

# 汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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 .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	18
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.....	19
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.....	19
§ 5 托管人报告 .....	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 .....	21
6.3 净资产变动表 .....	22
6.4 报表附注 .....	24
§ 7 投资组合报告.....	55
7.1 期末基金资产组合情况.....	55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	55
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.....	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	79
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
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.....	81
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.....	82
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.....	82
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.....	82

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
7.12 投资组合报告附注.....	82
§ 8 基金份额持有人信息.....	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	84
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	85
8.4 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.....	85
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	85
§ 9 开放式基金份额变动.....	85
§ 10 重大事件揭示.....	86
10.1 基金份额持有人大会决议.....	86
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.....	86
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	86
10.4 基金投资策略的改变.....	86
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	86
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.....	86
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	87
10.8 其他重大事件.....	88
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
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.....	89
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
§ 12 备查文件目录.....	89
12.1 备查文件目录.....	89
12.2 存放地点.....	89
12.3 查阅方式.....	89

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 08 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	324,456,683.54	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）A	汇添富中证 500 指数（LOF）C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	224,470,387.49	99,986,296.05

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。

业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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	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	报告期(2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日)
--------------	--

标	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	-51,438.48	-140,227.28
本期利润	11,078,019.36	4,721,095.43
加权平均基金份额本期利润	0.0458	0.0436
本期加权平均净值利润率	4.20%	4.07%
本期基金份额净值增长率	4.19%	4.08%
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	29,074,427.47	10,957,776.64
期末可供分配基金份额利润	0.1295	0.1096
期末基金资产净值	253,544,814.96	110,944,072.69
期末基金份额净值	1.1295	1.1096
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	12.95%	10.96%

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

汇添富中证 500 指数 (LOF) A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.92%	0.73%	4.09%	0.75%	0.83%	-0.02%
过去三	2.04%	1.42%	0.97%	1.43%	1.07%	-0.01%

个月						
过去六个月	4.19%	1.28%	3.21%	1.29%	0.98%	-0.01%
过去一年	18.84%	1.58%	18.83%	1.64%	0.01%	-0.06%
过去三年	-4.51%	1.26%	-7.61%	1.29%	3.10%	-0.03%
自基金合同生效起至今	12.95%	1.29%	-5.41%	1.32%	18.36%	-0.03%
汇添富中证 500 指数 (LOF) C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.91%	0.73%	4.09%	0.75%	0.82%	-0.02%
过去三个月	1.99%	1.42%	0.97%	1.43%	1.02%	-0.01%
过去六个月	4.08%	1.28%	3.21%	1.29%	0.87%	-0.01%
过去一年	18.61%	1.58%	18.83%	1.64%	-0.22%	-0.06%
过去三年	-5.15%	1.26%	-7.61%	1.29%	2.46%	-0.03%
自基金合同生效起至今	10.96%	1.29%	-5.41%	1.32%	16.37%	-0.03%

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

汇添富中证500指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数（LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



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

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

## § 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	2017 年 08 月 10 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

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

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

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

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

				<p>合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>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。</p> <p>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。</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。</p> <p>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。</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

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 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。

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

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，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

本报告期汇添富中证 500 指数（LOF）A 类份额净值增长率为 4.19%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。本报告期汇添富中证 500 指数（LOF）C 类份额净值增长率为 4.08%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。

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

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

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

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

#### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体:汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	12,272,642.44	7,945,916.30
结算备付金		1,763,676.33	1,410,877.00
存出保证金		909,141.72	1,003,700.02
交易性金融资产	6.4.7.2	348,862,551.48	389,031,245.00
其中：股票投资		339,247,041.34	369,947,187.06
基金投资		-	-
债券投资		9,615,510.14	19,084,057.94
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		3,200,589.04	-
应收股利		-	-
应收申购款		198,662.25	608,342.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		367,207,263.26	400,000,081.09
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	0.73
应付赎回款		2,421,335.98	464,851.50
应付管理人报酬		147,759.42	178,126.83
应付托管费		29,551.89	35,625.37
应付销售服务费		18,160.14	21,546.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	101,567.84	249,519.62

负债合计		2,718,375.61	949,670.84
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	324,456,683.54	369,998,782.31
未分配利润	6.4.7.9	40,032,204.11	29,051,627.94
净资产合计		364,488,887.65	399,050,410.25
负债和净资产总计		367,207,263.26	400,000,081.09

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 324,456,683.54 份。本基金下属汇添富中证 500 指数 (LOF) A 基金份额净值 1.1295 元，基金份额总额 224,470,387.49 份；本基金下属汇添富中证 500 指数 (LOF) C 基金份额净值 1.1096 元，基金份额总额 99,986,296.05 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 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
<b>一、营业总收入</b>		<b>17,146,536.50</b>	<b>-30,279,110.00</b>
1. 利息收入		80,655.00	507,467.75
其中：存款利息收入	6.4.7.10	80,123.39	195,527.12
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		531.61	-
其他利息收入		-	311,940.63
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,071,268.54	-9,232,536.09
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-2,384,963.79	-14,204,951.56
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	77,461.47	7,465.79
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	-10,878.31	-156,008.60
股利收益	6.4.7.17	3,389,649.17	5,120,958.28
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	15,990,780.55	-21,557,779.56
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	3,832.41	3,737.90
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,347,421.71</b>	<b>1,456,585.18</b>

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	941,262.93	991,804.81
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	188,252.61	198,360.96
3. 销售服务费		115,070.77	138,759.86
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		650.24	1,125.78
8. 其他费用	6.4.7.21	102,185.16	126,533.77
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>15,799,114.79</b>	<b>-31,735,695.18</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>15,799,114.79</b>	<b>-31,735,695.18</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>15,799,114.79</b>	<b>-31,735,695.18</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体: 汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 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	369,998,782.31	29,051,627.94	399,050,410.25
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	369,998,782.31	29,051,627.94	399,050,410.25
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-45,542,098.77	10,980,576.17	-34,561,522.60
(一)、综合收益总额	-	15,799,114.79	15,799,114.79
(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)	-45,542,098.77	-4,818,538.62	-50,360,637.39

其中：1. 基金申购款	62,271,717.29	4,495,909.06	66,767,626.35
2. 基金赎回款	-107,813,816.06	-9,314,447.68	-117,128,263.74
(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	324,456,683.54	40,032,204.11	364,488,887.65
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	377,971,777.95	9,407,822.80	387,379,600.75
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	377,971,777.95	9,407,822.80	387,379,600.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,882,551.50	-31,661,052.98	-3,778,501.48
(一)、综合收益总额	-	-31,735,695.18	-31,735,695.18
(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）	27,882,551.50	74,642.20	27,957,193.70
其中：1. 基金申购款	225,105,933.00	-2,233,488.18	222,872,444.82
2. 基金赎回款	-197,223,381.50	2,308,130.38	-194,915,251.12
(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	405,854,329.45	-22,253,230.18	383,601,099.27

