

汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告.....	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	73
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.....	75
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 期末上市基金前十名持有人.....	77
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
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.....	78
§ 9 开放式基金份额变动.....	78
§ 10 重大事件揭示.....	78
10.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
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.....	79
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	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证沪港深 500ETF
场内简称	HGS500
基金主代码	517080
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 02 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）	433,166,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 02 月 22 日

注：扩位证券简称：沪港深 500ETF 基金。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	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	《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 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	-5,621,022.30
本期利润	37,938,919.17
加权平均基金份额本期利润	0.0794
本期加权平均净值利润率	9.43%
本期基金份额净值增长率	9.35%

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	-84,511,772.44
期末可供分配基金份额利润	-0.1951
期末基金资产净值	382,460,535.82
期末基金份额净值	0.8829
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	-11.71%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.13%	0.72%	2.55%	0.73%	0.58%	-0.01%
过去三个月	2.83%	1.50%	1.37%	1.53%	1.46%	-0.03%
过去六个月	9.35%	1.33%	7.45%	1.35%	1.90%	-0.02%
过去一年	25.81%	1.33%	22.19%	1.36%	3.62%	-0.03%
过去三年	7.91%	1.12%	-0.49%	1.14%	8.40%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-11.71%	1.16%	-19.30%	1.19%	7.59%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

基准收益率变动的比较

汇添富中证沪港深500ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2021 年 02 月 01 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		
董瑾	本基金的基金经理	2021 年 02 月 01 日	-	16	国籍：中国。学历：北京大学西方经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至

					2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 5 月 8 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 8 月 29 日任中证上海国
--	--	--	--	--	---

					企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2023 年 8 月 29 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 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 9 日至今任汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 26 日至 2022 年 10 月 11 日任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 3 日至今任汇添富中证电池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
--	--	--	--	--	---

					日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 23 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月 13 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 29 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 1 月 16 日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月 27 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的
--	--	--	--	--	--

					基金经理。2023 年 4 月 6 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 5 月 9 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 8 月 23 日至 2024 年 10 月 26 日任汇添富中证沪港深消费龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 13 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 24 日至今任汇添富中证港股
--	--	--	--	--	---

					通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月 12 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2025 年 3 月 21 日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 5 月 22 日至今任汇添富中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 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

国家统计局数据显示，随着政策组合效应持续释放，稳经济促发展效果显现，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，权益资产表现仍有支撑。

上半年，权益市场经调整后表现趋于平稳。风格上来看，小微盘表现优于大中盘，成长优于价值、红利。行业主题方面，综合金融、银行、有色、传媒、计算机等行业表现居前，而能源、房地产、食品饮料等行业略有调整。

港股交投活跃，南向资金仍持续流入；科技、医药、制造等板块表现相对突出，估值仍处于相对合理区间。

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

本基金本报告期基金份额净值增长率为 9.35%。同期业绩比较基准收益率为 7.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济有望保持稳健增长。政策方面，中央财经委员会第六次会议提出“反内卷”政策，强调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，推动落后产能有序退出。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。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

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：《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 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：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

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	上年度末
-----	-----	-----	------

		2025 年 06 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	6. 4. 7. 1	22, 219, 977. 87	25, 710, 757. 46
结算备付金		7, 081, 302. 63	6, 803, 404. 08
存出保证金		2, 230, 184. 88	2, 259, 037. 77
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	350, 154, 672. 12	403, 065, 681. 12
其中: 股票投资		350, 151, 171. 89	403, 065, 681. 12
基金投资		-	-
债券投资		3, 500. 23	-
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		-	1, 376, 598. 81
应收股利		927, 418. 39	47, 817. 46
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 6	-	-
资产总计		382, 613, 555. 89	439, 263, 296. 70
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		112. 50	1, 974, 736. 25
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		47, 324. 43	56, 812. 31
应付托管费		15, 774. 82	18, 937. 46
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	75, 594. 13
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 7	89, 808. 32	183, 419. 39
负债合计		153, 020. 07	2, 309, 499. 54
净资产:			

实收基金	6.4.7.8	433,166,000.00	541,166,000.00
未分配利润	6.4.7.9	-50,705,464.18	-104,212,202.84
净资产合计		382,460,535.82	436,953,797.16
负债和净资产总计		382,613,555.89	439,263,296.70

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8829 元，基金份额总额 433,166,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 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		38,427,597.03	20,374,032.53
1. 利息收入		86,908.93	87,649.99
其中：存款利息收入	6.4.7.10	86,908.93	87,649.99
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）		-4,949,043.75	-24,240,756.44
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-9,967,678.61	-30,610,118.84
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,922.18	572.94
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	-433,874.21	535,578.17
股利收益	6.4.7.17	5,448,586.89	5,833,211.29
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	43,559,941.47	44,833,056.75
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	-270,209.62	-305,917.77
减：二、营业总支出		488,677.86	552,115.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	299,713.28	343,811.36
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	99,904.44	114,603.78
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 20	-	-
7. 税金及附加		-	1, 931. 00
8. 其他费用	6. 4. 7. 21	89, 060. 14	91, 769. 44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37, 938, 919. 17	19, 821, 916. 95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37, 938, 919. 17	19, 821, 916. 95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		37, 938, 919. 17	19, 821, 916. 95

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 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	541, 166, 000. 00	-104, 212, 202. 84	436, 953, 797. 16
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	541, 166, 000. 00	-104, 212, 202. 84	436, 953, 797. 16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-108, 000, 000. 00	53, 506, 738. 66	-54, 493, 261. 34
（一）、综合收益总额	-	37, 938, 919. 17	37, 938, 919. 17
（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）	-108, 000, 000. 00	15, 567, 819. 49	-92, 432, 180. 51
其中：1. 基金申购款	20, 000, 000. 00	-3, 849, 743. 02	16, 150, 256. 98
2. 基金赎回款	-128, 000, 000. 00	19, 417, 562. 51	-108, 582, 437. 49
（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	433,166,000.00	-50,705,464.18	382,460,535.82
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	705,166,000.00	-228,137,120.62	477,028,879.38
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	705,166,000.00	-228,137,120.62	477,028,879.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-96,000,000.00	46,493,813.32	-49,506,186.68
（一）、综合收益总额	-	19,821,916.95	19,821,916.95
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-96,000,000.00	26,671,896.37	-69,328,103.63
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	-4,088,298.54	7,911,701.46
2. 基金赎回款	-108,000,000.00	30,760,194.91	-77,239,805.09
（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	609,166,000.00	-181,643,307.30	427,522,692.70

