

汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金 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	8
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	16
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	17
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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 净资产变动表	21
6.4 报表附注	23
§ 7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	78
§ 9 开放式基金份额变动	79
§ 10 重大事件揭示	80
10.1 基金份额持有人大会决议.....	80
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.....	80
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
10.4 基金投资策略的改变.....	80
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
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.....	80
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	80
10.8 其他重大事件.....	84
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	85
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.....	85
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	85
§ 12 备查文件目录	85
12.1 备查文件目录.....	85
12.2 存放地点	86
12.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金		
基金简称	汇添富中证 500 指数增强		
基金主代码	001050		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2023 年 04 月 25 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）	1, 279, 073, 662. 41		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C	汇添富中证 500 指数增强 Y
下属分级基金的交易代码	001050	016854	022893
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	1, 019, 770, 573. 86	254, 326, 239. 26	4, 976, 849. 29

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；股票投资策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；可转债及可交换债投资策略；股指期货投资策略；股票期权投资策略；融资及转融通证券出借业务投资策略；国债期货投资策略等。

业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	<p>本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定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。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	（010）66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	（010）66105798
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		鲁伟铭	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日)		
	汇添富中证 500 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C	汇添富中证 500 指数增强 Y
本期已实现收益	73,729,525.58	21,592,174.93	292,899.25
本期利润	99,962,393.06	17,490,579.96	460,413.62
加权平均基金份额本期利润	0.0769	0.0343	0.1128
本期加权平均净值利润率	4.75%	2.14%	6.94%
本期基金份额净值增长率	4.48%	4.27%	4.74%
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	519,490,759.73	124,778,663.32	2,559,259.36
期末可供分配基金份额利润	0.5094	0.4906	0.5142
期末基金资产净值	1,729,941,621.46	426,475,927.76	8,467,112.28
期末基金份额净值	1.6964	1.6769	1.7013
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	12.72%	11.72%	2.11%

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 指数增强 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	4.21%	0.69%	4.09%	0.75%	0.12%	-0.06%
过去三个月	3.26%	1.40%	0.97%	1.43%	2.29%	-0.03%
过去六个月	4.48%	1.20%	3.21%	1.29%	1.27%	-0.09%
过去一年	19.02%	1.47%	18.83%	1.64%	0.19%	-0.17%
自基金合同生效起至今	12.72%	1.27%	-4.20%	1.40%	16.92%	-0.13%
汇添富中证 500 指数增强 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	4.17%	0.69%	4.09%	0.75%	0.08%	-0.06%
过去三个月	3.15%	1.40%	0.97%	1.43%	2.18%	-0.03%
过去六个月	4.27%	1.20%	3.21%	1.29%	1.06%	-0.09%
过去一年	18.54%	1.47%	18.83%	1.64%	-0.29%	-0.17%
自基金合同生效起至今	11.72%	1.27%	-4.20%	1.40%	15.92%	-0.13%
汇添富中证 500 指数增强 Y						
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	4.25%	0.69%	4.09%	0.75%	0.16%	-0.06%

个月						
过去三 个月	3.38%	1.40%	0.97%	1.43%	2.41%	-0.03%
过去六 个月	4.74%	1.20%	3.21%	1.29%	1.53%	-0.09%
自基金 合同生 效起至 今	2.11%	1.18%	-1.09%	1.28%	3.20%	-0.10%

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

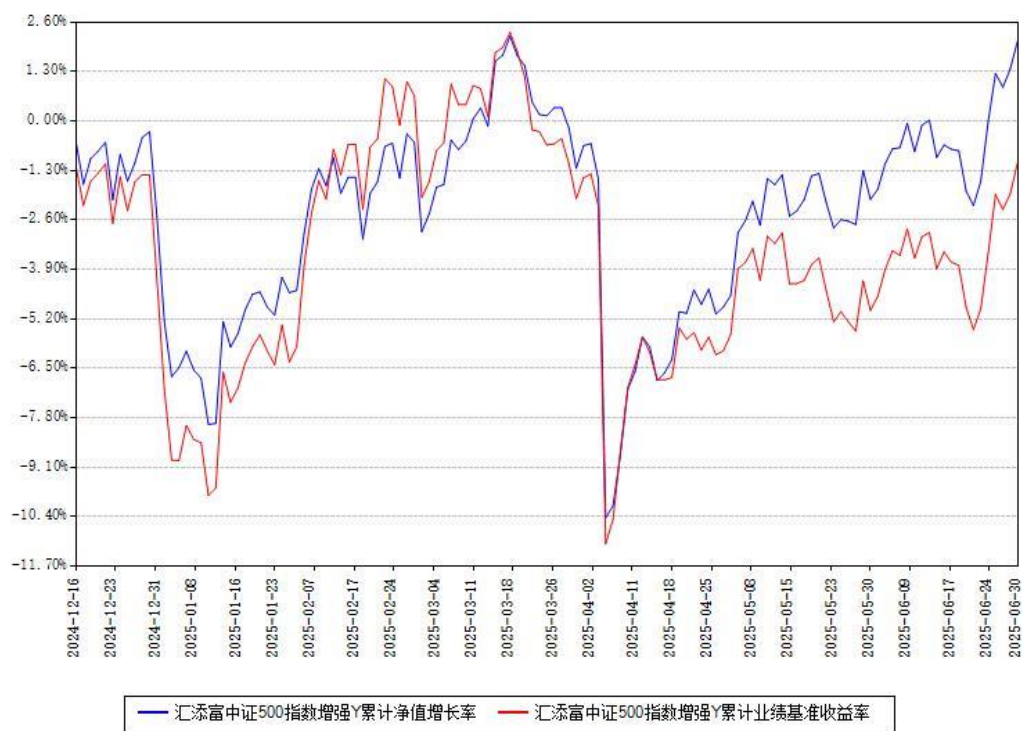
汇添富中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数增强C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指数增强Y累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023 年 04 月 25 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。

本基金由原汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金于 2023 年 04 月 25 日转型而来。

本基金于 2024 年 12 月 13 日新增 Y 类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基金经理	2023 年 04 月 25 日	-	15	国籍：中国。学历：上海财经大