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：

<u>张晖</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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]770 号文《关于准予汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效。首次设立基金募集规模为 735,804,689.63 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2017）验字第 60466941\_B29 号验资报告予以验证。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

### 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	12,272,642.44
等于：本金	12,267,558.64
加：应计利息	5,083.80
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	12,272,642.44

#### 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	337,828,522.33	-	339,247,041.34	1,418,519.01	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,497,229.00	98,770.48	9,615,510.14	19,510.66
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	9,497,229.00	98,770.48	9,615,510.14	19,510.66
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	347,325,751.33	98,770.48	348,862,551.48	1,438,029.67	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
(国债期货投资)	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
(外汇期货投资)	-	-	-	-
权益衍生工具	5,572,800.00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	5,572,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,572,800.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2509	IC2509	5	5,775,800.00	203,000.00
合计				203,000.00
减：可抵销期货暂收款				203,000.00
净额				-

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

#### 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	0.01
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	19,744.97
其中：交易所市场	19,744.97
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	22,315.49
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	101,567.84

### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	255,083,544.06	255,083,544.06
本期申购	27,392,359.19	27,392,359.19
本期赎回 (以“-”号填列)	-58,005,515.76	-58,005,515.76
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	224,470,387.49	224,470,387.49
汇添富中证 500 指数 (LOF) 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	114,915,238.25	114,915,238.25
本期申购	34,879,358.10	34,879,358.10
本期赎回 (以“-”号填列)	-49,808,300.30	-49,808,300.30
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	99,986,296.05	99,986,296.05

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

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	67,680,157.31	-46,219,538.64	21,460,618.67
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	67,680,157.31	-46,219,538.64	21,460,618.67
本期利润	-51,438.48	11,129,457.84	11,078,019.36
本期基金份额交易产生的变动数	-8,107,275.88	4,643,065.32	-3,464,210.56
其中：基金申购款	7,259,901.97	-5,136,876.35	2,123,025.62
基金赎回款	-15,367,177.85	9,779,941.67	-5,587,236.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,521,442.95	-30,447,015.48	29,074,427.47
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,297,524.24	-20,706,514.97	7,591,009.27
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	28,297,524.24	-20,706,514.97	7,591,009.27
本期利润	-140,227.28	4,861,322.71	4,721,095.43
本期基金份额交易产生的变动数	-3,657,926.67	2,303,598.61	-1,354,328.06
其中：基金申购款	8,563,108.01	-6,190,224.57	2,372,883.44
基金赎回款	-12,221,034.68	8,493,823.18	-3,727,211.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,499,370.29	-13,541,593.65	10,957,776.64

#### 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	68,830.32
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	10,560.05
其他	733.02
合计	80,123.39

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	97,921,640.64
减：卖出股票成本总额	100,221,262.45
减：交易费用	85,341.98
买卖股票差价收入	-2,384,963.79

### 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	96,101.47
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-18,640.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	77,461.47

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	9,649,968.88
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	9,519,419.00
减：应计利息总额	149,189.88
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-18,640.00

### 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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-10,878.31
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-
国债期货投资收益	-

#### 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	3,389,649.17
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	3,389,649.17

#### 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	15,566,380.55
——股票投资	15,563,821.89
——债券投资	2,558.66
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	424,400.00

——权证投资	-
——期货投资	424,400.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	15,990,780.55

#### 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	3,832.41
替代损益	-
其他	-
合计	3,832.41

#### 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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	3,019.33
指数使用费	17,216.67
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	126.30
合计	102,185.16

## 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

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。

## 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, 基金发起人
招商证券股份有限公司 (“招商证券”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

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 (%)
招商证券	151,544,542.48	100.00	155,086,620.37	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 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	占当期债券成	成交金额	占当期债券成

		交总额的比例 (%)		交总额的比例 (%)
招商证券	1,900,779.00	100.00	701,806.00	100.00

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 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	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
招商证券	5,759,000.00	100.00	-	-

#### 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 (%)
招商证券	26,662.14	100.00	19,744.97	100.00
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 (%)
招商证券	114,131.75	100.00	87,363.44	100.00

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

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，

且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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 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管理费	941,262.93	991,804.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	294,660.82	297,241.85
应支付基金管理人的净管理费	646,602.11	694,562.96

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

##### 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	188,252.61	198,360.96

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送

基金托管费划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 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		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	21,231.91	21,231.91
东方证券股份有限公司	-	3,076.73	3,076.73
招商证券股份有限公司	-	114.49	114.49
合计	-	24,423.13	24,423.13
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		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	20,220.46	20,220.46
东方证券股份有限公司	-	4,644.65	4,644.65
招商证券股份有限公司	-	143.78	143.78
合计	-	25,008.89	25,008.89

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

计算方法如下:

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 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

单位:人民币元

本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	1,254,963.00	0.81~3.50	2.00	988.22	-	-
招商证券	219,390.00	1.70~2.40	2.35	207.12	-	-

#### 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**

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

**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**

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

**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
301590	优优绿能	2025年05月28日	6个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	
301678	新恒汇	2025年06月13日	6个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	
603049	中	2025	6	新	46.50	42.85	174	8,091.00	7,455.90	

	策 橡 胶	年 05 月 27 日	个 月	股 流 通 受 限						
688775	影 石 创 新	2025 年 06 月 04 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	47.27	124.16	295	13,944.65	36,627.20	
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
400174	中 天 3	2023 年 08 月 30 日	重 大 事 项 停 牌	0.01		-	283,500	738,496.28	2,835.00	

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

于 2023 年 6 月 17 日起, 为维护基金持有人利益, 根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定, 依据中天金融集团股份有限公司公开披露的信息, 汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致, 将本基金所持有\*ST 中天 (000540.SZ) 按每股 0.01 元人民币估值。

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

#### **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 202 5 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	12,272,642.44	-	-	-	-	-	12,272,642.44
结算备付金	1,763,676.33	-	-	-	-	-	1,763,676.33
存出保证金	42,771.72	-	-	-	-	866,370.00	909,141.72
交易	3,747,011.29	-	5,868,498.85	-	-	339,247,041.34	348,862,551.48

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	-	-	-	-	-	3,200,589.04	3,200,589.04
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	13,944.39	-	-	-	-	184,717.86	198,662.25
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,840,046.17	-	5,868,498.85	-	-	343,498,718.24	367,207,263.26
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	-	-	-	-	-	2,421,335.98	2,421,335.98

回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	147,759.42	147,759.42
应付托管费	-	-	-	-	-	29,551.89	29,551.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	18,160.14	18,160.14
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	101,567.84	101,567.84