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

汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3528 号文《关于准予汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2021 年 2 月 1 日生效。首次设立基金募集规模为 1,089,166,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2021）验字第 60466941_B19 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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. 境外投资

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

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	22,219,977.87
等于：本金	22,217,789.92
加：应计利息	2,187.95
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	22,219,977.87

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		358,597,043.94	-	350,151,171.89	-8,445,872.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,500.00	0.23	3,500.23	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	3,500.00	0.23	3,500.23	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		358,600,543.94	0.23	350,154,672.12	-8,445,872.05

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	18,000,900.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	18,000,900.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	18,000,900.00	-	-	-

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
IF2512	IF2512	16	18,511,680.00	510,780.00
合计				510,780.00
减：可抵销期货暂收款				510,780.00
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	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	7,985.46
其中：交易所市场	7,985.46
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	89,808.32

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	541,166,000.00	541,166,000.00
本期申购	20,000,000.00	20,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-128,000,000.00	-128,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	433,166,000.00	433,166,000.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-99,691,347.18	-4,520,855.66	-104,212,202.84
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-99,691,347.18	-4,520,855.66	-104,212,202.84
本期利润	-5,621,022.30	43,559,941.47	37,938,919.17
本期基金份额交易产生的变动数	20,800,597.04	-5,232,777.55	15,567,819.49
其中：基金申购款	-3,756,051.57	-93,691.45	-3,849,743.02
基金赎回款	24,556,648.61	-5,139,086.10	19,417,562.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-84,511,772.44	33,806,308.26	-50,705,464.18

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	43,836.63
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	43,051.48
其他	20.82
合计	86,908.93

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
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,166,783.32
股票投资收益——赎回差价收入	-2,800,895.29
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-9,967,678.61

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	81,983,515.75
减：卖出股票成本总额	89,027,827.89
减：交易费用	122,471.18
买卖股票差价收入	-7,166,783.32

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	108,582,437.49
减：现金支付赎回款总额	70,675,486.49
减：赎回股票成本总额	40,707,846.29
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,800,895.29

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	2.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,919.46
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	3,922.18

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	29,723.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,800.00
减：应计利息总额	2.49
减：交易费用	1.19
买卖债券差价收入	3,919.46

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
外汇远期投资收益	-
股指期货投资收益	-433,874.21
外汇期货投资收益	-
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	5,448,586.89
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,448,586.89

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	42,922,681.47
——股票投资	42,922,681.47
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	637,260.00
——权证投资	-
——期货投资	637,260.00
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	43,559,941.47

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	-
替代损益	-270,209.62
其他	-
合计	-270,209.62

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	129.00
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	7,108.28
合计	89,060.14

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
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

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	299,713.28	343,811.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	83,286.20	-
应支付基金管理人的净管理费	216,427.08	343,811.36

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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	99,904.44	114,603.78

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.05\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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	22,219,977.87	43,836.63	26,981,826.47	51,492.20

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

于本报告期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 41,624.00 股，占本基金净值比例为 0.11%。持有基金托管人工商银行发行的股票 1,042,600.00 股，占本基金净值比例为 1.69%。（于上期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 62,324.00 股，占本基金净值比例为 0.11%。持有基金托管人工商银行发行的股票 1,538,100.00 股，占本基金净值比例为 1.67%。）

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
01211	比亚迪股份	2025 年 06 月 10 日	35 个交易日	送股流通受限	-	111.71	21,000	-	2,345,991.38	
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
123257	安克转债	2025 年 06 月 16 日	14 个交易日	新债流通受限	100.00	100.01	35	3,500.00	3,500.23	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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同责任，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	22,219,977.87	-	-	-	-	-	22,219,977.87
结算备付金	7,081,302.63	-	-	-	-	-	7,081,302.63
存出保证金	8,783.28	-	-	-	-	2,221,401.60	2,230,184.88
交易性金融资产	-	-	3,500.23	-	-	350,151,171.89	350,154,672.12
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	-	-	-	-	-	927,418.39	927,418.39
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	29,310,063.78	-	3,500.23	-	-	353,299,991.88	382,613,555.89
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	-	-	-	-	-	112.50	112.50
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,324.43	47,324.43
应付托管费	-	-	-	-	-	15,774.82	15,774.82
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	89,808.32	89,808.32
负债总计	-	-	-	-	-	153,020.07	153,020.07
利率敏感度缺	29,310,063.78	-	3,500.23	-	-	353,146,971.81	382,460,535.82

口							
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	25,710,757.46	-	-	-	-	-	25,710,757.46
结算 备付 金	6,803,404.08	-	-	-	-	-	6,803,404.08
存出 保证 金	6,071.37	-	-	-	-	2,252,966.40	2,259,037.77
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	403,065,681.12	403,065,681.12
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	1,376,598.81	1,376,598.81
应收 股利	-	-	-	-	-	47,817.46	47,817.46
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-

资产							
资产总计	32,520,232.91	-	-	-	-	406,743,063.79	439,263,296.70
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	-	-	-	-	-	1,974,736.25	1,974,736.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	56,812.31	56,812.31
应付托管费	-	-	-	-	-	18,937.46	18,937.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	75,594.13	75,594.13
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延	-	-	-	-	-	-	-

所得税负债							
其他负债	-	-	-	-	-	183,419.39	183,419.39
负债总计	-	-	-	-	-	2,309,499.54	2,309,499.54
利率敏感度缺口	32,520,232.91	-	-	-	-	404,433,564.25	436,953,797.16

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

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	171,643,683.86	-	171,643,683.86
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	-	927,418.39	-	927,418.39
应收申购 款	-	-	-	-
递延所得 税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	172,571,102.25	-	172,571,102.25
以外币计 价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金 融负债	-	-	-	-
衍生金融 负债	-	-	-	-
卖出回购 金融资产 款	-	-	-	-
应付清算 款	-	-	-	-
应付赎回 款	-	-	-	-
应付管理 人报酬	-	-	-	-
应付托管 费	-	-	-	-
应付销售 服务费	-	-	-	-
应付投资 顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得 税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债 表外汇风 险敞口净	-	172,571,102.25	-	172,571,102.25

额				
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	179,797,536.55	-	179,797,536.55
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	-	47,817.46	-	47,817.46
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	179,845,354.01	-	179,845,354.01
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理	-	-	-	-

人报酬				
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	179,845,354.01	-	179,845,354.01

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	8,628,555.11	8,992,267.70
	港币相对人民币贬值 5%	-8,628,555.11	-8,992,267.70