					<p>学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。</p> <p>2015 年 11 月 24 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。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 2 日至 2024 年 7 月 11 日任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至 2025 年 3 月 8 日任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月 19 日至今任汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 14 日至今任汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳元回报债券型发起式证券</p>
--	--	--	--	--	---

					投资基金的基金经理。 2024 年 3 月 28 日至今任汇添富稳兴回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
许一尊	公募基金	8	6,933,148,142.60	2018 年 3 月 23 日
	私募资产管理计划	1	10,512,840.91	2025 年 3 月 11 日
	其他组合	-	-	
	合计	9	6,943,660,983.51	

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:

许一尊—离任产品类型:公募基金,离任数量:1只,离任时间:2025 年 3 月 8 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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规

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

2025 年上半年，中国经济在复杂外部环境下呈现复苏态势，整体保持韧性，但内生动能仍显不足。一季度经济稳中有进，制造业 PMI 持续扩张，工业、消费和投资表现良好，工业生产偏强，消费逐步回暖，制造业与高技术产业投资保持高增长，基建托底作用延续，房地产边际改善。二季度经济修复呈现分化态势，生产端维持较强韧性，外需好于预期，但内需仍显疲软，企业内生融资需求不足，呈现弱修复特征。政策层面，财政政策聚焦科技创新、消费提振及稳定传统行业，同时防范房地产下行风险；货币政策维持适度宽松，通过降准、降息及公开市场操作保持流动性合理充裕。外部环境方面，中美贸易政策反复波动，关税加码与阶段性缓和交替出现，对市场预期形成扰动。

权益市场方面，上半年整体呈现震荡上行格局，结构性行情突出。科技成长板块持续领涨，半导体、AI 等新兴领域表现亮眼，带动市场情绪回暖；银行等高股息板块在二季度因避险需求走强，而地产链和传统消费相对疲弱。市场风格整体表现为小盘优于大盘、成长优于价值、高 Beta 优于低 Beta。选股因子方面，短期交易、盈利质量类因子有效性较高，而低估值等逆向类因子相对弱势。

报告期内，本基金使用规则化的多因子选股策略构建组合，保持了相对均衡的因子配置，结合风险控制模型控制组合相对基准在风格、行业、个股上的偏离。由于质量、估值等稳健因子配置较多，而区间内高 Beta 风格相对更加强势，区间内超额收益比较一般。未来将继续努力保持对量化选股模型和风险控制模型的迭代更新，提高对市场风格变化的应对能力，提升超额收益的稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 500 指数增强 A 类份额净值增长率为 4.48%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。本报告期汇添富中证 500 指数增强 C 类份额净值增长率为 4.27%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。本报告期汇添富中证 500 指数增强 Y 类份额净值增长率为 4.74%，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

展望下半年，中国宏观经济预计在内外复杂环境下延续弱修复态势，呈现“财政托底、外需韧性、内需磨底”的特征。增长节奏或呈“N 型”：7-8 月受高基数、地产二次探底及出口脉冲回落影响，经济可能再度承压；9 月后随着基建投资、公共消费等财政增量工具逐步落地，四季度经济有望温和回升。物价方面，CPI 中枢维持低位，核心通胀疲软；PPI 同比

跌幅因能源与黑色系低基数收窄，但难回正区间。政策层面，财政与货币协同发力，财政扩张窗口大概率延后至三季度末，重点支持城市更新、民生等领域；货币政策保持灵活宽松，可能通过降准、降息及国债买卖缓解流动性压力。外部环境方面，全球补库周期支撑外需韧性，但美国关税政策反复可能阶段性扰动出口，国际经贸磋商推进或部分对冲风险。

权益市场方面，随着经济基本面逐步企稳，叠加政策托底，市场下方风险有限。同时，利率处于低位，资金面有所好转，市场参与者对权益市场的信心提升，带动风险偏好回暖，有利于结构性行情的演绎。成长风格受益于流动性维持宽松、AI 产业链景气度提升、政策与地缘因素驱动，可能保持相对强势；同时，高股息资产如银行、公用事业等防御性板块在低利率环境下仍具吸引力，尤其是具备稳定盈利能力和分红能力的龙头个股。选股因子方面，随着上市公司治理水平的提升，长期资金逐步入市，理性投资、价值投资、长期投资得到进一步重视，高质量风格可能存在长期超额收益；在市场风险偏好回暖、交易活跃的背景下，景气度、预期及短期交易类因子也可能有较好表现。

本基金使用量化选股模型挑选个股，保持风格和行业的相对均衡，具有较鲜明的中盘均衡风格。随着投资者信心企稳，基本面质地优良，估值合理，成长空间大的中盘公司可能有所表现。未来将继续努力提升风险管理和组合精细化管理能力，提升对市场风格变动的适应能力，力争获得较为稳定的超额收益。

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。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人

可对 A 类基金份额、C 类基金份额、Y 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红，Y 类基金份额默认的收益分配方式是红利再投资；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 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 500 指数增强型证券投资基金

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	130,182,795.81	200,263,724.66
结算备付金		10,430,953.18	15,990,358.22
存出保证金		820,987.85	712,837.15
交易性金融资产	6.4.7.2	2,032,431,446.21	3,093,494,947.77
其中: 股票投资		2,029,068,223.29	3,090,845,258.56
基金投资		-	-
债券投资		3,363,222.92	2,649,689.21
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		207,746,660.75	11,102,865.28
应收股利		-	-
应收申购款		5,992,010.24	13,421,208.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,387,604,854.04	3,334,985,941.91
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		-	28,945,674.83
应付赎回款		219,402,816.47	8,251,024.36
应付管理人报酬		1,555,002.30	2,222,044.00
应付托管费		388,750.63	555,511.05
应付销售服务费		151,831.89	335,806.14
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	1,221,790.91	1,657,261.83
负债合计		222,720,192.54	41,967,322.21
净资产:			

实收基金	6.4.7.8	1,279,073,662.41	2,034,080,351.72
未分配利润	6.4.7.9	885,810,999.09	1,258,938,267.98
净资产合计		2,164,884,661.50	3,293,018,619.70
负债和净资产总计		2,387,604,854.04	3,334,985,941.91

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,279,073,662.41 份。本基金下属汇添富中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.6964 元，基金份额总额 1,019,770,573.86 份；本基金下属汇添富中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.6769 元，基金份额总额 254,326,239.26 份；本基金下属汇添富中证 500 指数增强 Y 基金份额净值 1.7013 元，基金份额总额 4,976,849.29 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金