他 负 债							
负 债 总 计	-	-	-	-	-	2,718,375.61	2,718,375.61
利 率 敏 感 度 缺 口	17,840,046.17	-	5,868,498.85	-	-	340,780,342.63	364,488,887.65
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	7,945,916.30	-	-	-	-	-	7,945,916.30
结 算 备 付 金	1,410,877.00	-	-	-	-	-	1,410,877.00
存 出 保 证 金	152,390.02	-	-	-	-	851,310.00	1,003,700.02
交 易 性 金	1,630,577.97	-	17,453,479.97	-	-	369,947,187.06	389,031,245.00

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	51,232.62	-	-	-	-	557,110.15	608,342.77
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-

资产							
资产总计	11,190,993.91	-	17,453,479.97	-	-	371,355,607.21	400,000,081.09
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	0.73	0.73
应付赎回款	-	-	-	-	-	464,851.50	464,851.50

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	178,126.83	178,126.83
应付托管费	-	-	-	-	-	35,625.37	35,625.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,546.79	21,546.79
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负	-	-	-	-	-	249,519.62	249,519.62



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	339,247,041.34	93.07	369,947,187.06	92.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,615,510.14	2.64	19,084,057.94	4.78
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	348,862,551.48	95.71	389,031,245.00	97.49

#### 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
	中证 500 指数上涨 5%	17,203,479.48	18,328,975.13
	中证 500 指数下跌 5%	-17,203,479.48	-18,328,975.13

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合

理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 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	339,290,278.81
第二层次	9,498,158.25
第三层次	74,114.42
合计	348,862,551.48

###### 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	339,247,041.34	92.39
	其中：股票	339,247,041.34	92.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,615,510.14	2.62
	其中：债券	9,615,510.14	2.62
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,036,318.77	3.82
8	其他各项资产	4,308,393.01	1.17
9	合计	367,207,263.26	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	845,384.00	0.23
B	采矿业	12,124,998.50	3.33
C	制造业	214,803,760.47	58.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,933,219.86	3.00
E	建筑业	2,981,800.00	0.82
F	批发和零售业	7,436,617.52	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	5,641,819.80	1.55

H	住宿和餐饮业	910,101.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,516,873.35	8.65
J	金融业	33,342,342.62	9.15
K	房地产业	4,195,626.24	1.15
L	租赁和商务服务业	2,916,155.60	0.80
M	科学研究和技术服务业	2,301,901.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	1,420,516.92	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	696,150.00	0.19
Q	卫生和社会工作	1,561,827.04	0.43
R	文化、体育和娱乐业	4,736,488.00	1.30
S	综合	807,122.00	0.22
	合计	339,172,703.92	93.05

### 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	71,502.42	0.02
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	2,835.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	74,337.42	0.02

### 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	300476	胜宏科技	27,800	3,735,764.00	1.02
2	000988	华工科技	46,400	2,181,264.00	0.60
3	600988	赤峰黄金	76,700	1,908,296.00	0.52
4	300339	润和软件	36,700	1,865,461.00	0.51
5	002966	苏州银行	206,140	1,809,909.20	0.50
6	600839	四川长虹	170,200	1,654,344.00	0.45
7	601162	天风证券	327,300	1,613,589.00	0.44
8	601555	东吴证券	183,290	1,603,787.50	0.44
9	689009	九号公司	26,500	1,568,005.00	0.43
10	688521	芯原微电子	16,242	1,567,353.00	0.43
11	002517	恺英网络	78,800	1,521,628.00	0.42
12	002340	格林美	236,300	1,500,505.00	0.41
13	002195	岩山科技	261,901	1,474,502.63	0.40
14	603893	瑞芯微	9,700	1,473,042.00	0.40
15	002558	巨人网络	62,400	1,469,520.00	0.40
16	002156	通富微电	56,000	1,434,720.00	0.39
17	002261	拓维信息	46,300	1,432,985.00	0.39
18	600487	亨通光	91,000	1,392,300.00	0.38

		电			
19	600157	永泰能源	1,024,300	1,372,562.00	0.38
20	002797	第一创业	193,700	1,371,396.00	0.38
21	300251	光线传媒	67,600	1,370,252.00	0.38
22	300207	欣旺达	68,100	1,366,086.00	0.37
23	688608	恒玄科技	3,893	1,354,686.14	0.37
24	300803	指南针	16,590	1,338,149.40	0.37
25	688213	思特威电子科技	13,000	1,328,860.00	0.36
26	000066	中国长城	89,200	1,320,160.00	0.36
27	688777	中控技术	29,120	1,307,779.20	0.36
28	688120	华海清科	7,661	1,292,410.70	0.35
29	600096	云天化	58,800	1,291,836.00	0.35
30	600536	中国软件	27,460	1,284,304.20	0.35
31	002273	水晶光电	64,081	1,279,697.57	0.35
32	601168	西部矿业	76,900	1,278,847.00	0.35
33	002465	海格通信	91,500	1,275,510.00	0.35
34	600879	航天电子	121,700	1,274,199.00	0.35
35	688235	百济神州	5,400	1,261,656.00	0.35
36	300450	先导智能	50,500	1,254,925.00	0.34
37	000831	中国稀土	34,200	1,235,304.00	0.34
38	601099	太平洋	314,200	1,234,806.00	0.34
39	600352	浙江龙盛	120,000	1,219,200.00	0.33
40	002294	信立泰	25,700	1,216,381.00	0.33
41	300017	网宿科技	112,700	1,208,144.00	0.33

42	000933	神火股份	72,600	1,208,064.00	0.33
43	600885	宏发股份	53,885	1,202,174.35	0.33
44	002185	华天科技	118,200	1,193,820.00	0.33
45	601108	财通证券	149,850	1,185,313.50	0.33
46	688002	睿创微纳	16,851	1,174,851.72	0.32
47	688617	惠泰医疗	3,857	1,145,529.00	0.31
48	601128	常熟银行	152,896	1,126,843.52	0.31
49	002130	沃尔核材	46,500	1,107,630.00	0.30
50	600079	人福医药	52,700	1,105,646.00	0.30
51	601577	长沙银行	111,200	1,105,328.00	0.30
52	688099	晶晨半导体	15,564	1,105,199.64	0.30
53	300454	深信服	11,700	1,101,906.00	0.30
54	002281	光迅科技	22,305	1,100,082.60	0.30
55	688122	西部超导	21,071	1,093,163.48	0.30
56	002595	豪迈科技	18,400	1,089,648.00	0.30
57	002085	万丰奥威	68,500	1,088,465.00	0.30
58	688469	芯联集成	228,144	1,088,246.88	0.30
59	000423	东阿阿胶	20,800	1,087,840.00	0.30
60	300223	北京君正	15,600	1,079,520.00	0.30
61	000997	新大陆	33,300	1,078,254.00	0.30
62	300058	蓝色光标	163,060	1,069,673.60	0.29
63	002532	天山铝业	128,700	1,069,497.00	0.29