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	350,151,171.89	91.55	403,065,681.12	92.24
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	3,500.23	0.00	—	—
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	350,154,672.12	91.55	403,065,681.12	92.24

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
	中证沪港深 500 指数上涨 5%	18,773,332.41	21,197,711.84
	中证沪港深 500 指数下跌 5%	-18,773,332.41	-21,197,711.84

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	347,805,180.51
第二层次	2,349,491.61
第三层次	—
合计	350,154,672.12

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	350,151,171.89	91.52
	其中：股票	350,151,171.89	91.52
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,500.23	0.00
	其中：债券	3,500.23	0.00
	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	29,301,280.50	7.66
8	其他各项资产	3,157,603.27	0.83
9	合计	382,613,555.89	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 171,643,683.86 元，占期末净值比例为 44.88%。

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	1,639,982.40	0.43
B	采矿业	9,058,278.35	2.37
C	制造业	92,867,571.69	24.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,222,321.00	1.63
E	建筑业	3,110,563.00	0.81
F	批发和零售业	545,644.31	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	6,103,448.00	1.60
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,480,172.96	2.22
J	金融业	45,510,744.12	11.90
K	房地产业	1,221,774.00	0.32
L	租赁和商务服务业	1,509,281.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	1,775,760.00	0.46
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	461,947.20	0.12
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	178,507,488.03	46.67

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	5,564,403.36	1.45
15 原材料	1,372,694.50	0.36
20 工业	6,176,654.68	1.61
25 可选消费	37,424,483.73	9.79
30 日常消费	4,240,439.84	1.11
35 医疗保健	5,320,311.75	1.39
40 金融	54,231,995.36	14.18
45 信息技术	13,603,302.81	3.56
50 电信服务	33,908,055.59	8.87
55 公用事业	4,276,420.82	1.12
60 房地产	5,524,921.42	1.44
合计	171,643,683.86	44.88

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	00700	腾讯控	56,400	25,871,291.94	6.76

		股			
2	09988	阿里巴 巴—W	167,700	16,792,154.85	4.39
3	00005	汇丰控 股	153,600	13,300,170.62	3.48
4	01810	小米集 团—W	159,400	8,714,621.56	2.28
5	00939	建设银 行	1,057,000	7,634,334.71	2.00
5	601939	建设银 行	53,300	503,152.00	0.13
6	601318	中国平 安	85,500	4,743,540.00	1.24
6	02318	中国平 安	66,000	3,000,406.70	0.78
7	600519	贵州茅 台	5,000	7,047,600.00	1.84
8	600036	招商银 行	98,500	4,526,075.00	1.18
8	03968	招商银 行	40,000	2,000,818.30	0.52
9	01398	工商银 行	764,000	4,333,659.36	1.13
9	601398	工商银 行	278,600	2,114,574.00	0.55
10	03690	美团— W	53,720	6,138,441.24	1.60
11	01299	友邦保 险	93,200	5,983,559.30	1.56
12	01211	比亚迪 股份	32,000	3,574,844.00	0.93
12	002594	比亚迪	7,100	2,356,561.00	0.62
13	300750	宁德时 代	21,040	5,306,708.80	1.39
14	00941	中国移 动	54,500	4,328,981.05	1.13
14	600941	中国移 动	7,100	799,105.00	0.21
15	00388	香港交 易所	11,200	4,277,556.19	1.12
16	03988	中国银 行	735,000	3,056,491.62	0.80
16	601988	中国银	114,100	641,242.00	0.17

		行			
17	601899	紫金矿业	130,800	2,550,600.00	0.67
17	02899	紫金矿业	54,000	987,368.27	0.26
18	000333	美的集团	39,100	2,823,020.00	0.74
18	00300	美的集团	5,600	380,210.19	0.10
19	00981	中芯国际	42,000	1,712,094.93	0.45
19	688981	中芯国际	15,700	1,384,269.00	0.36
20	601166	兴业银行	132,300	3,087,882.00	0.81
21	00883	中国海洋石油	155,000	2,504,761.87	0.65
21	600938	中国海油	19,000	496,090.00	0.13
22	600900	长江电力	97,300	2,932,622.00	0.77
23	601288	农业银行	253,600	1,491,168.00	0.39
23	01288	农业银行	269,000	1,373,761.48	0.36
24	601328	交通银行	212,300	1,698,400.00	0.44
24	03328	交通银行	152,000	1,011,899.72	0.26
25	600030	中信证券	77,575	2,142,621.50	0.56
25	06030	中信证券	16,475	356,077.72	0.09
26	02888	渣打集团	20,600	2,459,109.65	0.64
27	300059	东方财富	100,354	2,321,188.02	0.61
28	00857	中国石油股份	184,000	1,132,641.90	0.30
28	601857	中国石油	89,900	768,645.00	0.20
29	601088	中国神华	26,100	1,058,094.00	0.28

29	01088	中国神华	29,000	805,297.45	0.21
30	600276	恒瑞医药	35,400	1,837,260.00	0.48
31	000858	五粮液	15,299	1,819,051.10	0.48
32	09992	泡泡玛特	7,200	1,750,506.26	0.46
33	601211	国泰海通	89,862	1,721,755.92	0.45
34	06160	百济神州	12,600	1,698,306.25	0.44
35	02628	中国人寿	64,000	1,099,592.83	0.29
35	601628	中国人寿	13,400	551,946.00	0.14
36	601601	中国太保	27,200	1,020,272.00	0.27
36	02601	中国太保	24,400	597,454.92	0.16
37	000651	格力电器	35,500	1,594,660.00	0.42
38	601728	中国电信	123,400	956,350.00	0.25
38	00728	中国电信	120,000	610,641.72	0.16
39	01024	快手-W	26,300	1,518,205.24	0.40
40	00386	中国石油化工股份	212,000	794,600.27	0.21
40	600028	中国石化	116,000	654,240.00	0.17
41	600887	伊利股份	50,400	1,405,152.00	0.37
42	002475	立讯精密	40,400	1,401,476.00	0.37
43	600919	江苏银行	116,800	1,394,592.00	0.36
44	603259	药明康德	19,860	1,381,263.00	0.36
45	601816	京沪高铁	233,200	1,340,900.00	0.35
46	00669	创科实	16,500	1,298,571.20	0.34

