电	342,200	3,268,010.00	0.32
48	601766	中国中车	453,661	3,193,773.44	0.31
49	600309	万华化学	58,511	3,174,806.86	0.31
50	603676	卫信康	312,900	3,169,677.00	0.31
51	600016	民生银行	657,608	3,123,638.00	0.31
52	600760	中航沈飞	52,752	3,092,322.24	0.30
53	605499	东鹏饮料	9,760	3,065,128.00	0.30
54	603444	吉比特	10,000	3,019,500.00	0.30
55	603501	豪威集团	23,220	2,964,033.00	0.29
56	601066	中信建投	122,690	2,950,694.50	0.29
57	600690	海尔智家	116,700	2,891,826.00	0.28
58	600031	三一重工	159,894	2,870,097.30	0.28
59	603993	洛阳钼业	338,539	2,850,498.38	0.28
60	601229	上海银行	268,606	2,849,909.66	0.28
61	600150	中国船舶	84,500	2,749,630.00	0.27
62	600019	宝钢股份	412,643	2,719,317.37	0.27
63	601169	北京银行	391,272	2,672,387.76	0.26
64	601211	国泰海通	139,239	2,667,819.24	0.26
65	688330	宏力达信息	99,600	2,557,728.00	0.25
66	601633	长城汽车	117,825	2,530,881.00	0.25
67	600018	上港集团	434,990	2,483,792.90	0.24
68	600353	旭光电	184,300	2,458,562.00	0.24

		子			
69	600999	招商证券	139,486	2,453,558.74	0.24
70	601688	华泰证券	136,960	2,439,257.60	0.24
71	688219	会通股份	193,600	2,429,680.00	0.24
72	600015	华夏银行	304,981	2,412,399.71	0.24
73	601009	南京银行	201,776	2,344,637.12	0.23
74	601881	中国银河	136,004	2,332,468.60	0.23
75	688111	金山办公	8,265	2,314,613.25	0.23
76	601336	新华保险	39,355	2,302,267.50	0.23
77	601231	环旭电子	156,578	2,290,736.14	0.23
78	600905	三峡能源	535,900	2,282,934.00	0.22
79	601888	中国中免	37,205	2,268,388.85	0.22
80	601077	渝农商行	316,278	2,258,224.92	0.22
81	601006	大秦铁路	341,344	2,252,870.40	0.22
82	600570	恒生电子	67,040	2,248,521.60	0.22
83	600436	片仔癀	11,237	2,247,512.37	0.22
84	603639	海利尔	159,900	2,246,595.00	0.22
85	688012	中微半导体设备	12,216	2,226,976.80	0.22
86	600926	杭州银行	131,680	2,214,857.60	0.22
87	603323	苏农银行	394,790	2,214,771.90	0.22
88	600547	山东黄金	69,290	2,212,429.70	0.22
89	603589	口子窖	63,500	2,209,800.00	0.22
90	600989	宝丰能源	136,600	2,204,724.00	0.22

91	601012	隆基绿能	143,859	2,160,762.18	0.21
92	601390	中国中铁	385,128	2,160,568.08	0.21
93	688127	蓝特光学	84,000	2,159,640.00	0.21
94	600363	联创光电	36,900	2,152,377.00	0.21
95	600660	福耀玻璃	37,730	2,150,987.30	0.21
96	688550	瑞联新材料	49,310	2,120,823.10	0.21
97	600415	小商品城	101,400	2,096,952.00	0.21
98	603383	顶点软件	49,400	2,094,560.00	0.21
99	688019	安集科技	13,762	2,089,071.60	0.21
100	601727	上海电气	280,800	2,075,112.00	0.20
101	600941	中国移动	18,300	2,059,665.00	0.20
102	600886	国投电力	138,605	2,043,037.70	0.20
103	601995	中金公司	57,500	2,033,200.00	0.20
104	688271	联影医疗	15,722	2,008,328.28	0.20
105	601989	中国重工	426,629	1,979,558.56	0.19
106	601800	中国交建	221,639	1,970,370.71	0.19
107	600893	航发动力	51,052	1,967,544.08	0.19
108	600866	星湖科技	280,900	1,941,019.00	0.19
109	603019	中科曙光	27,500	1,936,000.00	0.19
110	600048	保利发展	238,669	1,933,218.90	0.19
111	603730	岱美股份	336,618	1,915,356.42	0.19
112	601916	浙商银行	563,843	1,911,427.77	0.19