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		134,193,818.54	-58,504,974.14
1. 利息收入		351,383.27	371,131.46
其中：存款利息收入	6.4.7.10	351,383.27	371,131.46
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）		111,190,905.47	-24,760,815.74
其中：股票投资收益	6.4.7.11	83,332,793.15	-65,871,241.47
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	16,567.70	278,533.80
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	1,427.69	8,960,765.77
股利收益	6.4.7.17	27,840,116.93	31,871,126.16
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	22,298,786.88	-34,170,768.11
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	352,742.92	55,478.25
减：二、营业总支出		16,280,431.90	13,713,046.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,645,960.11	9,863,136.03

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	2, 911, 490. 11	2, 465, 784. 07
3. 销售服务费		1, 627, 329. 21	1, 246, 466. 34
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		7. 04	32, 270. 91
8. 其他费用	6. 4. 7. 21	95, 645. 43	105, 389. 14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		117, 913, 386. 64	-72, 218, 020. 63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		117, 913, 386. 64	-72, 218, 020. 63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		117, 913, 386. 64	-72, 218, 020. 63

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金

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	2, 034, 080, 351. 72	1, 258, 938, 267. 98	3, 293, 018, 619. 70
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2, 034, 080, 351. 72	1, 258, 938, 267. 98	3, 293, 018, 619. 70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-755, 006, 689. 31	-373, 127, 268. 89	-1, 128, 133, 958. 20
（一）、综合收益总额	-	117, 913, 386. 64	117, 913, 386. 64
（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）	-755, 006, 689. 31	-491, 040, 655. 53	-1, 246, 047, 344. 84
其中：1. 基金申	1, 373, 637, 195. 94	857, 266, 359. 36	2, 230, 903, 555. 30

购款			
2. 基金赎回款	-2, 128, 643, 885. 25	-1, 348, 307, 014. 89	-3, 476, 950, 900. 14
（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	1, 279, 073, 662. 41	885, 810, 999. 09	2, 164, 884, 661. 50
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	2, 217, 454, 257. 62	1, 020, 158, 572. 16	3, 237, 612, 829. 78
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	2, 217, 454, 257. 62	1, 020, 158, 572. 16	3, 237, 612, 829. 78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-845, 290, 434. 12	-439, 896, 518. 99	-1, 285, 186, 953. 11
（一）、综合收益总额	-	-72, 218, 020. 63	-72, 218, 020. 63
（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）	-845, 290, 434. 12	-367, 678, 498. 36	-1, 212, 968, 932. 48
其中：1. 基金申购款	997, 112, 534. 68	401, 846, 462. 69	1, 398, 958, 997. 37
2. 基金赎回款	-1, 842, 402, 968. 80	-769, 524, 961. 05	-2, 611, 927, 929. 85
（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	1, 372, 163, 823. 50	580, 262, 053. 17	1, 952, 425, 876. 67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

基金管理人负责人

李骁

主管会计工作负责人

雷青松

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 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），是由汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金变更而来。原汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资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[2015]117 号文《关于准予汇添富成长多因子量化策略股票型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 2015 年 2 月 16 日生效。首次设立基金募集规模为 1,903,140,954.30 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（2015）验字第 60466941_B06 号验资报告予以验证。

根据《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会于 2023 年 4 月 17 日表决通过了《关于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金转型的议案》。自 2023 年 4 月 25 日起，本基金名称变更为“汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金”。《汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 25 日起生效，原《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于同一日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类基金份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、

《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业

协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	130,182,795.81
等于：本金	130,169,266.00
加：应计利息	13,529.81
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	130,182,795.81

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		2,013,628,138.22	-	2,029,068,223.29	15,440,085.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,332,154.00	29,042.92	3,363,222.92	2,026.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	3,332,154.00	29,042.92	3,363,222.92	2,026.00

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,016,960,292.22	29,042.92	2,032,431,446.21	15,442,111.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,126,579.48
其中：交易所市场	1,126,579.48
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	35,704.06
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	1, 221, 790. 91

6. 4. 7. 8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数增强 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	1, 402, 936, 087. 41	1, 402, 936, 087. 41
本期申购	1, 058, 025, 323. 60	1, 058, 025, 323. 60
本期赎回（以“-”号填列）	-1, 441, 190, 837. 15	-1, 441, 190, 837. 15
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	1, 019, 770, 573. 86	1, 019, 770, 573. 86
汇添富中证 500 指数增强 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	629, 549, 825. 66	629, 549, 825. 66
本期申购	311, 606, 519. 33	311, 606, 519. 33
本期赎回（以“-”号填列）	-686, 830, 105. 73	-686, 830, 105. 73
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	254,326,239.26	254,326,239.26
汇添富中证 500 指数增强 Y		
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	1,594,438.65	1,594,438.65
本期申购	4,005,353.01	4,005,353.01
本期赎回（以“-”号填列）	-622,942.37	-622,942.37
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	4,976,849.29	4,976,849.29

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 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	629,113,167.59	245,887,799.35	875,000,966.94
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	629,113,167.59	245,887,799.35	875,000,966.94
本期利润	73,729,525.58	26,232,867.48	99,962,393.06
本期基金份额交易产生的变动数	-183,351,933.44	-81,440,378.96	-264,792,312.40
其中：基金申购款	497,749,204.18	166,931,796.11	664,681,000.29
基金赎回款	-681,101,137.62	-248,372,175.07	-929,473,312.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	519,490,759.73	190,680,287.87	710,171,047.60
汇添富中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	272,942,319.66	109,999,622.18	382,941,941.84

加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	272,942,319.66	109,999,622.18	382,941,941.84
本期利润	21,592,174.93	-4,101,594.97	17,490,579.96
本期基金份额交易产生的变动数	-169,755,831.27	-58,527,002.03	-228,282,833.30
其中：基金申购款	139,505,906.26	50,642,987.55	190,148,893.81
基金赎回款	-309,261,737.53	-109,169,989.58	-418,431,727.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	124,778,663.32	47,371,025.18	172,149,688.50
汇添富中证 500 指数增强 Y			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	715,923.85	279,435.35	995,359.20
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	715,923.85	279,435.35	995,359.20
本期利润	292,899.25	167,514.37	460,413.62
本期基金份额交易产生的变动数	1,550,436.26	484,053.91	2,034,490.17
其中：基金申购款	1,845,093.32	591,371.94	2,436,465.26
基金赎回款	-294,657.06	-107,318.03	-401,975.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,559,259.36	931,003.63	3,490,262.99