		业			
47	02015	理想汽车—W	13,300	1,297,796.05	0.34
48	600000	浦发银行	93,300	1,295,004.00	0.34
49	600690	海尔智家	29,900	740,922.00	0.19
49	06690	海尔智家	25,200	515,926.59	0.13
50	000725	京东方A	291,800	1,164,282.00	0.30
51	002371	北方华创	2,600	1,149,746.00	0.30
52	02388	中银香港	36,500	1,135,058.57	0.30
53	00002	中电控股	18,500	1,115,178.06	0.29
54	688041	海光信息	7,600	1,073,804.00	0.28
55	09868	小鹏汽车—W	16,600	1,068,768.92	0.28
56	00016	新鸿基地产	13,000	1,067,574.27	0.28
57	688256	寒武纪科技	1,760	1,058,640.00	0.28
58	300760	迈瑞医疗	4,700	1,056,325.00	0.28
59	01801	信达生物	14,500	1,036,704.76	0.27
60	02020	安踏体育	12,000	1,034,151.30	0.27
61	09987	百胜中国	3,200	1,025,469.54	0.27
62	300308	中际旭创	6,960	1,015,185.60	0.27
63	00001	长和	22,500	991,061.66	0.26
64	300502	新易盛	7,800	990,756.00	0.26
65	00998	中信银行	91,000	620,746.13	0.16
65	601998	中信银行	42,300	359,550.00	0.09
66	02423	贝壳—W	22,400	968,272.03	0.25

67	300124	汇川技术	14,850	958,864.50	0.25
68	601668	中国建筑	164,200	947,434.00	0.25
69	600016	民生银行	197,200	936,700.00	0.24
70	002352	顺丰控股	19,200	936,192.00	0.24
71	000001	平安银行	77,200	931,804.00	0.24
72	601658	邮储银行	88,300	483,001.00	0.13
72	01658	邮储银行	87,000	434,781.28	0.11
73	002714	牧原股份	21,840	917,498.40	0.24
74	002230	科大讯飞	18,400	880,992.00	0.23
75	601127	赛力斯	6,400	859,648.00	0.22
76	02328	中国财险	62,000	859,421.68	0.22
77	603501	豪威集团	6,695	854,616.75	0.22
78	600031	三一重工	47,100	845,445.00	0.22
79	601229	上海银行	79,100	839,251.00	0.22
80	02269	药明生物	35,500	830,398.87	0.22
81	000063	中兴通讯	25,500	828,495.00	0.22
82	603019	中科曙光	11,700	823,680.00	0.22
83	002415	海康威视	29,400	815,262.00	0.21
84	601169	北京银行	117,600	803,208.00	0.21
85	600309	万华化学	14,800	803,048.00	0.21
86	300274	阳光电源	11,620	787,487.40	0.21
87	00175	吉利汽车	52,000	756,845.54	0.20

88	601919	中远海控	50,200	755,008.00	0.20
89	688008	澜起科技	9,200	754,400.00	0.20
90	00267	中信股份	76,000	747,142.40	0.20
91	01109	华润置地	30,500	739,865.04	0.19
92	600660	福耀玻璃	12,800	729,728.00	0.19
93	601688	华泰证券	40,700	724,867.00	0.19
94	601012	隆基绿能	48,231	724,429.62	0.19
95	300498	温氏股份	42,300	722,484.00	0.19
96	600406	国电南瑞	32,062	718,509.42	0.19
97	002142	宁波银行	26,200	716,832.00	0.19
98	600809	山西汾酒	4,020	709,087.80	0.19
99	00011	恒生银行	6,500	697,094.58	0.18
100	601766	中国中车	96,700	680,768.00	0.18
101	601138	工业富联	31,700	677,746.00	0.18
102	600050	中国联通	124,300	663,762.00	0.17
103	000338	潍柴动力	42,900	659,802.00	0.17
104	688012	中微半导体设备	3,600	656,280.00	0.17
105	603986	兆易创新	5,180	655,425.40	0.17
106	000568	泸州老窖	5,700	646,380.00	0.17
107	000100	TCL 科技	149,170	645,906.10	0.17
108	300476	胜宏科技	4,800	645,024.00	0.17
109	09633	农夫山泉	17,600	643,617.83	0.17

110	00992	联想集团	74,000	635,702.11	0.17
111	00027	银河娱乐	20,000	635,629.15	0.17
112	601006	大秦铁路	96,200	634,920.00	0.17
113	00006	电能实业	13,500	621,106.35	0.16
114	600926	杭州银行	36,600	615,612.00	0.16
115	601818	光大银行	147,400	611,710.00	0.16
116	601985	中国核电	65,400	609,528.00	0.16
117	01113	长实集团	19,000	599,515.93	0.16
118	601225	陕西煤业	30,900	594,516.00	0.16
119	00003	香港中华煤气	98,700	593,162.37	0.16
120	600104	上汽集团	36,800	590,640.00	0.15
121	002027	分众传媒	80,400	586,920.00	0.15
122	600150	中国船舶	17,700	575,958.00	0.15
123	600418	江淮汽车	14,000	561,260.00	0.15
124	09660	地平线机器人—W	93,000	550,425.66	0.14
125	605499	东鹏饮料	1,720	540,166.00	0.14
126	00288	万洲国际	78,000	537,047.36	0.14
127	02057	中通快递—W	4,200	530,481.32	0.14
128	603288	海天味业	13,395	521,199.45	0.14
129	688111	金山办公	1,857	520,052.85	0.14
130	600999	招商证券	29,500	518,905.00	0.14
131	688271	联影医	4,034	515,303.16	0.13

		疗			
132	601009	南京银行	43,900	510,118.00	0.13
133	600760	中航沈飞	8,688	509,290.56	0.13
134	000425	徐工机械	65,400	508,158.00	0.13
135	01093	石药集团	72,000	505,585.08	0.13
136	000625	长安汽车	39,536	504,479.36	0.13
137	000792	盐湖股份	29,500	503,860.00	0.13
138	09926	康方生物	6,000	503,122.82	0.13
139	600111	北方稀土	20,100	500,490.00	0.13
140	600436	片仔癀	2,500	500,025.00	0.13
141	300033	同花顺	1,800	491,418.00	0.13
142	600905	三峡能源	113,700	484,362.00	0.13
143	002625	光启技术	12,100	483,758.00	0.13
144	00168	青岛啤酒股份	6,000	280,424.63	0.07
144	600600	青岛啤酒	2,900	201,434.00	0.05
145	600089	特变电工	40,190	479,466.70	0.13
146	00762	中国联通	56,000	474,943.56	0.12
147	01177	中国生物制药	99,000	474,888.84	0.12
148	00688	中国海外发展	38,000	471,988.84	0.12
149	603993	洛阳钼业	55,800	469,836.00	0.12
150	002050	三花智控	17,800	469,564.00	0.12
151	601888	中国中免	7,700	469,469.00	0.12
152	600048	保利发展	57,100	462,510.00	0.12