113	600346	恒力石化	133,889	1,909,257.14	0.19
114	603040	新坐标	47,190	1,895,622.30	0.19
115	600499	科达制造	189,500	1,857,100.00	0.18
116	601898	中煤能源	169,687	1,856,375.78	0.18
117	600643	爱建集团	249,700	1,852,774.00	0.18
118	688080	映翰通网络	36,400	1,852,396.00	0.18
119	600039	四川路桥	186,400	1,845,360.00	0.18
120	600029	南方航空	312,541	1,843,991.90	0.18
121	600563	法拉电子	16,900	1,843,621.00	0.18
122	600219	南山铝业	481,049	1,842,417.67	0.18
123	601186	中国铁建	229,259	1,836,364.59	0.18
124	601375	中原证券	440,100	1,830,816.00	0.18
125	601698	中国卫通	88,800	1,817,736.00	0.18
126	601886	江河集团	295,200	1,815,480.00	0.18
127	603160	汇顶科技	25,500	1,811,265.00	0.18
128	603927	中科软	93,200	1,802,488.00	0.18
129	603115	海星股份	124,800	1,800,864.00	0.18
130	600897	厦门空港	123,420	1,800,697.80	0.18
131	601111	中国国航	228,081	1,799,559.09	0.18
132	601168	西部矿业	107,300	1,784,399.00	0.18
133	600300	维维股份	520,700	1,770,380.00	0.17
134	688616	西力科技	139,036	1,768,537.92	0.17
135	600770	综艺股	332,600	1,762,780.00	0.17

		份			
136	600585	海螺水泥	82,081	1,762,279.07	0.17
137	601860	紫金银行	579,300	1,737,900.00	0.17
138	600642	申能股份	202,080	1,737,888.00	0.17
139	688305	科德数控	30,960	1,727,877.60	0.17
140	688029	南微医学科技	25,461	1,719,890.55	0.17
141	600489	中金黄金	117,343	1,716,728.09	0.17
142	600795	国电电力	353,528	1,711,075.52	0.17
143	603195	公牛集团	35,419	1,708,966.75	0.17
144	688036	传音控股	21,433	1,708,210.10	0.17
145	600064	南京高科	219,600	1,693,116.00	0.17
146	601577	长沙银行	169,400	1,683,836.00	0.17
147	601600	中国铝业	239,165	1,683,721.60	0.17
148	600699	均胜电子	96,400	1,681,216.00	0.17
149	603920	世运电路	55,100	1,681,101.00	0.17
150	603893	瑞芯微	11,000	1,670,460.00	0.16
151	601669	中国电建	342,983	1,670,327.21	0.16
152	601018	宁波港	454,974	1,665,204.84	0.16
153	688261	东微半导体	40,200	1,658,250.00	0.16
154	600020	中原高速	346,900	1,658,182.00	0.16
155	603855	华荣股份	74,400	1,646,472.00	0.16
156	601689	拓普集团	34,795	1,644,063.75	0.16
157	688258	江苏卓易信息	33,853	1,639,500.79	0.16