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	295,740.08
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	51,367.07
其他	4,276.12
合计	351,383.27

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	7,738,521,083.65
减：卖出股票成本总额	7,647,886,022.29
减：交易费用	7,302,268.21
买卖股票差价收入	83,332,793.15

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	18,517.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,950.00
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	16,567.70

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	2,650,960.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,601,950.00
减：应计利息总额	50,960.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,950.00

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
外汇远期投资收益	-
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	1,427.69
外汇期货投资收益	-

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	27,840,116.93
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	27,840,116.93

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	22,298,786.88
——股票投资	22,296,890.88
——债券投资	1,896.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	22, 298, 786. 88

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	352, 742. 92
替代损益	-
其他	-
合计	352, 742. 92

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	35, 704. 06
信息披露费	59, 507. 37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	434. 00
指数使用费	-
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	-
合计	95, 645. 43

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, 基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	393,555,587.22	2.75	639,111,809.76	5.57

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	69,219.44	2.75	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	470,321.45	6.64	263,482.14	6.61

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	11,645,960.11	9,863,136.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,569,516.32	1,667,477.57
应支付基金管理人的净管理费	8,076,443.79	8,195,658.46

注：本基金各类基金份额的管理费按前一日该类基金份额的基金资产净值的年管理费率计提。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的年管理费率为 0.80%，Y 类基金份额的年管理费率为 0.40%。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times\text{年管理费率}\div\text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

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	2,911,490.11	2,465,784.07

注：本基金各类基金份额的托管费按前一日该类基金份额的基金资产净值的年托管费率计提。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的年托管费率为 0.20%，Y 类基金份额的年托管费率为 0.10%。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times\text{年托管费率}\div\text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C	汇添富中证 500 指数增强 Y	合计
中国工商银行股份有限公司	-	270,665.50	-	270,665.50
汇添富基金管理股份有限公司	-	126,121.96	-	126,121.96
合计	-	396,787.46	-	396,787.46
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 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C	汇添富中证 500 指数增强 Y	合计
中国工商银行股份有限公司	-	142,640.81	-	142,640.81
东方证券股份有限公司	-	7.76	-	7.76
汇添富基金管理股份有限公司	-	815,110.39	-	815,110.39
合计	-	957,758.96	-	957,758.96

注：本基金 A 类基金份额、Y 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 0.40%。

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 0.40%年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动

扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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	130,182,795.81	295,740.08	106,252,993.70	227,894.07

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

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
					-	-	-	-	-	
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	1,345	134,500.00	134,508.84	

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 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	130,182,795.81	-	-	-	-	-	130,182,795.81
结算备付金	10,430,953.18	-	-	-	-	-	10,430,953.18
存出保证金	820,987.85	-	-	-	-	-	820,987.85
交易性金融资产	-	-	3,363,222.92	-	-	2,029,068,223.29	2,032,431,446.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清	-	-	-	-	-	207,746,660.75	207,746,660.75

算款							
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	5,992,010.24	5,992,010.24
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	141,434,736.84	-	3,363,222.92	-	-	2,242,806,894.28	2,387,604,854.04
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	-	-	-	-	-	219,402,816.47	219,402,816.47
款							
应付							
管理人	-	-	-	-	-	1,555,002.30	1,555,002.30
报酬							
应付							
托管	-	-	-	-	-	388,750.63	388,750.63
费							
应付							
销售	-	-	-	-	-	151,831.89	151,831.89
服务费							
应付							
投资	-	-	-	-	-	-	-
顾问							

问 费							
应 交 税 费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
递 延 所 得 税 负 债	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	1,221,790.91	1,221,790.91
负 债 总 计	-	-	-	-	-	222,720,192.54	222,720,192.54
利 率 敏 感 度 缺 口	141,434,736.84	-	3,363,222.92	-	-	2,020,086,701.74	2,164,884,661.50
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	200,263,724.66	-	-	-	-	-	200,263,724.66
结算备付金	15,990,358.22	-	-	-	-	-	15,990,358.22
存出保证金	712,837.15	-	-	-	-	-	712,837.15
交易性金融资产	2,649,689.21	-	-	-	-	3,090,845,258.56	3,093,494,947.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	11,102,865.28	11,102,865.28

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	13,421,208.83	13,421,208.83
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	219,616,609.24	-	-	-	-	3,115,369,332.67	3,334,985,941.91
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	-	-	-	-	-	28,945,674.83	28,945,674.83
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	8,251,024.36	8,251,024.36
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	2,222,044.00	2,222,044.00
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	555,511.05	555,511.05
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	335,806.14	335,806.14
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	-	-	-	-	-	1,657,261.83	1,657,261.83
负债总计	-	-	-	-	-	41,967,322.21	41,967,322.21
利率敏感度缺口	219,616,609.24	-	-	-	-	3,073,402,010.46	3,293,018,619.70

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资
----	--

	产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	2,598.65	480.82
	基准利率增加 25 个基点	-2,594.43	-480.65

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,029,068,223.29	93.73	3,090,845,258.56	93.86
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	3,363,222.92	0.16	2,649,689.21	0.08
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	2,032,431,446.21	93.88	3,093,494,947.77	93.94

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%	94,309,127.57	139,166,427.56
	中证 500 指数下跌 5%	-94,309,127.57	-139,166,427.56

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	2,029,068,223.29
第二层次	3,363,222.92
第三层次	—
合计	2,032,431,446.21

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业务等情况，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	2,029,068,223.29	84.98
	其中：股票	2,029,068,223.29	84.98
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,363,222.92	0.14
	其中：债券	3,363,222.92	0.14
	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	140,613,748.99	5.89
8	其他各项资产	214,559,658.84	8.99
9	合计	2,387,604,854.04	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	8,874,166.00	0.41
B	采矿业	53,079,033.00	2.45
C	制造业	1,096,628,997.44	50.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,125,911.26	2.36
E	建筑业	7,500,643.00	0.35
F	批发和零售业	43,659,270.32	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	11,772,196.20	0.54
H	住宿和餐饮业	13,434,897.00	0.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,253,540.76	5.88
J	金融业	161,196,706.34	7.45
K	房地产业	19,548,739.84	0.90
L	租赁和商务服务业	6,699,020.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	9,424,253.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	2,692,188.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	943,164.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	32,346,919.54	1.49
S	综合	7,799,078.00	0.36
	合计	1,653,978,723.70	76.40