153	300015	爱尔眼科	37,015	461,947.20	0.12
154	600019	宝钢股份	69,700	459,323.00	0.12
155	601390	中国中铁	81,500	457,215.00	0.12
156	002463	沪电股份	10,700	455,606.00	0.12
157	600547	山东黄金	14,200	453,406.00	0.12
158	600415	小商品城	21,900	452,892.00	0.12
159	002241	歌尔股份	19,400	452,408.00	0.12
160	00268	金蝶国际	32,000	450,576.26	0.12
161	300014	亿纬锂能	9,800	448,938.00	0.12
162	601825	沪农商行	45,900	445,230.00	0.12
163	601600	中国铝业	62,900	442,816.00	0.12
164	06618	京东健康	11,250	441,155.81	0.12
165	00066	港铁公司	17,000	437,188.83	0.11
166	601989	中国重工	90,500	419,920.00	0.11
167	00788	中国铁塔	40,900	418,492.03	0.11
168	02382	舜宇光学科技	6,600	417,408.63	0.11
169	000977	浪潮信息	8,100	412,128.00	0.11
170	002384	东山精密	10,900	411,693.00	0.11
171	02319	蒙牛乳业	28,000	411,107.06	0.11
172	600585	海螺水泥	19,100	410,077.00	0.11
173	600893	航发动力	10,600	408,524.00	0.11
174	600570	恒生电子	12,140	407,175.60	0.11

175	002179	中航光电	10,082	406,909.52	0.11
176	601916	浙商银行	119,780	406,054.20	0.11
177	601838	成都银行	20,200	406,020.00	0.11
178	600958	东方证券	41,624	402,920.32	0.11
179	02313	申洲国际	7,900	402,005.80	0.11
180	603799	华友钴业	10,850	401,667.00	0.11
181	600015	华夏银行	50,700	401,037.00	0.10
182	000776	广发证券	23,500	395,035.00	0.10
183	09626	哔哩哔哩-W	2,580	394,569.76	0.10
184	02688	新奥能源	6,900	394,536.93	0.10
185	000538	云南白药	7,020	391,645.80	0.10
186	01519	极兔速递-W	62,600	387,057.11	0.10
187	01378	中国宏桥	23,500	385,326.23	0.10
188	600584	长电科技	11,400	384,066.00	0.10
189	002311	海大集团	6,500	380,835.00	0.10
190	601336	新华保险	6,500	380,250.00	0.10
191	000938	紫光股份	15,800	379,042.00	0.10
192	01171	兖矿能源	28,900	205,835.32	0.05
192	600188	兖矿能源	14,155	172,266.35	0.05
193	601727	上海电气	50,500	373,195.00	0.10
194	600438	通威股份	21,500	360,125.00	0.09
195	000166	申万宏源	71,500	358,930.00	0.09

196	300408	三环集团	10,700	357,380.00	0.09
197	00020	商汤-W	260,000	353,289.43	0.09
198	601077	渝农商行	49,300	352,002.00	0.09
199	300433	蓝思科技	15,700	350,110.00	0.09
200	002028	思源电气	4,800	349,968.00	0.09
201	002049	紫光国微	5,300	349,058.00	0.09
202	000002	万科A	54,000	346,680.00	0.09
203	01308	海丰国际	15,000	344,033.14	0.09
204	600795	国电电力	70,800	342,672.00	0.09
205	02331	李宁	22,000	339,464.27	0.09
206	600489	中金黄金	23,200	339,416.00	0.09
207	601377	兴业证券	54,800	339,212.00	0.09
208	601669	中国电建	68,500	333,595.00	0.09
209	01038	长江基建集团	7,000	331,630.62	0.09
210	00291	华润啤酒	14,500	330,581.88	0.09
211	601995	中金公司	9,300	328,848.00	0.09
212	00012	恒基地产	13,000	325,429.36	0.09
213	01997	九龙仓置业	16,000	323,924.64	0.08
214	600010	包钢股份	180,000	322,200.00	0.08
215	601689	拓普集团	6,775	320,118.75	0.08
216	00083	信和置业	42,000	319,820.87	0.08
217	002422	科伦药业	8,900	319,688.00	0.08

218	601100	恒立液 压	4,400	316,800.00	0.08
219	600522	中天科 技	21,800	315,228.00	0.08
220	600009	上海机 场	9,900	314,523.00	0.08
221	00836	华润电 力	18,000	310,901.99	0.08
222	01928	金沙中 国有限 公司	20,800	309,946.27	0.08
223	600160	巨化股 份	10,800	309,744.00	0.08
224	300394	天孚通 信	3,860	308,182.40	0.08
225	000768	中航西 飞	11,100	303,474.00	0.08
226	002460	赣锋锂 业	8,960	302,579.20	0.08
227	688036	传音控 股	3,760	299,672.00	0.08
228	002304	洋河股 份	4,600	296,930.00	0.08
229	601881	中国银 河	17,200	294,980.00	0.08
230	688169	石头科 技	1,876	293,687.80	0.08
231	600183	生益科 技	9,700	292,455.00	0.08
232	601186	中国铁 建	36,500	292,365.00	0.08
233	03888	金山软 件	7,800	290,930.29	0.08
234	002252	上海莱 士	42,300	290,601.00	0.08
235	600839	四川长 虹	29,700	288,684.00	0.08
236	000157	中联重 科	39,500	285,585.00	0.07
237	601360	三六零	27,800	283,560.00	0.07
238	06969	思摩尔 国际	17,000	282,777.46	0.07
239	600886	国投电 力	19,100	281,534.00	0.07

240	600989	宝丰能源	17,400	280,836.00	0.07
241	002074	国轩高科	8,600	279,156.00	0.07
242	000963	华东医药	6,900	278,484.00	0.07
243	00135	昆仑能源	40,000	277,962.36	0.07
244	601555	东吴证券	31,690	277,287.50	0.07
245	601788	光大证券	15,400	276,892.00	0.07
246	601058	赛轮轮胎	21,000	275,520.00	0.07
247	600115	中国东航	68,100	274,443.00	0.07
248	06862	海底捞	20,000	271,761.10	0.07
249	03692	翰森制药	10,000	271,305.13	0.07
250	000661	长春高新	2,700	267,786.00	0.07
251	002736	国信证券	23,000	264,960.00	0.07
252	000807	云铝股份	16,500	263,670.00	0.07
253	600066	宇通客车	10,600	263,516.00	0.07
254	002466	天齐锂业	8,200	262,728.00	0.07
255	300442	润泽科技	5,300	262,509.00	0.07
256	002001	新和成	12,300	261,621.00	0.07
257	000408	藏格矿业	6,100	260,287.00	0.07
258	002340	格林美	40,800	259,080.00	0.07
259	601901	方正证券	32,700	258,657.00	0.07
260	603893	瑞芯微	1,700	258,162.00	0.07
261	600426	华鲁恒升	11,880	257,439.60	0.07
262	301236	软通动力	4,700	256,808.00	0.07