		科技			
158	603948	建业股份	68,600	1,636,110.00	0.16
159	600282	南钢股份	389,200	1,634,640.00	0.16
160	600438	通威股份	96,885	1,622,823.75	0.16
161	603596	伯特利	30,780	1,621,798.20	0.16
162	600908	无锡银行	253,200	1,597,692.00	0.16
163	600098	广州发展	255,400	1,596,250.00	0.16
164	600901	江苏金租	262,900	1,593,174.00	0.16
165	601058	赛轮轮胎	121,000	1,587,520.00	0.16
166	600909	华安证券	271,350	1,581,970.50	0.16
167	600875	东方电气	93,499	1,565,173.26	0.15
168	688259	创耀通信科技	39,400	1,562,210.00	0.15
169	600188	兖矿能源	127,663	1,553,658.71	0.15
170	600011	华能国际	216,796	1,547,923.44	0.15
171	688233	神工半导体	48,606	1,544,212.62	0.15
172	600009	上海机场	48,565	1,542,910.05	0.15
173	600208	衢州发展	514,910	1,524,133.60	0.15
174	688681	科汇电力自动化	108,600	1,520,400.00	0.15
175	600549	厦门钨业	72,600	1,518,792.00	0.15
176	688400	凌云光技术	55,066	1,518,169.62	0.15
177	601717	郑煤机	90,900	1,510,758.00	0.15
178	603898	好莱客	136,300	1,497,937.00	0.15
179	603650	彤程新材	46,500	1,494,975.00	0.15

180	688419	耐科装备	40,035	1,492,504.80	0.15
181	600863	内蒙华电	363,000	1,491,930.00	0.15
182	600362	江西铜业	63,532	1,488,554.76	0.15
183	600741	华域汽车	84,250	1,487,012.50	0.15
184	603328	依顿电子	151,500	1,486,215.00	0.15
185	600177	雅戈尔	202,291	1,476,724.30	0.15
186	688722	同益中新材料	69,400	1,476,138.00	0.15
187	603856	东宏股份	128,700	1,473,615.00	0.14
188	688078	龙软科技	46,485	1,473,574.50	0.14
189	600269	赣粤高速	290,800	1,471,448.00	0.14
190	600835	上海机电	69,100	1,468,375.00	0.14
191	688128	中国电器研究院	59,710	1,462,895.00	0.14
192	600483	福能股份	150,800	1,453,712.00	0.14
193	688223	晶科能源	278,698	1,446,442.62	0.14
194	601963	重庆银行	132,300	1,436,778.00	0.14
195	603416	信捷电气	25,500	1,429,785.00	0.14
196	601555	东吴证券	163,072	1,426,880.00	0.14
197	600033	福建高速	400,100	1,416,354.00	0.14
198	600061	国投资本	187,113	1,407,089.76	0.14
199	600623	华谊集团	184,600	1,397,422.00	0.14
200	600115	中国东航	345,026	1,390,454.78	0.14
201	688571	杭华油墨股份	180,000	1,387,800.00	0.14

202	603885	吉祥航空	102,900	1,386,063.00	0.14
203	603758	秦安股份	83,900	1,382,672.00	0.14
204	600776	东方通信	124,100	1,382,474.00	0.14
205	601369	陕鼓动力	157,200	1,378,644.00	0.14
206	600845	宝信软件	58,340	1,377,990.80	0.14
207	688516	奥特维科技	41,400	1,376,136.00	0.14
208	603506	南都物业	103,600	1,351,980.00	0.13
209	600035	楚天高速	318,200	1,349,168.00	0.13
210	600885	宏发股份	60,284	1,344,936.04	0.13
211	600633	浙数文化	96,400	1,334,176.00	0.13
212	600598	北大荒	92,495	1,333,777.90	0.13
213	688598	金博碳素股份	52,210	1,327,178.20	0.13
214	688619	罗普特科技	99,171	1,318,974.30	0.13
215	600674	川投能源	82,200	1,318,488.00	0.13
216	600584	长电科技	39,071	1,316,301.99	0.13
217	603871	嘉友国际	121,928	1,310,726.00	0.13
218	600928	西安银行	333,800	1,308,496.00	0.13
219	600717	天津港	286,551	1,306,672.56	0.13
220	601298	青岛港	150,100	1,304,369.00	0.13
221	600820	隧道股份	213,100	1,299,910.00	0.13
222	600997	开滦股份	220,000	1,295,800.00	0.13
223	601222	林洋能源	226,500	1,291,050.00	0.13
224	688523	航天环宇科技	60,000	1,290,600.00	0.13