64	002738	中矿资源	33,220	1,068,355.20	0.29
65	300002	神州泰岳	90,500	1,067,900.00	0.29
66	603129	春风动力	4,900	1,060,850.00	0.29
67	000783	长江证券	153,000	1,060,290.00	0.29
68	300458	全志科技	26,600	1,055,754.00	0.29
69	300474	景嘉微	14,450	1,054,850.00	0.29
70	600109	国金证券	119,800	1,050,646.00	0.29
71	002472	双环传动	31,300	1,048,237.00	0.29
72	002138	顺络电子	37,200	1,046,064.00	0.29
73	002078	太阳纸业	77,300	1,040,458.00	0.29
74	603596	伯特利	19,600	1,032,724.00	0.28
75	002436	兴森科技	77,900	1,031,396.00	0.28
76	601933	永辉超市	209,200	1,025,080.00	0.28
77	002410	广联达	76,200	1,021,842.00	0.28
78	688525	佰维存储	15,000	1,011,000.00	0.28
79	300346	南大光电	31,900	1,009,316.00	0.28
80	002851	麦格米特	20,100	1,007,814.00	0.28
81	600862	中航高科	38,501	1,004,106.08	0.28
82	300765	新诺威	19,400	1,002,786.00	0.28
83	600143	金发科技	97,200	1,002,132.00	0.27
84	300136	信维通信	44,600	999,040.00	0.27
85	601198	东兴证券	89,400	996,810.00	0.27
86	600580	卧龙电驱	50,380	996,012.60	0.27
87	002850	科达利	8,800	995,896.00	0.27

88	002065	东华软件	103,400	992,640.00	0.27
89	300054	鼎龙股份	34,600	992,328.00	0.27
90	002353	杰瑞股份	28,352	992,320.00	0.27
91	300024	机器人	57,700	991,286.00	0.27
92	000034	神州数码	26,200	986,168.00	0.27
93	002223	鱼跃医疗	27,700	986,120.00	0.27
94	600298	安琪酵母	28,000	984,760.00	0.27
95	600873	梅花生物	92,100	984,549.00	0.27
96	688072	拓荆科技	6,400	983,744.00	0.27
97	300395	菲利华	19,231	982,704.10	0.27
98	603606	东方电缆	19,000	982,490.00	0.27
99	002202	金风科技	95,500	978,875.00	0.27
100	600363	联创光电	16,700	974,111.00	0.27
101	002673	西部证券	123,600	973,968.00	0.27
102	300496	中科创达	17,000	972,740.00	0.27
103	688578	艾力斯医药科技	10,400	967,616.00	0.27
104	601615	明阳智能	83,800	962,862.00	0.26
105	300857	协创数据	11,100	955,266.00	0.26
106	000728	国元证券	120,700	952,323.00	0.26
107	002624	完美世界	62,600	949,642.00	0.26
108	300383	光环新网	66,300	948,090.00	0.26
109	002008	大族激光	38,800	945,556.00	0.26

110	000021	深科技	50,400	944,496.00	0.26
111	300115	长盈精密	43,800	937,320.00	0.26
112	603659	璞泰来	49,300	925,854.00	0.25
113	600549	厦门钨业	43,900	918,388.00	0.25
114	600895	张江高科	35,700	917,490.00	0.25
115	300604	长川科技	20,300	911,673.00	0.25
116	603605	珀莱雅	11,000	910,690.00	0.25
117	603087	甘李药业	16,600	909,348.00	0.25
118	603160	汇顶科技	12,800	909,184.00	0.25
119	300012	华测检测	77,600	907,144.00	0.25
120	000426	兴业银锡	57,300	905,340.00	0.25
121	688220	翱捷科技	11,516	901,702.80	0.25
122	002155	湖南黄金	50,410	899,818.50	0.25
123	000733	振华科技	17,900	895,895.00	0.25
124	600171	上海贝岭	26,100	893,925.00	0.25
125	300627	华测导航	25,220	882,700.00	0.24
126	688361	中科飞测	10,400	875,576.00	0.24
127	605589	圣泉集团	31,200	865,800.00	0.24
128	601216	君正集团	155,600	858,912.00	0.24
129	600392	盛和资源	64,660	851,572.20	0.23
130	300037	新宙邦	24,140	849,728.00	0.23
131	601665	齐鲁银行	134,400	849,408.00	0.23
132	000750	国海证券	206,050	848,926.00	0.23
133	300699	光威复	26,800	848,756.00	0.23

		材			
134	000519	中兵红箭	38,500	842,765.00	0.23
135	002444	巨星科技	33,000	841,830.00	0.23
136	601997	贵阳银行	134,800	841,152.00	0.23
137	000932	华菱钢铁	191,080	840,752.00	0.23
138	000729	燕京啤酒	65,000	840,450.00	0.23
139	688180	君实生物	24,674	838,422.52	0.23
140	300003	乐普医疗	60,700	836,446.00	0.23
141	600153	建发股份	80,200	831,674.00	0.23
142	600060	海信视像	36,100	831,022.00	0.23
143	601717	郑煤机	49,800	827,676.00	0.23
144	601990	南京证券	102,000	824,160.00	0.23
145	000878	云南铜业	64,700	822,984.00	0.23
146	601233	桐昆股份	77,600	822,560.00	0.23
147	601696	中银证券	76,800	820,992.00	0.23
148	300073	当升科技	18,700	820,369.00	0.23
149	300001	特锐德	34,101	817,400.97	0.22
150	002821	凯莱英	9,200	811,900.00	0.22
151	300142	沃森生物	73,700	810,700.00	0.22
152	002414	高德红外	78,800	807,700.00	0.22
153	600673	东阳光	69,400	807,122.00	0.22
154	603979	金诚信	17,300	803,412.00	0.22
155	688052	纳芯微电子	4,600	802,654.00	0.22
156	600369	西南证券	183,800	799,530.00	0.22
157	002837	英维克	26,800	796,228.00	0.22