263	00151	中国旺旺	51,000	254,871.79	0.07
264	300661	圣邦股份	3,493	254,185.61	0.07
265	000975	山金国际	13,400	253,796.00	0.07
266	600196	复星医药	10,100	253,409.00	0.07
267	001979	招商蛇口	28,800	252,576.00	0.07
268	02367	巨子生物	4,800	252,573.67	0.07
269	600029	南方航空	42,700	251,930.00	0.07
270	601800	中国交建	28,300	251,587.00	0.07
271	002156	通富微电	9,800	251,076.00	0.07
272	00241	阿里健康	58,000	250,713.29	0.07
273	601066	中信建投	10,400	250,120.00	0.07
274	600011	华能国际	34,900	249,186.00	0.07
275	002236	大华股份	15,600	247,728.00	0.06
276	600674	川投能源	15,400	247,016.00	0.06
277	688126	上海硅产业集团	12,948	242,386.56	0.06
278	600487	亨通光电	15,800	241,740.00	0.06
279	02018	瑞声科技	6,500	241,256.37	0.06
280	06186	中国飞鹤	46,000	239,532.79	0.06
281	601878	浙商证券	21,900	238,929.00	0.06
282	600346	恒力石化	16,700	238,142.00	0.06
283	688506	百利天恒药业	800	236,896.00	0.06
284	601111	中国国	29,800	235,122.00	0.06

		航			
285	688777	中控技术	5,235	235,103.85	0.06
286	002920	德赛西威	2,300	234,899.00	0.06
287	002648	卫星化学	13,498	233,920.34	0.06
288	300418	昆仑万维	6,900	232,047.00	0.06
289	00285	比亚迪电子	8,000	232,000.08	0.06
290	600372	中航机载	19,216	231,744.96	0.06
291	600460	士兰微	9,300	230,826.00	0.06
292	002916	深南电路	2,140	230,713.40	0.06
293	601868	中国能建	103,000	229,690.00	0.06
294	600745	闻泰科技	6,800	228,004.00	0.06
295	003816	中国广核	62,400	227,136.00	0.06
296	000066	中国长城	15,300	226,440.00	0.06
297	603369	今世缘	5,800	225,794.00	0.06
298	600096	云天化	10,200	224,094.00	0.06
299	300347	泰格医药	4,200	223,944.00	0.06
300	601117	中国化学	29,100	223,197.00	0.06
301	301269	华大九天	1,800	222,984.00	0.06
302	601168	西部矿业	13,400	222,842.00	0.06
303	601021	春秋航空	4,000	222,600.00	0.06
304	600741	华域汽车	12,600	222,390.00	0.06
305	601319	中国人保	25,300	220,363.00	0.06
306	600176	中国巨石	19,136	218,150.40	0.06
307	600256	广汇能	36,100	217,322.00	0.06

		源			
308	002601	龙佰集团	13,400	217,214.00	0.06
309	300782	卓胜微	3,036	216,679.32	0.06
310	600588	用友网络	16,200	216,594.00	0.06
311	03311	中国建筑国际	20,000	215,949.76	0.06
312	300450	先导智能	8,640	214,704.00	0.06
313	00019	太古股份公司 A	3,500	214,650.23	0.06
314	01209	华润万象生活	6,200	214,572.72	0.06
315	002555	三七互娱	12,400	214,396.00	0.06
316	01929	周大福	17,400	212,947.62	0.06
317	601633	长城汽车	9,900	212,652.00	0.06
318	000786	北新建材	8,000	211,840.00	0.06
319	600219	南山铝业	55,300	211,799.00	0.06
320	302132	中航成飞	2,400	211,056.00	0.06
321	300896	爱美客	1,200	209,772.00	0.05
322	00322	康师傅控股	20,000	209,748.50	0.05
323	000933	神火股份	12,600	209,664.00	0.05
324	02618	京东物流	17,400	208,504.60	0.05
325	688396	华润微电子	4,401	207,551.16	0.05
326	600039	四川路桥	20,860	206,514.00	0.05
327	600885	宏发股份	9,224	205,787.44	0.05
328	600482	中国动力	8,900	205,323.00	0.05
329	000630	铜陵有色	61,100	204,074.00	0.05

330	601108	财通证券	25,770	203,840.70	0.05
331	605117	德业股份	3,858	203,162.28	0.05
332	00960	龙湖集团	24,000	202,671.77	0.05
333	603296	华勤技术	2,500	201,700.00	0.05
334	000895	双汇发展	8,200	200,162.00	0.05
335	002493	荣盛石化	23,990	198,637.20	0.05
336	002129	TCL 中环	25,650	196,992.00	0.05
337	001965	招商公路	16,200	194,400.00	0.05
338	002709	天赐材料	10,700	193,884.00	0.05
339	300223	北京君正	2,800	193,760.00	0.05
340	000423	东阿阿胶	3,700	193,510.00	0.05
341	300866	安克创新	1,700	193,120.00	0.05
342	603392	万泰生物	3,160	192,760.00	0.05
343	601877	正泰电器	8,500	192,695.00	0.05
344	002600	领益智造	22,400	192,416.00	0.05
345	600362	江西铜业	8,200	192,126.00	0.05
346	600085	同仁堂	5,300	191,118.00	0.05
347	00384	中国燃气	28,400	189,842.46	0.05
348	688072	拓荆科技	1,224	188,141.04	0.05
349	02097	蜜雪集团	400	187,496.92	0.05
350	300122	智飞生物	9,500	186,105.00	0.05
351	03800	协鑫科技	200,000	182,390.00	0.05
352	000783	长江证	26,300	182,259.00	0.05