225	600493	凤竹纺织	202,400	1,287,264.00	0.13
226	601311	骆驼股份	142,300	1,284,969.00	0.13
227	600017	日照港	414,200	1,284,020.00	0.13
228	601117	中国化学	167,127	1,281,864.09	0.13
229	601360	三六零	125,500	1,280,100.00	0.13
230	605123	派克新材	16,400	1,277,560.00	0.13
231	600251	冠农股份	167,300	1,276,499.00	0.13
232	600516	方大炭素	275,100	1,276,464.00	0.13
233	603797	联泰环保	285,000	1,273,950.00	0.13
234	600323	瀚蓝环境	52,292	1,273,310.20	0.13
235	600352	浙江龙盛	124,722	1,267,175.52	0.12
236	603367	辰欣药业	90,200	1,264,604.00	0.12
237	600497	驰宏锌锗	238,585	1,262,114.65	0.12
238	601108	财通证券	159,550	1,262,040.50	0.12
239	688543	国科军工	20,840	1,254,359.60	0.12
240	600522	中天科技	86,573	1,251,845.58	0.12
241	603321	梅轮电梯	159,200	1,241,760.00	0.12
242	600757	长江传媒	133,307	1,237,088.96	0.12
243	601607	上海医药	69,095	1,235,418.60	0.12
244	601868	中国能建	553,374	1,234,024.02	0.12
245	600528	中铁工业	166,200	1,226,556.00	0.12
246	601366	利群股份	265,900	1,223,140.00	0.12
247	600803	新奥股	64,500	1,219,050.00	0.12

		份			
248	600918	中泰证券	188,700	1,213,341.00	0.12
249	688002	睿创微纳	17,304	1,206,434.88	0.12
250	601877	正泰电器	53,162	1,205,182.54	0.12
251	600548	深高速	114,400	1,197,768.00	0.12
252	600109	国金证券	136,070	1,193,333.90	0.12
253	601997	贵阳银行	190,900	1,191,216.00	0.12
254	600233	圆通速递	92,100	1,187,169.00	0.12
255	600745	闻泰科技	35,400	1,186,962.00	0.12
256	600332	白云山	44,877	1,182,957.72	0.12
257	600469	风神股份	206,800	1,168,420.00	0.11
258	600298	安琪酵母	33,200	1,167,644.00	0.11
259	603986	兆易创新	9,180	1,161,545.40	0.11
260	603301	振德医疗	54,900	1,158,939.00	0.11
261	600089	特变电工	97,109	1,158,510.37	0.11
262	600377	宁沪高速	75,510	1,158,323.40	0.11
263	601811	新华文轩	79,200	1,153,944.00	0.11
264	688028	沃尔德金刚石	53,003	1,150,165.10	0.11
265	600739	辽宁成大	104,500	1,149,500.00	0.11
266	600143	金发科技	111,400	1,148,534.00	0.11
267	600021	上海电力	130,600	1,147,974.00	0.11
268	603678	火炬电子	30,000	1,140,900.00	0.11
269	600420	国药现代	106,800	1,137,420.00	0.11