158	600699	均胜电子	45,500	793,520.00	0.22
159	002007	华兰生物	50,500	791,335.00	0.22
160	688065	凯赛生物	16,601	781,907.10	0.21
161	600118	中国卫星	27,300	779,961.00	0.21
162	300373	扬杰科技	15,000	778,500.00	0.21
163	600177	雅戈尔	106,600	778,180.00	0.21
164	600521	华海药业	41,700	776,871.00	0.21
165	000893	亚钾国际	25,600	771,584.00	0.21
166	600398	海澜之家	110,700	770,472.00	0.21
167	688027	科大国盾量子	2,800	770,028.00	0.21
168	002152	广电运通	57,200	768,768.00	0.21
169	603345	安井食品	9,500	763,990.00	0.21
170	600435	北方导航	48,700	759,233.00	0.21
171	600704	物产中大	143,600	756,772.00	0.21
172	000738	航发控制	36,400	755,300.00	0.21
173	300748	金力永磁	31,680	755,251.20	0.21
174	688249	晶合集成	37,008	750,152.16	0.21
175	000623	吉林敖东	44,100	747,495.00	0.21
176	600316	洪都航空	19,801	746,497.70	0.20
177	600497	驰宏锌锗	140,800	744,832.00	0.20
178	002044	美年健康	144,400	742,216.00	0.20
179	600909	华安证券	127,170	741,401.10	0.20

180	002958	青农商行	204,900	739,689.00	0.20
181	000009	中国宝安	83,240	739,171.20	0.20
182	603179	新泉股份	15,700	737,429.00	0.20
183	002318	久立特材	31,500	736,785.00	0.20
184	600765	中航重机	43,620	736,305.60	0.20
185	688385	复旦微电	14,936	735,896.72	0.20
186	600038	中直股份	18,900	733,509.00	0.20
187	600141	兴发集团	35,640	731,689.20	0.20
188	002409	雅克科技	13,200	721,908.00	0.20
189	600562	国睿科技	22,900	721,121.00	0.20
190	603228	景旺电子	17,201	719,689.84	0.20
191	000400	许继电气	32,900	716,233.00	0.20
192	000528	柳工	74,500	715,945.00	0.20
193	600155	华创云信	102,500	713,400.00	0.20
194	002683	广东宏大	21,000	712,740.00	0.20
195	001696	宗申动力	31,700	711,665.00	0.20
196	300919	中伟股份	21,600	710,208.00	0.19
197	688188	上海柏楚电子科技	5,294	697,008.04	0.19
198	000960	锡业股份	45,500	696,150.00	0.19
198	002607	中公教育	227,500	696,150.00	0.19
200	300724	捷佳伟创	12,800	695,040.00	0.19
201	600637	东方明珠	93,000	694,710.00	0.19

202	300757	罗博特科	4,600	689,862.00	0.19
203	600498	烽火通信	32,800	689,784.00	0.19
204	600884	杉杉股份	72,600	686,796.00	0.19
205	300623	捷捷微电	23,000	685,400.00	0.19
206	603939	益丰药房	27,924	683,300.28	0.19
207	600529	山东药玻	30,600	677,484.00	0.19
208	600563	法拉电子	6,201	676,467.09	0.19
209	688568	中科星图公司	18,764	675,691.64	0.19
210	300558	贝达药业	11,600	672,220.00	0.18
211	002841	视源股份	19,300	667,780.00	0.18
212	002739	万达电影	58,400	667,512.00	0.18
213	000039	中集集团	84,900	667,314.00	0.18
214	000415	渤海租赁	199,600	664,668.00	0.18
215	600486	扬农化工	11,290	654,820.00	0.18
216	002653	海思科	15,500	654,410.00	0.18
217	301358	湖南裕能	20,900	651,871.00	0.18
218	002926	华西证券	72,600	649,044.00	0.18
219	002025	航天电器	12,600	647,766.00	0.18
220	600901	江苏金租	106,800	647,208.00	0.18
221	002385	大北农	158,600	640,744.00	0.18
222	000887	中鼎股份	36,400	640,276.00	0.18
223	300285	国瓷材料	36,800	638,480.00	0.18
224	688017	绿的谐	5,095	636,314.55	0.17

		波			
225	300763	锦浪科技	11,000	631,290.00	0.17
226	002939	长城证券	74,400	623,472.00	0.17
227	300679	电连技术	13,700	621,706.00	0.17
228	002568	百润股份	24,200	619,762.00	0.17
229	600820	隧道股份	101,500	619,150.00	0.17
230	688582	芯动联科	9,200	618,240.00	0.17
231	688114	华大智造	9,535	618,154.05	0.17
232	600863	内蒙华电	150,400	618,144.00	0.17
233	603486	科沃斯	10,600	617,238.00	0.17
234	600132	重庆啤酒	11,200	617,120.00	0.17
235	000723	美锦能源	142,100	613,872.00	0.17
236	600008	首创环保	203,040	613,180.80	0.17
237	300144	宋城演艺	70,800	605,340.00	0.17
238	002064	华峰化学	91,500	604,815.00	0.17
239	600390	五矿资本	103,700	604,571.00	0.17
240	000513	丽珠集团	16,764	604,174.56	0.17
241	600516	方大炭素	129,900	602,736.00	0.17
242	002080	中材科技	30,900	602,550.00	0.17
243	002312	川发龙鳞	52,300	600,404.00	0.16
244	603568	伟明环保	31,399	599,092.92	0.16
245	600998	九州通	116,251	597,530.14	0.16
246	600763	通策医疗	14,468	597,239.04	0.16

247	688538	和辉光电	255,062	596,845.08	0.16
248	000703	恒逸石化	101,400	596,232.00	0.16
249	688183	生益电子	11,600	593,920.00	0.16
250	600166	福田汽车	219,000	593,490.00	0.16
251	300487	蓝晓科技	11,750	591,025.00	0.16
252	600170	上海建工	245,800	587,462.00	0.16
253	002262	恩华药业	28,100	583,918.00	0.16
254	600208	衢州发展	196,100	580,456.00	0.16
255	601179	中国西电	94,500	580,230.00	0.16
256	002500	山西证券	99,310	579,970.40	0.16
257	603816	顾家家居	22,700	579,304.00	0.16
258	605358	立昂微	24,800	577,840.00	0.16
259	603589	口子窖	16,604	577,819.20	0.16
260	300676	华大基因	11,600	577,332.00	0.16
261	600312	平高电气	37,500	577,125.00	0.16
262	000683	博源化工	120,000	574,800.00	0.16
263	002203	海亮股份	55,300	570,696.00	0.16
264	600021	上海电力	64,900	570,471.00	0.16
265	601155	新城控股	41,693	570,360.24	0.16
266	600985	淮北矿业	49,700	563,598.00	0.15
267	600126	杭钢股份	62,320	560,880.00	0.15
268	002244	滨江集团	57,400	559,650.00	0.15
269	600380	健康元	50,608	558,206.24	0.15