		券			
353	300832	新产业	3,200	181,504.00	0.05
354	002180	纳思达	7,900	181,226.00	0.05
355	600161	天坛生物	9,440	181,153.60	0.05
356	300765	新诺威	3,500	180,915.00	0.05
357	002078	太阳纸业	13,400	180,364.00	0.05
358	00270	粤海投资	30,000	179,471.76	0.05
359	600233	圆通速递	13,800	177,882.00	0.05
360	03998	波司登	42,000	177,720.82	0.05
361	002128	电投能源	8,900	176,042.00	0.05
362	603606	东方电缆	3,400	175,814.00	0.05
363	000301	东方盛虹	21,100	175,763.00	0.05
364	01972	太古地产	9,800	175,167.36	0.05
365	688047	龙芯中科	1,311	174,874.29	0.05
366	000596	古井贡酒	1,300	173,095.00	0.05
367	002938	鹏鼎控股	5,400	172,962.00	0.05
368	300759	康龙化成	6,950	170,553.00	0.04
369	600023	浙能电力	32,100	170,130.00	0.04
370	601618	中国中冶	56,700	168,966.00	0.04
371	000876	新希望	18,000	168,840.00	0.04
372	002202	金风科技	16,400	168,100.00	0.04
373	688223	晶科能源	31,901	165,566.19	0.04
374	600298	安琪酵母	4,700	165,299.00	0.04
375	000999	华润三九	5,202	162,718.56	0.04

376	600875	东方电 气	9,700	162,378.00	0.04
377	603605	珀莱雅	1,960	162,268.40	0.04
378	002271	东方雨 虹	15,050	161,486.50	0.04
379	600845	宝信软 件	6,812	160,899.44	0.04
380	601872	招商轮 船	25,600	160,256.00	0.04
381	600515	海南机 场	45,200	160,008.00	0.04
382	603659	璞泰来	8,486	159,367.08	0.04
383	601898	中煤能 源	14,400	157,536.00	0.04
384	03808	中国重 汽	7,500	156,627.41	0.04
385	00144	招商局 港口	12,000	156,490.62	0.04
386	002459	晶澳科 技	15,676	156,446.48	0.04
387	600061	国投资 本	20,400	153,408.00	0.04
388	601799	星宇股 份	1,200	150,000.00	0.04
389	09896	名创优 品	4,600	149,340.93	0.04
390	01193	华润燃 气	8,100	148,105.24	0.04
391	601216	君正集 团	26,800	147,936.00	0.04
392	600027	华电国 际	27,000	147,690.00	0.04
393	688599	天合光 能	10,101	146,767.53	0.04
394	000617	中油资 本	20,100	146,730.00	0.04
395	000983	山西焦 煤	22,700	145,280.00	0.04
396	600332	白云山	5,500	144,980.00	0.04
397	000932	华菱钢 铁	32,900	144,760.00	0.04
398	300628	亿联网 络	4,160	144,601.60	0.04

399	00881	中升控股	13,000	143,449.74	0.04
400	600918	中泰证券	22,300	143,389.00	0.04
401	601696	中银证券	13,400	143,246.00	0.04
402	601233	桐昆股份	13,500	143,100.00	0.04
403	002812	恩捷股份	4,800	140,592.00	0.04
404	002414	高德红外	13,681	140,230.25	0.04
405	300316	晶盛机电	5,100	138,465.00	0.04
406	600803	新奥股份	7,300	137,970.00	0.04
407	00868	信义玻璃	20,000	137,522.06	0.04
408	603260	合盛硅业	2,900	137,460.00	0.04
409	01585	雅迪控股	12,000	137,449.10	0.04
410	002007	华兰生物	8,700	136,329.00	0.04
411	300999	金龙鱼	4,600	135,838.00	0.04
412	600025	华能水电	14,200	135,610.00	0.04
413	601698	中国卫通	6,600	135,102.00	0.04
414	688249	晶合集成	6,600	133,782.00	0.03
415	600642	申能股份	15,400	132,440.00	0.03
416	601238	广汽集团	17,600	131,824.00	0.03
417	601059	信达证券	7,700	131,670.00	0.03
418	688188	上海柏楚电子科技	980	129,026.80	0.03
419	600018	上港集团	22,300	127,333.00	0.03
420	600765	中航重机	7,500	126,600.00	0.03

421	300413	芒果超媒	5,800	126,556.00	0.03
422	300919	中伟股份	3,840	126,259.20	0.03
423	601567	三星医疗	5,500	123,310.00	0.03
424	02282	美高梅中国	10,400	122,157.53	0.03
425	00316	东方海外国际	1,000	121,654.13	0.03
426	03668	兖煤澳大利亚	4,500	121,266.55	0.03
427	601607	上海医药	6,600	118,008.00	0.03
428	00293	国泰航空	12,000	117,094.38	0.03
429	00101	恒隆地产	17,000	116,118.59	0.03
430	600026	中远海能	11,100	114,663.00	0.03
431	02380	中国电力	42,000	114,522.68	0.03
432	603939	益丰药房	4,673	114,348.31	0.03
433	00968	信义光能	50,000	113,537.78	0.03
434	601018	宁波港	31,000	113,460.00	0.03
435	688303	大全能源	5,300	112,996.00	0.03
436	02588	中银航空租赁	1,900	112,625.83	0.03
437	600132	重庆啤酒	2,000	110,200.00	0.03
438	002939	长城证券	12,900	108,102.00	0.03
439	603806	福斯特	8,285	107,373.60	0.03
440	603195	公牛集团	2,208	106,536.00	0.03
441	01876	百威亚太	15,000	106,287.77	0.03
442	688009	中国通号	20,600	105,884.00	0.03
443	688472	阿特斯	11,500	105,225.00	0.03

		阳光电力			
444	002064	华峰化学	15,700	103,777.00	0.03
445	601699	潞安环能	9,500	100,225.00	0.03
446	688728	格科微有限公司	6,400	98,560.00	0.03
447	600985	淮北矿业	8,500	96,390.00	0.03
448	000708	中信特钢	8,000	94,080.00	0.02
449	688082	盛美上海半导体	792	90,240.48	0.02
450	601865	福莱特	5,900	89,739.00	0.02
451	688187	时代电气	2,101	89,607.65	0.02
452	601136	首创证券	4,500	89,460.00	0.02
453	301308	江波龙	1,000	87,490.00	0.02
454	603899	晨光股份	3,000	86,970.00	0.02
455	603833	欧派家居	1,500	84,675.00	0.02
456	000987	越秀资本	12,086	82,909.96	0.02
457	603198	迎驾贡酒	2,000	78,860.00	0.02
458	300751	迈为股份	1,120	77,907.20	0.02
459	601231	环旭电子	5,100	74,613.00	0.02
460	002032	苏泊尔	1,300	68,107.00	0.02
461	601808	中海油服	4,800	66,048.00	0.02
462	600968	海油发展	16,100	65,688.00	0.02
463	300979	华利集团	1,200	63,084.00	0.02
464	600377	宁沪高速	4,100	62,894.00	0.02