270	600600	青岛啤酒	16,351	1,135,740.46	0.11
271	601866	中远海发	459,000	1,133,730.00	0.11
272	600258	首旅酒店	79,900	1,128,987.00	0.11
273	688291	金橙子科技	37,200	1,127,532.00	0.11
274	688006	浙江杭可科技	57,817	1,127,431.50	0.11
275	601377	兴业证券	182,098	1,127,186.62	0.11
276	603408	建霖家居	102,100	1,120,037.00	0.11
277	601615	明阳智能	96,700	1,111,083.00	0.11
278	688386	泛亚微透	20,389	1,107,326.59	0.11
279	601139	深圳燃气	173,700	1,104,732.00	0.11
280	603727	博迈科	75,200	1,100,176.00	0.11
281	603309	维力医疗	86,400	1,099,008.00	0.11
282	603809	豪能股份	71,706	1,097,101.80	0.11
283	600330	天通股份	152,200	1,091,274.00	0.11
284	603187	海容冷链	92,520	1,088,035.20	0.11
285	601512	中新集团	148,200	1,084,824.00	0.11
286	600380	健康元	98,300	1,084,249.00	0.11
287	600862	中航高科	41,397	1,079,633.76	0.11
288	601238	广汽集团	144,056	1,078,979.44	0.11
289	688392	骄成超声波	15,800	1,076,454.00	0.11
290	601827	三峰环境	128,000	1,075,200.00	0.11
291	688190	云路先进材料股份	11,600	1,073,696.00	0.11

292	600023	浙能电力	201,379	1,067,308.70	0.10
293	600588	用友网络	79,621	1,064,532.77	0.10
294	600057	厦门象屿	150,800	1,060,124.00	0.10
295	601677	明泰铝业	85,300	1,059,426.00	0.10
296	603010	万盛股份	106,500	1,058,610.00	0.10
297	603039	泛微网络	18,900	1,052,730.00	0.10
298	603368	柳药集团	62,100	1,050,111.00	0.10
299	688268	广东华特气体	20,797	1,047,544.89	0.10
300	600132	重庆啤酒	19,000	1,046,900.00	0.10
301	600859	王府井	75,300	1,045,917.00	0.10
302	688270	浙江臻镭科技股份	22,400	1,042,944.00	0.10
303	600763	通策医疗	25,169	1,038,976.32	0.10
304	600998	九州通	201,834	1,037,426.76	0.10
305	603899	晨光股份	35,700	1,034,943.00	0.10
306	688686	奥普特科技	10,600	1,013,572.00	0.10
307	600456	宝钛股份	32,200	1,012,046.00	0.10
308	600196	复星医药	40,291	1,010,901.19	0.10
309	600790	轻纺城	270,400	1,008,592.00	0.10
310	688468	科美诊断	137,000	1,008,320.00	0.10
311	688272	富吉瑞光电	37,200	1,006,260.00	0.10
312	605090	九丰能源	38,900	1,004,009.00	0.10
313	600597	光明乳业	118,288	994,802.08	0.10
314	605358	立昂微	42,600	992,580.00	0.10

315	600713	南京医药	195,400	988,724.00	0.10
316	601016	节能风电	341,500	986,935.00	0.10
317	600529	山东药玻	44,325	981,355.50	0.10
318	600261	阳光照明	298,900	980,392.00	0.10
319	601107	四川成渝	162,400	977,648.00	0.10
320	603681	永冠新材	65,100	974,547.00	0.10
321	688786	悦安新材	41,788	973,660.40	0.10
322	600183	生益科技	32,053	966,397.95	0.10
323	603053	成都燃气	99,900	960,039.00	0.09
324	600655	豫园股份	172,041	954,827.55	0.09
325	600583	海油工程	174,000	950,040.00	0.09
326	603638	艾迪精密	54,220	948,307.80	0.09
327	600399	抚顺特钢	181,400	946,908.00	0.09
328	601126	四方股份	57,900	942,033.00	0.09
329	603345	安井食品	11,700	940,914.00	0.09
330	688625	呈和科技	30,761	940,671.38	0.09
331	688621	阳光诺和	18,801	937,981.89	0.09
332	600372	中航机载	77,309	932,346.54	0.09
333	603989	艾华集团	60,400	930,160.00	0.09
334	688067	爱威科技	42,617	916,691.67	0.09
335	603113	金能科技	131,900	914,067.00	0.09
336	600761	安徽合力	50,700	899,418.00	0.09