270	002432	九安医疗	15,300	557,379.00	0.15
271	600583	海油工程	101,900	556,374.00	0.15
272	000403	派林生物	30,670	556,047.10	0.15
273	000591	太阳能	126,400	554,896.00	0.15
274	601000	唐山港	136,630	554,717.80	0.15
275	603338	浙江鼎力	11,700	554,580.00	0.15
276	688728	格科微有限公司	36,000	554,400.00	0.15
277	600348	华阳股份	83,150	553,779.00	0.15
278	000060	中金岭南	120,600	552,348.00	0.15
279	000629	钒钛股份	214,300	548,608.00	0.15
280	688278	特宝生物	7,600	548,036.00	0.15
281	000921	海信家电	21,311	547,692.70	0.15
282	603885	吉祥航空	40,600	546,882.00	0.15
283	300567	精测电子	9,000	545,490.00	0.15
284	600872	中炬高新	28,700	545,300.00	0.15
285	000830	鲁西化工	52,793	543,767.90	0.15
286	603379	三美股份	11,300	543,756.00	0.15
287	601991	大唐发电	171,400	543,338.00	0.15
288	002603	以岭药业	38,500	542,850.00	0.15
289	600535	天士力	34,400	538,360.00	0.15
290	002439	启明星辰	33,500	535,665.00	0.15
291	600816	建元信托	181,500	535,425.00	0.15
292	002056	横店东	37,500	530,625.00	0.15

		磁			
293	600095	湘财股份	52,700	528,581.00	0.15
294	002984	森麒麟	28,180	528,375.00	0.14
295	300146	汤臣倍健	47,000	528,280.00	0.14
296	600970	中材国际	60,900	522,522.00	0.14
297	002423	中粮资本	42,500	519,775.00	0.14
298	600499	科达制造	53,000	519,400.00	0.14
299	601880	辽港股份	345,700	518,550.00	0.14
300	603927	中科软	26,808	518,466.72	0.14
301	000062	深圳华强	19,300	518,398.00	0.14
302	601016	节能风电	179,050	517,454.50	0.14
303	603000	人民网	25,500	515,355.00	0.14
304	600685	中船防务	18,900	513,891.00	0.14
305	000636	风华高科	37,300	512,502.00	0.14
306	300390	天华新能	26,840	511,838.80	0.14
307	601611	中国核建	55,600	510,964.00	0.14
308	000958	电投产融	74,500	509,580.00	0.14
309	601666	平煤股份	68,500	507,585.00	0.14
310	600511	国药股份	17,402	507,442.32	0.14
311	301308	江波龙	5,800	507,442.00	0.14
312	603298	杭叉集团	24,200	506,990.00	0.14
313	300212	易华录	23,280	506,572.80	0.14
314	000563	陕国投 A	141,420	504,869.40	0.14
315	600859	王府井	36,302	504,234.78	0.14
316	688297	中航无人机	9,424	503,241.60	0.14

317	000155	川能动力	51,100	501,802.00	0.14
318	603737	三棵树	13,584	500,570.40	0.14
319	601456	国联民生	48,300	499,905.00	0.14
320	603077	和邦生物	285,000	498,750.00	0.14
321	600655	豫园股份	89,800	498,390.00	0.14
322	688520	神州细胞集团公司	8,320	497,952.00	0.14
323	600004	白云机场	54,600	496,860.00	0.14
324	000598	兴蓉环境	68,800	496,048.00	0.14
325	600483	福能股份	51,300	494,532.00	0.14
326	601966	玲珑轮胎	33,700	494,379.00	0.14
327	600325	华发股份	101,500	494,305.00	0.14
328	688301	奕瑞科技股份	5,639	494,032.79	0.14
329	300677	英科医疗	20,840	493,491.20	0.14
330	603899	晨光股份	17,000	492,830.00	0.14
331	002773	康弘药业	17,000	492,490.00	0.14
332	603156	养元饮品	23,200	490,912.00	0.13
333	600131	国网信通	27,700	490,290.00	0.13
334	601958	金钼股份	44,600	487,924.00	0.13
335	000050	深天马 A	56,700	483,084.00	0.13
336	600663	陆家嘴	54,400	481,984.00	0.13
337	600282	南钢股份	113,700	477,540.00	0.13
338	300529	健帆生物	22,100	476,697.00	0.13

339	600378	昊华科技	17,600	476,432.00	0.13
340	002507	涪陵榨菜	37,250	476,427.50	0.13
341	000951	中国重汽	27,100	476,418.00	0.13
342	000987	越秀资本	69,425	476,255.50	0.13
343	002756	永兴材料	14,960	474,980.00	0.13
344	600271	航天信息	51,300	474,012.00	0.13
345	600754	锦江酒店	21,100	473,484.00	0.13
346	600598	北大荒	32,800	472,976.00	0.13
347	601001	晋控煤业	38,600	471,692.00	0.13
348	301536	星辰科技	7,800	470,340.00	0.13
349	300601	康泰生物	30,900	469,371.00	0.13
350	000559	万向钱潮	60,900	465,885.00	0.13
350	600737	中粮糖业	49,300	465,885.00	0.13
352	600739	辽宁成大	42,300	465,300.00	0.13
353	601918	新集能源	71,700	463,182.00	0.13
354	688363	华熙生物	9,000	462,150.00	0.13
355	688234	天岳先进	7,878	461,256.90	0.13
356	600582	天地科技	76,300	457,037.00	0.13
357	002429	兆驰股份	104,300	456,834.00	0.13
358	601333	广深铁路	156,300	451,707.00	0.12
359	300070	碧水源	100,200	450,900.00	0.12
360	688772	珠海冠宇电池	31,432	449,163.28	0.12
361	601866	中远海	181,200	447,564.00	0.12

		发			
362	002120	韵达股份	66,800	447,560.00	0.12
363	603290	斯达半导	5,500	446,985.00	0.12
364	600764	中国海防	13,100	445,400.00	0.12
365	300751	迈为股份	6,400	445,184.00	0.12
366	003031	中瓷电子	8,360	444,835.60	0.12
367	601231	环旭电子	30,400	444,752.00	0.12
368	600867	通化东宝	54,200	444,440.00	0.12
369	300735	光弘科技	17,700	444,270.00	0.12
370	603728	鸣志电器	7,700	442,519.00	0.12
371	300888	稳健医疗	10,760	442,236.00	0.12
372	002430	杭氧股份	22,700	440,834.00	0.12
373	603688	石英股份	12,450	438,489.00	0.12
374	600329	达仁堂	13,100	437,016.00	0.12
375	600258	首旅酒店	30,900	436,617.00	0.12
376	688778	厦钨新能源	7,805	436,455.60	0.12
377	603341	龙旗科技	10,700	434,741.00	0.12
378	600995	南网储能	44,200	432,276.00	0.12
379	688676	海南金盘智能科技	12,800	428,160.00	0.12
380	688561	奇安信集团	12,600	428,148.00	0.12
381	600707	彩虹股份	66,200	427,652.00	0.12
382	601212	白银有色	136,500	427,245.00	0.12