465	600350	山东高速	5,300	56,498.00	0.01
466	600236	桂冠电力	8,700	54,549.00	0.01
467	000800	一汽解放	7,800	53,508.00	0.01
468	001286	陕西能源	5,800	50,460.00	0.01
469	601298	青岛港	5,400	46,926.00	0.01
470	001391	国货航	6,800	45,764.00	0.01
471	001872	招商港口	1,900	37,734.00	0.01
472	601061	中信金属	4,400	34,804.00	0.01
473	002945	华林证券	2,200	31,614.00	0.01
474	001289	龙源电力	1,200	19,416.00	0.01

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	600519	贵州茅台	2,200,186.00	0.50
2	601211	国泰海通	1,138,328.56	0.26
3	00700	腾讯控股	1,104,830.38	0.25
4	02423	贝壳－W	1,025,703.47	0.23
5	002594	比亚迪	428,530.00	0.10
5	01211	比亚迪股份	238,344.12	0.05
6	09988	阿里巴巴－W	617,944.08	0.14
7	09660	地平线机器人－W	603,378.57	0.14
8	01810	小米集团－W	589,234.10	0.13
9	300476	胜宏科技	528,244.00	0.12

10	00005	汇丰控股	524,896.53	0.12
11	300760	迈瑞医疗	483,329.00	0.11
12	601166	兴业银行	432,187.00	0.10
13	00883	中国海洋石油	256,162.09	0.06
13	600938	中国海油	91,083.00	0.02
14	601328	交通银行	233,513.00	0.05
14	03328	交通银行	103,242.25	0.02
15	00992	联想集团	311,836.89	0.07
16	002230	科大讯飞	305,753.00	0.07
17	00981	中芯国际	192,255.92	0.04
17	688981	中芯国际	110,298.00	0.03
18	000858	五粮液	297,994.00	0.07
19	00001	长和	294,018.76	0.07
20	600839	四川长虹	293,267.00	0.07

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	00700	腾讯控股	7,963,475.31	1.82
2	09988	阿里巴巴—W	5,694,919.87	1.30
3	00005	汇丰控股	4,200,766.70	0.96
4	03690	美团—W	2,196,873.77	0.50
5	01810	小米集团—W	2,108,205.91	0.48
6	002594	比亚迪	1,111,323.00	0.25
6	01211	比亚迪股份	854,977.59	0.20
7	00939	建设银行	1,905,553.81	0.44
8	300750	宁德时代	1,720,249.00	0.39
9	01299	友邦保险	1,675,604.26	0.38
10	03988	中国银行	870,046.82	0.20
10	601988	中国银行	366,120.00	0.08
11	00941	中国移动	1,177,402.41	0.27
12	01398	工商银行	1,134,064.44	0.26
13	000333	美的集团	930,896.00	0.21
13	00300	美的集团	180,801.01	0.04
14	600837	海通证券	1,054,240.56	0.24
15	00388	香港交易所	1,001,438.22	0.23

16	00883	中国海洋石油	946,205.37	0.22
17	000858	五粮液	833,647.00	0.19
18	300059	东方财富	816,750.00	0.19
19	02318	中国平安	779,421.11	0.18
20	300760	迈瑞医疗	777,814.00	0.18

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	28,263,115.62
卖出股票收入（成交）总额	81,983,515.75

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	-	-
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）	3,500.23	0.00
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	3,500.23	0.00

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	123257	安克转债	35	3,500.23	0.00

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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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

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	2,230,184.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	927,418.39
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	3,157,603.27

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 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

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（%）
12,236	35,400.95	10,742,592.00	2.48	422,423,408.00	97.52

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中信建投证券股份有限公司	3,482,585.00	0.80
2	刘贞峰	3,160,000.00	0.73
3	朴昌建	3,000,000.00	0.69
4	刘兴玥	2,419,200.00	0.56
5	中信证券股份有限公司	2,357,307.00	0.54
6	周巍	2,341,900.00	0.54
7	潘卉	2,292,700.00	0.53
8	王长春	2,170,200.00	0.50
9	马玉洪	2,140,900.00	0.49
10	柯文贤	1,500,000.00	0.35

10	严世辰	1,500,000.00	0.35
10	赵笑亚	1,500,000.00	0.35

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 02 月 01 日）基金份额总额	1,089,166,000.00
本报告期期初基金份额总额	541,166,000.00
本报告期基金总申购份额	20,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	128,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	433,166,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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（%）	
华泰证券	2	74,401,940.37	68.80	16,338.17	70.56	
银河证券	5	33,071,780.28	30.58	6,693.24	28.91	
兴业证券	2	568,912.00	0.53	100.02	0.43	
中金公司	2	95,517.60	0.09	22.92	0.10	
长江证券	1	—	—	—	—	

东方 证券	4	-	-	-	-	
东吴 证券	2	-	-	-	-	
东兴 证券	1	-	-	-	-	
方正 证券	1	-	-	-	-	
高盛 中国	1	-	-	-	-	
光大 证券	1	-	-	-	-	
广发 证券	1	-	-	-	-	
国都 证券	1	-	-	-	-	
国金 证券	2	-	-	-	-	
国泰 海通	4	-	-	-	-	
国投 证券	2	-	-	-	-	
国新 证券	2	-	-	-	-	
国信 证券	2	-	-	-	-	
华鑫 证券	3	-	-	-	-	
上海 证券	1	-	-	-	-	
申万 宏源 证券	1	-	-	-	-	
西南 证券	1	-	-	-	-	
招商 证券	4	-	-	-	-	
中金 财富	1	-	-	-	-	
中泰 证券	1	-	-	-	-	
中信 建投 证券	1	-	-	-	-	

中信 证券	1	-	-	-	-	
中银 国际	1	-	-	-	-	

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

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(%)
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	29,723.14	100.00	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛 中国	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 2 家证券公司的 4 个交易单元：银河证券（深交所单元，上交所单元）、招商证券（上交所单元，深交所单元）；不再租用 1 家证券公司的 1 个交易单元：长城证券（上交所单元）。

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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东北证券为申购赎回代理券商的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 07 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第四季度报告	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报	2025 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券为申购赎回代理券商的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 13 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 21 日
5	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 02 月 21 日
6	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
7	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	2025 年 03 月 31 日

		国证监会基金电子披露网站	
8	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	上交所, 中证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 16 日
9	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
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报, 上交所, 深交所	2025 年 04 月 30 日
11	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
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 23 日
13	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
14	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	上交所, 中证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 27 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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

- 2、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

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