337	601788	光大证券	49,938	897,885.24	0.09
338	605009	豪悦护理	22,420	891,867.60	0.09
339	601158	重庆水务	191,964	890,712.96	0.09
340	600230	沧州大化	84,040	884,941.20	0.09
341	603197	保隆科技	22,600	882,982.00	0.09
342	688601	力芯微股份	22,000	878,900.00	0.09
343	603171	税友股份	20,400	875,364.00	0.09
344	603290	斯达半导	10,760	874,465.20	0.09
345	600131	国网信通	49,300	872,610.00	0.09
346	603700	宁水集团	72,400	867,352.00	0.09
347	603987	康德莱	112,500	866,250.00	0.09
348	601956	东贝集团	132,700	862,550.00	0.08
349	601966	玲珑轮胎	58,417	856,977.39	0.08
350	600178	东安动力	57,300	854,343.00	0.08
351	603075	热威科技股份	42,600	851,574.00	0.08
352	600340	华夏幸福	381,900	847,818.00	0.08
353	601882	海天精工	44,300	846,130.00	0.08
354	603233	大参林	51,421	838,162.30	0.08
355	600582	天地科技	139,500	835,605.00	0.08
356	600740	山西焦化	225,200	835,492.00	0.08
357	600987	航民股份	118,100	834,967.00	0.08
358	600681	百川能源	237,800	834,678.00	0.08
359	600651	飞乐音	185,100	832,950.00	0.08

		响			
360	600418	江淮汽车	20,700	829,863.00	0.08
361	600764	中国海防	24,400	829,600.00	0.08
362	600426	华鲁恒升	38,260	829,094.20	0.08
363	601991	大唐发电	260,841	826,865.97	0.08
364	601900	南方传媒	52,700	824,228.00	0.08
365	603025	大豪科技	58,200	815,964.00	0.08
366	601137	博威合金	45,300	805,887.00	0.08
367	600523	贵航股份	54,400	804,576.00	0.08
368	600141	兴发集团	39,100	802,723.00	0.08
369	688370	丛麟环保科技	42,000	802,620.00	0.08
370	603680	今创集团	70,200	802,386.00	0.08
371	688066	北京航天宏图	40,600	794,948.00	0.08
372	601933	永辉超市	161,400	790,860.00	0.08
373	688366	昊海生物科技	15,309	784,433.16	0.08
374	600780	通宝能源	131,900	782,167.00	0.08
375	603387	基蛋生物	98,000	779,100.00	0.08
376	688099	晶晨半导体	10,934	776,423.34	0.08
377	603225	新凤鸣	72,700	774,255.00	0.08
378	600641	万业企业	55,720	773,393.60	0.08
379	688599	天合光能	53,016	770,322.48	0.08
380	603599	广信股份	71,700	765,039.00	0.08
381	688596	正帆科	22,381	759,163.52	0.07

		技			
382	688016	心脉医疗	8,580	758,643.60	0.07
383	600648	外高桥	69,400	758,542.00	0.07
384	600779	水井坊	17,700	754,728.00	0.07
385	600575	淮河能源	213,800	746,162.00	0.07
386	600486	扬农化工	12,860	745,880.00	0.07
387	688303	大全能源	34,737	740,592.84	0.07
388	603816	顾家家居	29,000	740,080.00	0.07
389	688348	昱能科技	17,200	739,084.00	0.07
390	603786	科博达	13,300	736,953.00	0.07
391	600271	航天信息	79,400	733,656.00	0.07
392	603043	广州酒家	46,700	727,586.00	0.07
393	600861	北京人力	37,500	723,750.00	0.07
394	600879	航天电子	68,300	715,101.00	0.07
395	601101	昊华能源	98,700	714,588.00	0.07
396	600612	老凤祥	14,304	711,624.00	0.07
397	600195	中牧股份	96,700	708,811.00	0.07
398	688662	广东富信科技	19,400	707,130.00	0.07
399	603517	绝味食品	46,100	703,025.00	0.07
400	688588	凌志软件	48,000	699,360.00	0.07
401	601198	东兴证券	62,398	695,737.70	0.07
402	600755	厦门国贸	114,300	691,515.00	0.07
403	600197	伊力特	46,300	690,796.00	0.07
404	688106	金宏气体	38,200	683,398.00	0.07
405	601990	南京证	84,516	682,889.28	0.07