383	000032	深桑达 A	21,000	424,830.00	0.12
384	601098	中南传媒	32,000	419,840.00	0.12
385	000027	深圳能源	65,760	419,548.80	0.12
386	600578	京能电力	92,600	415,774.00	0.11
387	002508	老板电器	21,800	414,418.00	0.11
388	603858	步长制药	25,500	414,120.00	0.11
389	688318	财富趋势	3,600	413,712.00	0.11
390	600566	济川药业	15,700	413,381.00	0.11
391	000709	河钢股份	190,600	411,696.00	0.11
392	002299	圣农发展	28,700	410,123.00	0.11
393	603529	爱玛科技	11,900	409,360.00	0.11
394	300573	兴齐眼药	7,880	408,105.20	0.11
395	600906	财达证券	59,800	407,836.00	0.11
396	000967	盈峰环境	58,400	405,880.00	0.11
397	000883	湖北能源	89,900	405,449.00	0.11
398	301498	乖宝宠物	3,700	404,669.00	0.11
399	600517	国网英大	79,100	403,410.00	0.11
400	002670	国盛金控	26,798	403,309.90	0.11
401	002831	裕同科技	17,180	402,355.60	0.11
402	600848	上海临港	44,100	399,987.00	0.11
403	601399	国机重装	133,000	399,000.00	0.11
404	600546	山煤国际	45,700	398,961.00	0.11

405	600959	江苏有线	115,300	396,632.00	0.11
406	601928	凤凰传媒	35,200	393,184.00	0.11
407	601156	东航物流	29,300	383,537.00	0.11
408	600968	海油发展	93,700	382,296.00	0.10
409	600808	马钢股份	110,400	380,880.00	0.10
410	300595	欧普康视	24,800	378,696.00	0.10
411	000739	普洛药业	27,000	378,000.00	0.10
412	600528	中铁工业	51,200	377,856.00	0.10
413	000825	太钢不锈	105,200	377,668.00	0.10
414	603225	新凤鸣	35,120	374,028.00	0.10
415	002572	索菲亚	26,600	372,666.00	0.10
416	601118	海南橡胶	78,900	372,408.00	0.10
417	601636	旗滨集团	74,200	371,742.00	0.10
418	301301	川宁生物	30,800	370,832.00	0.10
419	002266	浙富控股	120,300	370,524.00	0.10
420	603565	中谷物流	38,700	369,585.00	0.10
421	601608	中信重工	84,400	368,828.00	0.10
422	600977	中国电影	34,400	368,768.00	0.10
423	600801	华新水泥	31,000	367,040.00	0.10
424	000543	皖能电力	52,300	366,100.00	0.10
425	600871	石化油服	187,400	365,430.00	0.10
426	601598	中国外运	72,700	358,411.00	0.10
427	600062	华润双	19,200	358,272.00	0.10

		鹤			
428	600056	中国医药	34,460	356,316.40	0.10
429	688387	中信科移动	63,043	356,192.95	0.10
430	601106	中国一重	126,500	354,200.00	0.10
431	000582	北部湾港	42,900	353,925.00	0.10
432	603650	彤程新材	11,000	353,650.00	0.10
433	688563	航空材料股份	6,200	351,106.00	0.10
434	000785	居然智家	114,800	350,140.00	0.10
435	300957	贝泰妮	7,800	344,916.00	0.09
436	688702	盛科通信	5,600	342,048.00	0.09
437	603233	大参林	20,952	341,517.60	0.09
438	600925	苏能股份	63,500	332,105.00	0.09
439	600373	中文传媒	32,200	330,694.00	0.09
440	601965	中国汽研	18,500	328,375.00	0.09
441	002153	石基信息	37,778	327,157.48	0.09
442	000429	粤高速 A	24,100	321,253.00	0.09
443	000537	中绿电	38,100	318,516.00	0.09
444	600606	绿地控股	194,400	316,872.00	0.09
445	688281	华秦科技实业	5,092	308,116.92	0.08
446	002372	伟星新材	29,380	304,376.80	0.08
447	601568	北元集团	73,290	304,153.50	0.08
448	600098	广州发展	48,500	303,125.00	0.08
449	600361	创新新材	75,700	302,043.00	0.08
450	001286	陕西能	34,600	301,020.00	0.08

		源			
451	688425	铁建重工	73,721	300,781.68	0.08
452	603658	安图生物	7,900	296,250.00	0.08
453	003022	联泓新科	18,500	292,855.00	0.08
454	600688	上海石化	101,400	288,990.00	0.08
455	600612	老凤祥	5,800	288,550.00	0.08
456	688349	三一重能	11,376	283,717.44	0.08
457	000937	冀中能源	48,900	281,175.00	0.08
458	601019	山东出版	28,900	273,683.00	0.08
459	301165	锐捷网络	4,380	269,194.80	0.07
460	000898	鞍钢股份	110,100	255,432.00	0.07
461	002608	江苏国信	34,800	255,084.00	0.07
462	601139	深圳燃气	39,800	253,128.00	0.07
463	600339	中油工程	77,200	252,444.00	0.07
464	688100	威胜信息	6,800	251,940.00	0.07
465	600032	浙江新能	33,300	251,748.00	0.07
466	603707	健友股份	22,359	249,302.85	0.07
467	688248	南方电网电力科技	7,900	248,534.00	0.07
468	600720	中交设计	31,700	245,041.00	0.07
469	000959	首钢股份	71,700	243,780.00	0.07
470	600928	西安银行	61,500	241,080.00	0.07
471	003035	南网能源	52,400	240,516.00	0.07

472	600295	鄂尔多斯	27,300	237,783.00	0.07
473	688032	禾迈股份	2,331	232,773.66	0.06
474	002461	珠江啤酒	20,400	230,316.00	0.06
475	603556	海兴电力	9,000	229,230.00	0.06
476	688475	萤石网络	7,200	226,944.00	0.06
477	601228	广州港	69,600	224,808.00	0.06
478	301267	华夏眼科	11,600	222,372.00	0.06
479	688375	国博电子	3,670	220,236.70	0.06
480	688172	燕东微电子股份	11,200	220,192.00	0.06
481	603786	科博达	3,700	205,017.00	0.06
482	600927	永安期货	13,400	198,454.00	0.05
483	002563	森马服饰	37,300	196,198.00	0.05
484	601061	中信金属	24,800	196,168.00	0.05
485	600007	中国国贸	9,300	191,394.00	0.05
486	000539	粤电力 A	41,000	186,140.00	0.05
487	600299	安迪苏	18,500	178,525.00	0.05
488	002945	华林证券	12,400	178,188.00	0.05
489	603826	坤彩科技	9,040	176,912.80	0.05
490	300140	节能环保	28,600	176,462.00	0.05
491	688819	天能电池集团股份	6,325	175,582.00	0.05
492	001213	中铁特货	41,000	166,460.00	0.05
493	601921	浙版传媒	20,500	165,230.00	0.05