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	81,906.00	0.00
C	制造业	265,937,712.65	12.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,049,404.00	0.79
E	建筑业	7,525,021.00	0.35
F	批发和零售业	928,860.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	2,203,958.00	0.10

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,526,480.94	2.43
J	金融业	18,065,934.00	0.83
K	房地产业	761,851.00	0.04
L	租赁和商务服务业	4,207,574.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	1,403,208.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	1,374,959.00	0.06
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	3,022,631.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	375,089,499.59	17.33

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	300207	欣旺达	865,000	17,351,900.00	0.80
2	600487	亨通光电	1,123,100	17,183,430.00	0.79
3	601168	西部矿业	1,010,300	16,801,289.00	0.78
4	300339	润和软件	308,962	15,704,538.46	0.73
5	002410	广联达	1,142,900	15,326,289.00	0.71
6	002532	天山铝业	1,838,500	15,277,935.00	0.71
7	600497	驰宏锌锗	2,840,023	15,023,721.67	0.69
8	002202	金风科技	1,463,676	15,002,679.00	0.69
9	688122	西部超	286,534	14,865,383.92	0.69

		导			
10	300017	网宿科技	1,383,100	14,826,832.00	0.68
11	688099	晶晨半导体	208,288	14,790,530.88	0.68
12	002414	高德红外	1,410,260	14,455,165.00	0.67
13	000423	东阿阿胶	276,189	14,444,684.70	0.67
14	600352	浙江龙盛	1,408,200	14,307,312.00	0.66
15	601555	东吴证券	1,627,480	14,240,450.00	0.66
16	000738	航发控制	683,918	14,191,298.50	0.66
17	000783	长江证券	2,040,900	14,143,437.00	0.65
18	601717	郑煤机	838,897	13,942,468.14	0.64
19	000066	中国长城	934,100	13,824,680.00	0.64
20	600873	梅花生物	1,291,900	13,810,411.00	0.64
21	000060	中金岭南	3,014,700	13,807,326.00	0.64
22	002185	华天科技	1,358,700	13,722,870.00	0.63
23	002273	水晶光电	680,953	13,598,631.41	0.63
24	002152	广电运通	1,002,500	13,473,600.00	0.62
25	000050	深天马 A	1,574,100	13,411,332.00	0.62
26	600498	烽火通信	636,800	13,391,904.00	0.62
27	002223	鱼跃医疗	369,700	13,161,320.00	0.61
28	002673	西部证券	1,658,746	13,070,918.48	0.60
29	600060	海信视像	567,500	13,063,850.00	0.60
30	688249	晶合集成	641,363	13,000,428.01	0.60
31	000021	深科技	681,300	12,767,562.00	0.59

32	600959	江苏有线	3,673,340	12,636,289.60	0.58
33	600885	宏发股份	566,209	12,632,122.79	0.58
34	600096	云天化	571,100	12,547,067.00	0.58
35	601933	永辉超市	2,554,600	12,517,540.00	0.58
36	002056	横店东磁	881,800	12,477,470.00	0.58
37	300373	扬杰科技	239,500	12,430,050.00	0.57
38	002353	杰瑞股份	354,700	12,414,500.00	0.57
39	600862	中航高科	467,800	12,200,224.00	0.56
40	002064	华峰化学	1,844,700	12,193,467.00	0.56
41	601179	中国西电	1,979,500	12,154,130.00	0.56
42	601456	国联民生	1,162,400	12,030,840.00	0.56
43	300496	中科创达	210,100	12,021,922.00	0.56
44	600637	东方明珠	1,608,298	12,013,986.06	0.55
45	601098	中南传媒	913,886	11,990,184.32	0.55
46	601958	金钼股份	1,087,800	11,900,532.00	0.55
47	600663	陆家嘴	1,339,044	11,863,929.84	0.55
48	601991	大唐发电	3,657,000	11,592,690.00	0.54
49	002500	山西证券	1,974,600	11,531,664.00	0.53
50	600298	安琪酵母	326,476	11,482,160.92	0.53
51	000027	深圳能源	1,770,255	11,294,226.90	0.52
52	300595	欧普康视	727,683	11,111,719.41	0.51
53	601665	齐鲁银行	1,736,200	10,972,784.00	0.51
54	600380	健康元	992,586	10,948,223.58	0.51

55	600535	天士力	693,600	10,854,840.00	0.50
56	000009	中国宝安	1,209,700	10,742,136.00	0.50
57	000933	神火股份	642,800	10,696,192.00	0.49
58	600582	天地科技	1,769,360	10,598,466.40	0.49
59	601568	北元集团	2,542,561	10,551,628.15	0.49
60	300285	国瓷材料	602,693	10,456,723.55	0.48
61	601231	环旭电子	698,800	10,223,444.00	0.47
62	600299	安迪苏	1,047,328	10,106,715.20	0.47
63	002430	杭氧股份	512,900	9,960,518.00	0.46
64	000636	风华高科	724,123	9,949,450.02	0.46
65	003022	联泓新科	622,800	9,858,924.00	0.46
66	600079	人福医药	466,700	9,791,366.00	0.45
67	600704	物产中大	1,810,000	9,538,700.00	0.44
68	600879	航天电子	865,100	9,057,597.00	0.42
69	300346	南大光电	283,400	8,966,776.00	0.41
70	000825	太钢不锈	2,486,300	8,925,817.00	0.41
71	300677	英科医疗	370,139	8,764,891.52	0.40
72	002444	巨星科技	343,100	8,752,481.00	0.40
73	601928	凤凰传媒	773,866	8,644,083.22	0.40
74	688188	上海柏楚电子科技	65,533	8,628,074.78	0.40
75	300919	中伟股份	259,700	8,538,936.00	0.39
76	002138	顺络电子	296,000	8,323,520.00	0.38