		券			
406	600637	东方明珠	90,700	677,529.00	0.07
407	688318	财富趋势	5,880	675,729.60	0.07
408	600827	百联股份	73,900	675,446.00	0.07
409	603515	欧普照明	37,503	674,678.97	0.07
410	603886	元祖股份	51,400	671,798.00	0.07
411	688276	长春百克生物科技	31,949	670,929.00	0.07
412	603728	鸣志电器	11,300	649,411.00	0.06
413	600308	华泰股份	189,100	646,722.00	0.06
414	600100	同方股份	89,322	646,691.28	0.06
415	603297	永新光学	7,400	646,390.00	0.06
416	603995	甬金股份	36,300	641,784.00	0.06
417	688439	振华风光	11,000	640,750.00	0.06
418	601702	华峰铝业	40,300	640,367.00	0.06
419	600120	浙江东方	105,700	639,485.00	0.06
420	688092	爱科科技股份	27,800	619,940.00	0.06
421	603317	天味食品	55,200	613,824.00	0.06
422	603035	常熟汽饰	46,100	613,130.00	0.06
423	601518	吉林高速	219,400	601,156.00	0.06
424	688689	常州银河微电	26,047	600,904.29	0.06
425	603519	立霸股份	49,300	599,488.00	0.06
426	600586	金晶科技	121,800	588,294.00	0.06

427	688018	乐鑫科技	4,003	584,838.30	0.06
428	601969	海南矿业	80,100	580,725.00	0.06
429	688007	光峰科技	39,837	576,043.02	0.06
430	688628	优利德科技	17,159	575,684.45	0.06
431	601368	绿城水务	117,200	568,420.00	0.06
432	600012	皖通高速	33,400	567,132.00	0.06
433	603128	华贸物流	90,200	559,240.00	0.06
434	600536	中国软件	11,938	558,340.26	0.05
435	688568	中科星图公司	15,496	558,010.96	0.05
436	600211	西藏药业	14,900	548,618.00	0.05
437	600508	上海能源	46,700	546,390.00	0.05
438	601636	旗滨集团	108,300	542,583.00	0.05
439	600611	大众交通	87,000	541,140.00	0.05
440	601865	福莱特	35,400	538,434.00	0.05
441	603185	弘元绿能	36,100	536,085.00	0.05
442	603198	迎驾贡酒	13,100	516,533.00	0.05
443	603833	欧派家居	8,941	504,719.45	0.05
444	688766	普冉半导体	7,568	478,297.60	0.05
445	688582	芯动联科	48	3,225.60	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净

					值比例（%）
1	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
2	603049	中策橡胶	478	20,482.30	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	9,868,346.00	0.91
2	600519	贵州茅台	6,701,306.00	0.62
3	600512	腾达建设	5,573,762.00	0.51
4	688589	力合微电子	5,430,285.06	0.50
5	688093	世华科技	4,839,298.44	0.44
6	603757	大元泵业	4,258,892.00	0.39
7	601288	农业银行	3,882,079.00	0.36
8	603456	九洲药业	3,695,636.00	0.34
9	601988	中国银行	3,408,079.00	0.31
10	601857	中国石油	3,403,735.00	0.31
11	603676	卫信康	3,361,450.00	0.31
12	688330	宏力达信息	3,177,569.91	0.29
13	688219	会通股份	3,107,008.43	0.29
14	688127	蓝特光学	2,927,503.48	0.27
15	601727	上海电气	2,737,823.00	0.25
16	603589	口子窖	2,607,776.10	0.24
17	603927	中科软	2,438,198.04	0.22
18	601211	国泰海通	2,406,259.32	0.22
19	603160	汇顶科技	2,298,415.00	0.21
20	603383	顶点软件	2,296,365.00	0.21