494	601858	中国科 传	7,300	141,985.00	0.04
495	601158	重庆水 务	26,600	123,424.00	0.03
496	688153	唯捷创 芯	3,900	120,939.00	0.03
497	600956	新天绿 能	14,233	109,878.76	0.03
498	001389	广合科 技	1,800	105,786.00	0.03
499	688295	中复神 鹰碳纤 维	4,640	96,512.00	0.03
500	603868	飞科电 器	2,200	78,914.00	0.02

### 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	295	36,627.20	0.01
2	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
3	301590	优优绿 能	73	10,182.04	0.00
4	603049	中策橡 胶	174	7,455.90	0.00
5	400174	中天 3	283,500	2,835.00	0.00
6	603317	天味食 品	16	177.92	0.00
7	688063	派能科 技	1	45.08	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	688608	恒玄科技	1,474,140.57	0.37
2	688235	百济神州	1,390,528.76	0.35
3	000933	神火股份	1,246,713.00	0.31
4	300450	先导智能	1,146,489.00	0.29
5	002130	沃尔核材	1,065,442.00	0.27
6	300454	深信服	1,062,398.00	0.27
7	300458	全志科技	1,055,078.00	0.26
8	600363	联创光电	1,022,160.00	0.26
9	300346	南大光电	976,869.00	0.24
10	002851	麦格米特	951,676.00	0.24
11	300857	协创数据	933,713.00	0.23
12	300115	长盈精密	928,100.00	0.23
13	600171	上海贝岭	855,746.00	0.21
14	605589	圣泉集团	853,515.00	0.21
15	002007	华兰生物	853,501.00	0.21
16	603659	璞泰来	846,306.00	0.21
17	300627	华测导航	809,567.00	0.20
18	688027	科大国盾量 子	759,348.05	0.19
19	000528	柳工	750,027.00	0.19
20	002837	英维克	733,168.50	0.18

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	600418	江淮汽车	4,027,077.00	1.01
2	002625	光启技术	3,219,853.00	0.81
3	002384	东山精密	2,360,720.00	0.59
4	301236	软通动力	1,704,256.00	0.43
5	302132	中航成飞	1,322,161.00	0.33
6	300866	安克创新	1,299,732.00	0.33
7	002128	电投能源	1,178,846.00	0.30
8	688047	龙芯中科	1,056,063.02	0.26
9	600642	申能股份	941,300.00	0.24
10	601567	三星医疗	918,466.00	0.23
11	002407	多氟多	765,751.60	0.19
12	688536	思瑞浦股份	698,388.54	0.18
13	603444	吉比特	671,942.00	0.17
14	000818	航锦科技	671,020.00	0.17

15	002487	大金重工	620,426.00	0.16
16	688331	荣昌生物	598,467.13	0.15
17	600416	湘电股份	585,610.00	0.15
18	300009	安科生物	585,555.56	0.15
19	000998	隆平高科	581,162.00	0.15
20	688005	容百科技	577,514.70	0.14

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	53,957,294.84
卖出股票收入（成交）总额	97,921,640.64

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	9,498,158.25	2.61
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）	117,351.89	0.03
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	9,615,510.14	2.64

#### 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	019758	24 国债 21	57,000	5,751,146.96	1.58
2	019749	24 国债 15	37,000	3,747,011.29	1.03

3	127108	太能转债	1,014	117,351.89	0.03
---	--------	------	-------	------------	------

### 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

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

### 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,苏州银行股份有限公司、东吴证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 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	909,141.72
2	应收清算款	3,200,589.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	198,662.25

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,308,393.01

#### 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	36,627.20	0.01	新股流通受限
2	301678	新恒汇	17,014.28	0.00	新股流通受限
3	301590	优优绿能	10,182.04	0.00	新股流通受限
4	603049	中策橡胶	7,455.90	0.00	新股流通受限
5	400174	中天 3	2,835.00	0.00	重大事项停牌

## § 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	11,533	19,463.31	15,197,229.47	6.77	209,273,158.02	93.23

中证 500 指数 (LOF) A						
汇添富中证 500 指数 (LOF) C	13,438	7,440.56	268,949.74	0.27	99,717,346.31	99.73
合计	24,971	12,993.34	15,466,179.21	4.77	308,990,504.33	95.23

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	蓝德安	1,233,600.00	9.82
2	白宁	905,700.00	7.21
3	王磊	546,300.00	4.35
4	东莞市源丰高分子材料科技有限公司	436,000.00	3.47
5	施丽丽	425,238.00	3.38
6	谢晓明	293,912.00	2.34
7	曹鹏飞	224,100.00	1.78
8	周伟忠	200,000.00	1.59
9	柯美玲	200,000.00	1.59
10	黄惠钻	199,022.00	1.58
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	赵丽妹	200,018.00	8.48
2	黄晖	159,989.00	6.78
3	欧阳东	150,000.00	6.36
4	陈周红	100,000.00	4.24
5	杨莹	100,000.00	4.24
6	麦三军	70,000.00	2.97
7	郑凯鹏	65,304.00	2.77
8	吴玉兰	50,500.00	2.14
9	杜兴	50,100.00	2.12
10	程婕	50,029.00	2.12

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	14,008.23	0.01
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	353.06	0.00
	合计	14,361.29	0.00

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份 额总额	255,083,544.06	114,915,238.25
本报告期基金总申购 份额	27,392,359.19	34,879,358.10
减：本报告期基金总 赎回份额	58,005,515.76	49,808,300.30
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期末基金份	224,470,387.49	99,986,296.05

额总额		
-----	--	--

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。

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

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

### 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。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

### 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，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

## 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 (%)	
招商证券	3	151,544,542.48	100.00	26,662.14	100.00	

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

### 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 (%)
招商证券	1,900,779.00	100.00	5,759,000.00	100.00	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证

券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）

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

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

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

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 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	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第四季度报告	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报	2025 年 01 月 22 日
2	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数许可使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 20 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新法律文件	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所	2025 年 03 月 20 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新产品资料概要	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年年报	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 31 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2024 年度)	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 上证报	2025 年 03 月 31 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子	2025 年 04 月 22 日

		披露网站	
9	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 16 日
10	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行(中国)有限公司合作关系的公告	上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 日

## § 11 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中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）在规定报刊上披露的各项公告；
- 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](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2025 年 08 月 29 日