77	002841	视源股份	240,300	8,314,380.00	0.38
78	002507	涪陵榨菜	642,213	8,213,904.27	0.38
79	603893	瑞芯微	54,000	8,200,440.00	0.38
80	000987	越秀资本	1,174,800	8,059,128.00	0.37
81	601965	中国汽研	453,400	8,047,850.00	0.37
82	000887	中鼎股份	451,300	7,938,367.00	0.37
83	600062	华润双鹤	425,200	7,934,232.00	0.37
84	300476	胜宏科技	58,800	7,901,544.00	0.36
85	000959	首钢股份	2,312,000	7,860,800.00	0.36
86	603658	安图生物	209,433	7,853,737.50	0.36
87	002299	圣农发展	546,700	7,812,343.00	0.36
88	600673	东阳光	670,600	7,799,078.00	0.36
89	300395	菲利华	152,000	7,767,200.00	0.36
90	002078	太阳纸业	570,000	7,672,200.00	0.35
91	600271	航天信息	828,600	7,656,264.00	0.35
92	000932	华菱钢铁	1,739,900	7,655,560.00	0.35
93	000729	燕京啤酒	575,000	7,434,750.00	0.34
94	601019	山东出版	766,100	7,254,967.00	0.34
95	600258	首旅酒店	510,900	7,219,017.00	0.33
96	600038	中直股份	185,100	7,183,731.00	0.33
97	600118	中国卫星	251,200	7,176,784.00	0.33
98	000728	国元证券	909,400	7,175,166.00	0.33
99	000034	神州数码	190,600	7,174,184.00	0.33

100	300888	稳健医疗	172,520	7,090,572.00	0.33
101	600517	国网英大	1,386,600	7,071,660.00	0.33
102	000739	普洛药业	501,500	7,021,000.00	0.32
103	002850	科达利	60,800	6,880,736.00	0.32
104	688819	天能电池集团股份	242,714	6,737,740.64	0.31
105	600153	建发股份	646,000	6,699,020.00	0.31
106	600765	中航重机	390,739	6,595,674.32	0.30
107	688469	芯联集成	1,374,752	6,557,567.04	0.30
108	600998	九州通	1,259,038	6,471,455.32	0.30
109	600598	北大荒	441,500	6,366,430.00	0.29
110	600109	国金证券	722,748	6,338,499.96	0.29
111	002423	中粮资本	517,200	6,325,356.00	0.29
112	300458	全志科技	158,030	6,272,210.70	0.29
113	002065	东华软件	651,400	6,253,440.00	0.29
114	603596	伯特利	118,200	6,227,958.00	0.29
115	600754	锦江酒店	277,000	6,215,880.00	0.29
116	600369	西南证券	1,410,200	6,134,370.00	0.28
117	002939	长城证券	730,300	6,119,914.00	0.28
118	600143	金发科技	593,200	6,115,892.00	0.28
119	002340	格林美	953,700	6,055,995.00	0.28
120	300054	鼎龙股份	209,600	6,011,328.00	0.28
121	000528	柳工	620,500	5,963,005.00	0.28
122	002155	湖南黄金	310,400	5,540,640.00	0.26
123	000960	锡业股份	352,600	5,394,780.00	0.25

124	605358	立昂微	229,339	5,343,598.70	0.25
125	300037	新宙邦	143,580	5,054,016.00	0.23
126	300529	健帆生物	232,300	5,010,711.00	0.23
127	002294	信立泰	105,600	4,998,048.00	0.23
128	601233	桐昆股份	471,000	4,992,600.00	0.23
129	300001	特锐德	207,713	4,978,880.61	0.23
130	603529	爱玛科技	143,900	4,950,160.00	0.23
131	600968	海油发展	1,208,100	4,929,048.00	0.23
132	000598	兴蓉环境	681,714	4,915,157.94	0.23
133	002595	豪迈科技	79,000	4,678,380.00	0.22
134	000683	博源化工	947,200	4,537,088.00	0.21
135	002436	兴森科技	341,800	4,525,432.00	0.21
136	000039	中集集团	563,400	4,428,324.00	0.20
137	603298	杭叉集团	208,827	4,374,925.65	0.20
138	600995	南网储能	437,900	4,282,662.00	0.20
139	300803	指南针	52,740	4,254,008.40	0.20
140	601696	中银证券	393,600	4,207,584.00	0.19
141	600312	平高电气	270,900	4,169,151.00	0.19
142	600529	山东药玻	185,300	4,102,542.00	0.19
143	600563	法拉电子	36,700	4,003,603.00	0.18
144	603345	安井食品	49,000	3,940,580.00	0.18
145	300699	光威复材	124,300	3,936,581.00	0.18
146	601615	明阳智能	336,123	3,862,053.27	0.18
147	600685	中船防务	141,500	3,847,385.00	0.18

148	002773	康弘药业	132,166	3,828,849.02	0.18
149	002085	万丰奥威	239,300	3,802,477.00	0.18
150	600848	上海临港	413,600	3,751,352.00	0.17
151	600839	四川长虹	383,900	3,731,508.00	0.17
152	688072	拓荆科技	24,266	3,729,926.86	0.17
153	300604	长川科技	82,900	3,723,039.00	0.17
154	600988	赤峰黄金	149,200	3,712,096.00	0.17
155	000513	丽珠集团	101,500	3,658,060.00	0.17
156	600398	海澜之家	515,300	3,586,488.00	0.17
157	000988	华工科技	76,000	3,572,760.00	0.17
158	002926	华西证券	398,600	3,563,484.00	0.16
159	601598	中国外运	716,500	3,532,345.00	0.16
160	688220	翱捷科技	45,000	3,523,500.00	0.16
161	603786	科博达	62,700	3,474,207.00	0.16
162	600707	彩虹股份	531,300	3,432,198.00	0.16
163	600348	华阳股份	504,900	3,362,634.00	0.16
164	688278	特宝生物	46,587	3,359,388.57	0.16
165	600578	京能电力	730,146	3,278,355.54	0.15
166	688425	铁建重工	798,239	3,256,815.12	0.15
167	000709	河钢股份	1,489,900	3,218,184.00	0.15
168	600021	上海电力	364,900	3,207,471.00	0.15
169	001286	陕西能源	367,500	3,197,250.00	0.15