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	11,207,585.00	1.03
2	601988	中国银行	9,278,267.00	0.85
3	600519	贵州茅台	7,759,425.00	0.71
4	601857	中国石油	5,332,508.00	0.49

5	600036	招商银行	3,772,261.00	0.35
6	601939	建设银行	3,663,843.00	0.34
7	601628	中国人寿	3,340,208.00	0.31
8	600900	长江电力	2,898,706.00	0.27
9	600843	上工申贝	2,835,981.00	0.26
10	600030	中信证券	2,765,708.00	0.25
11	688256	寒武纪科技	2,728,231.47	0.25
12	601728	中国电信	2,691,467.00	0.25
13	601211	国泰海通	2,667,830.00	0.25
14	600480	凌云股份	2,517,170.00	0.23
15	601088	中国神华	2,492,004.00	0.23
16	603236	移远通信	2,449,915.00	0.23
17	601318	中国平安	2,369,152.00	0.22
18	605117	德业股份	2,181,192.08	0.20
19	600837	海通证券	2,166,951.32	0.20
20	600611	大众交通	2,159,524.00	0.20

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	302,479,981.13
卖出股票收入（成交）总额	392,086,165.65

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,891,639.67	0.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	7,891,639.67	0.78

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019749	24 国债 15	58,000	5,873,693.37	0.58
2	019758	24 国债 21	20,000	2,017,946.30	0.20

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	39,071.02
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,084,752.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,123,823.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688775	影石创新	71,143.68	0.01	新股流通受限
2	603049	中策橡胶	20,482.30	0.00	新股流通受限

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富上	41,227	19,960.96	7,436,993.79	0.90	815,493,331.44	99.10

证综合指数 A						
汇添富上证综合指数 C	4,914	14,171.70	32,382,849.51	46.50	37,256,904.20	53.50
合计	46,141	19,344.40	39,819,843.30	4.46	852,750,235.64	95.54

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富上证综合指数 A	95,352.19	0.01
	汇添富上证综合指数 C	27.46	0.00
	合计	95,379.65	0.01

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C
基金合同生效日（2009 年 07 月 01 日）基金份额总额	9,097,758,651.47	-
本报告期期初基金份额总额	878,654,902.79	83,802,442.15
本报告期基金总申购份额	137,648,914.34	117,965,341.60
减：本报告期基金总赎回份额	193,373,491.90	132,128,030.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	822,930,325.23	69,639,753.71

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
国信证券	2	328,354,993.93	47.60	57,757.43	47.60	
广发证券	1	127,070,542.16	18.42	22,351.59	18.42	
中信建投证券	3	67,816,853.03	9.83	11,928.01	9.83	
华泰证券	2	59,944,439.63	8.69	10,543.66	8.69	
国泰海通	6	59,470,901.51	8.62	10,460.31	8.62	
东方证券	6	47,194,544.13	6.84	8,301.98	6.84	
财通证券	2	-	-	-	-	
长城证券	2	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东吴证券	1	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
国海证券	2	-	-	-	-	
国联证券	2	-	-	-	-	
恒泰证券	2	-	-	-	-	
华安证	1	-	-	-	-	

券						
摩根大通证券	2	-	-	-	-	
平安证券	3	-	-	-	-	
瑞银证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	3	-	-	-	-	
信达证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	3	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
中金财富	2	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信证券	4	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	1,998,640.00	100.00	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 7 家证券公司的 15 个交易单元：申万宏源证券（深交所单元，上交所单元）、国泰海通（深交所单元，上交所单元，深交所单元，上交所单元）、中金财富（深交所单元，上交所单元）、中信证券（深交所单元，上交所单元）、兴业证券（深交所单元，上交所单元）、平安证券（深交所单元）、中信建投证券（深交所单元，上交所单元）；不再租用 1 家证券公司的 2 个交易单元：太平洋证券（上交所单元，深交所单元）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于汇添富上证综合指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 08 日

2	汇添富上证综合指数证券投资基金收益分配公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 10 日
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富上证综合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。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号　汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2025 年 08 月 29 日