170	002739	万达电影	279,100	3,190,113.00	0.15
171	300140	节能环保	508,700	3,138,679.00	0.14
172	603156	养元饮品	147,600	3,123,216.00	0.14
173	600098	广州发展	499,400	3,121,250.00	0.14
174	001696	宗申动力	138,500	3,109,325.00	0.14
175	000921	海信家电	120,900	3,107,130.00	0.14
176	603228	景旺电子	74,200	3,104,528.00	0.14
177	601000	唐山港	763,720	3,100,703.20	0.14
178	688387	中信科移动	547,429	3,092,973.85	0.14
179	600511	国药股份	105,000	3,061,800.00	0.14
180	002203	海亮股份	295,600	3,050,592.00	0.14
181	002472	双环传动	90,700	3,037,543.00	0.14
182	600739	辽宁成大	275,500	3,030,500.00	0.14
183	600583	海油工程	546,300	2,982,798.00	0.14
184	000830	鲁西化工	285,900	2,944,770.00	0.14
185	600820	隧道股份	477,750	2,914,275.00	0.13
186	600282	南钢股份	688,200	2,890,440.00	0.13
187	600132	重庆啤酒	51,600	2,843,160.00	0.13
188	002409	雅克科技	51,900	2,838,411.00	0.13
189	000559	万向钱潮	368,800	2,821,320.00	0.13
190	600906	财达证券	409,500	2,792,790.00	0.13
191	002429	兆驰股份	637,000	2,790,060.00	0.13

192	688114	华大智造	42,395	2,748,467.85	0.13
193	002008	大族激光	112,500	2,741,625.00	0.13
194	688052	纳芯微电子	15,500	2,704,595.00	0.12
195	603568	伟明环保	141,100	2,692,188.00	0.12
196	688772	珠海冠宇电池	186,124	2,659,711.96	0.12
197	603160	汇顶科技	37,200	2,642,316.00	0.12
198	600528	中铁工业	356,400	2,630,232.00	0.12
199	600699	均胜电子	148,600	2,591,584.00	0.12
200	000032	深桑达 A	127,000	2,569,210.00	0.12
201	002831	裕同科技	109,400	2,562,148.00	0.12
202	002080	中材科技	130,900	2,552,550.00	0.12
203	601118	海南橡胶	531,300	2,507,736.00	0.12
204	600141	兴发集团	120,647	2,476,882.91	0.11
205	300735	光弘科技	98,600	2,474,860.00	0.11
206	000898	鞍钢股份	1,063,500	2,467,320.00	0.11
207	002958	青农商行	680,800	2,457,688.00	0.11
208	603225	新凤鸣	225,000	2,396,250.00	0.11
209	688235	百济神州	10,074	2,353,689.36	0.11
210	002966	苏州银行	263,700	2,315,286.00	0.11
211	600316	洪都航空	61,100	2,303,470.00	0.11
212	301498	乖宝宠物	20,700	2,263,959.00	0.10
213	601108	财通证券	283,800	2,244,858.00	0.10

214	601608	中信重工	509,800	2,227,826.00	0.10
215	603565	中谷物流	228,200	2,179,310.00	0.10
216	002385	大北农	535,292	2,162,579.68	0.10
217	688475	萤石网络	68,319	2,153,414.88	0.10
218	688027	科大国盾量子	7,805	2,146,453.05	0.10
219	600483	福能股份	220,542	2,126,024.88	0.10
220	600970	中材国际	235,100	2,017,158.00	0.09
221	000878	云南铜业	158,300	2,013,576.00	0.09
222	601577	长沙银行	187,925	1,867,974.50	0.09
223	002508	老板电器	96,100	1,826,861.00	0.08
224	600007	中国国贸	88,200	1,815,156.00	0.08
225	603556	海兴电力	69,400	1,767,618.00	0.08
226	000155	川能动力	177,600	1,744,032.00	0.08
227	002372	伟星新材	167,521	1,735,517.56	0.08
228	603338	浙江鼎力	36,500	1,730,100.00	0.08
229	601990	南京证券	212,900	1,720,232.00	0.08
230	688617	惠泰医疗	5,761	1,711,017.00	0.08
231	002120	韵达股份	253,300	1,697,110.00	0.08
232	301358	湖南裕能	52,000	1,621,880.00	0.07
233	688563	航空材料股份	27,831	1,576,069.53	0.07
234	603659	璞泰来	83,600	1,570,008.00	0.07
235	603707	健友股份	135,400	1,509,710.00	0.07
236	601666	平煤股	199,200	1,476,072.00	0.07

		份			
237	601216	君正集团	266,900	1,473,288.00	0.07
238	688608	恒玄科技	4,200	1,461,516.00	0.07
239	603939	益丰药房	59,300	1,451,071.00	0.07
240	688728	格科微有限公司	91,647	1,411,363.80	0.07
241	688582	芯动联科	20,800	1,397,760.00	0.06
242	300573	兴齐眼药	26,720	1,383,828.80	0.06
243	300136	信维通信	60,400	1,352,960.00	0.06
244	600901	江苏金租	207,200	1,255,632.00	0.06
245	002608	江苏国信	168,700	1,236,571.00	0.06
246	000937	冀中能源	211,000	1,213,250.00	0.06
247	688702	盛科通信	19,222	1,174,079.76	0.05
248	000733	振华科技	23,400	1,171,170.00	0.05
249	300623	捷捷微电	39,000	1,162,200.00	0.05
250	600032	浙江新能	149,500	1,130,220.00	0.05
251	600801	华新水泥	93,800	1,110,592.00	0.05
252	300012	华测检测	93,900	1,097,691.00	0.05
253	600895	张江高科	41,100	1,056,270.00	0.05
254	600131	国网信通	58,300	1,031,910.00	0.05
255	601212	白银有色	325,218	1,017,932.34	0.05
256	688213	思特威电子科技	9,851	1,006,969.22	0.05
257	300144	宋城演	113,300	968,715.00	0.04

		艺			
258	301267	华夏眼科	49,200	943,164.00	0.04
259	002025	航天电器	18,100	930,521.00	0.04
260	603650	彤程新材	26,900	864,835.00	0.04
261	600925	苏能股份	163,600	855,628.00	0.04
262	688385	复旦微电	16,837	829,558.99	0.04
263	688002	睿创微纳	11,338	790,485.36	0.04
264	002603	以岭药业	52,700	743,070.00	0.03
265	688065	凯赛生物	15,474	728,825.40	0.03
266	603885	吉祥航空	53,300	717,951.00	0.03
267	002653	海思科	15,000	633,300.00	0.03
268	300383	光环新网	44,100	630,630.00	0.03
269	600909	华安证券	96,200	560,846.00	0.03
270	600208	衢州发展	180,400	533,984.00	0.02
271	601155	新城控股	38,600	528,048.00	0.02
272	603000	人民网	24,100	487,061.00	0.02
273	002572	索菲亚	32,200	451,122.00	0.02
274	603816	顾家家居	16,600	423,632.00	0.02
275	603233	大参林	25,400	414,020.00	0.02
276	688180	君实生物	12,047	409,357.06	0.02
277	300724	捷佳伟创	7,500	407,250.00	0.02
278	688100	威胜信息	10,378	384,504.90	0.02
279	600536	中国软件	7,700	360,129.00	0.02
280	600177	雅戈尔	49,300	359,890.00	0.02
281	600004	白云机	34,700	315,770.00	0.01

		场			
282	600985	淮北矿业	26,900	305,046.00	0.01
283	688172	燕东微电子股份	15,300	300,798.00	0.01
284	600373	中文传媒	29,100	298,857.00	0.01
285	300676	华大基因	5,600	278,712.00	0.01
286	003031	中瓷电子	4,800	255,408.00	0.01
287	601228	广州港	70,900	229,007.00	0.01
288	300223	北京君正	2,000	138,400.00	0.01
289	600872	中炬高新	20	380.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	300303	聚飞光电	1,296,700	8,221,078.00	0.38
2	002454	松芝股份	1,017,200	7,852,784.00	0.36
3	300160	秀强股份	1,390,900	7,816,858.00	0.36
4	002367	康力电梯	1,107,462	7,785,457.86	0.36
5	002479	富春环保	1,548,600	7,758,486.00	0.36
6	000166	申万宏源	1,529,900	7,680,098.00	0.35
7	002331	皖通科技	915,800	7,372,190.00	0.34
8	000156	华数传媒	924,101	7,337,361.94	0.34
9	002228	合兴包装	2,011,800	7,101,654.00	0.33

10	688256	寒武纪科技	11,560	6,953,340.00	0.32
11	002863	今飞凯达	1,368,400	6,937,788.00	0.32
12	002160	常铝股份	1,593,700	6,884,784.00	0.32
13	601728	中国电信	876,200	6,790,550.00	0.31
14	300079	数码视讯	1,120,800	6,556,680.00	0.30
15	300686	智动力	653,300	6,526,467.00	0.30
16	603387	基蛋生物	818,542	6,507,408.90	0.30
17	300800	力合科技	565,400	6,270,286.00	0.29
18	300369	绿盟科技	805,800	6,261,066.00	0.29
19	300150	世纪瑞尔	1,244,600	6,247,892.00	0.29
20	300232	洲明科技	861,200	6,235,088.00	0.29
21	300241	瑞丰光电	1,046,700	5,966,190.00	0.28
22	603987	康德莱	767,100	5,906,670.00	0.27
23	002912	中新赛克	245,700	5,859,945.00	0.27
24	002483	润邦股份	921,400	5,758,750.00	0.27
25	300319	麦捷科技	520,600	5,591,244.00	0.26
26	002375	亚厦股份	1,375,200	5,294,520.00	0.24
27	600031	三一重工	265,600	4,767,520.00	0.22
28	600703	三安光电	382,500	4,750,650.00	0.22
29	600488	津药药业	1,135,400	4,734,618.00	0.22
30	300259	新天科技	1,286,500	4,567,075.00	0.21
31	002282	博深股份	597,900	4,466,313.00	0.21
32	000404	长虹华	626,400	4,447,440.00	0.21

		意			
33	300335	迪森股份	793,900	4,334,694.00	0.20
34	002516	旷达科技	837,200	4,311,580.00	0.20
35	601658	邮储银行	769,400	4,208,618.00	0.19
36	600662	外服控股	823,400	4,207,574.00	0.19
37	002950	奥美医疗	488,300	4,199,380.00	0.19
38	600237	铜峰电子	577,800	4,189,050.00	0.19
39	603601	再升科技	1,015,400	4,122,524.00	0.19
40	002249	大洋电机	625,451	4,115,467.58	0.19
41	002736	国信证券	353,200	4,068,864.00	0.19
42	603408	建霖家居	363,200	3,984,304.00	0.18
43	000153	丰原药业	645,203	3,980,902.51	0.18
44	002328	新朋股份	676,900	3,939,558.00	0.18
45	600019	宝钢股份	582,900	3,841,311.00	0.18
46	002209	达意隆	301,100	3,778,805.00	0.17
47	002303	美盈森	966,600	3,441,096.00	0.16
48	002782	可立克	243,700	3,163,226.00	0.15
49	002578	闽发铝业	931,300	3,119,855.00	0.14
50	601126	四方股份	190,800	3,104,316.00	0.14
51	300193	佳士科技	337,100	3,050,755.00	0.14
52	300509	新美星	354,900	3,037,944.00	0.14
53	300978	东箭科技	270,200	3,015,432.00	0.14
54	002540	亚太科技	493,051	2,874,487.33	0.13
55	688586	江航飞	251,939	2,834,313.75	0.13

		机装备			
56	301028	东亚机械	221,500	2,722,235.00	0.13
57	601600	中国铝业	355,100	2,499,904.00	0.12
58	603886	元祖股份	175,100	2,288,557.00	0.11
59	000862	银星能源	411,600	2,251,452.00	0.10
60	601800	中国交建	250,900	2,230,501.00	0.10
61	000551	创元科技	162,800	2,091,980.00	0.10
62	002330	得利斯	444,700	2,036,726.00	0.09
63	002382	蓝帆医疗	348,300	1,950,480.00	0.09
64	601811	新华文轩	132,900	1,936,353.00	0.09
65	300155	安居宝	382,200	1,918,644.00	0.09
66	300239	东宝生物	321,100	1,904,123.00	0.09
67	000586	汇源通信	171,100	1,902,632.00	0.09
68	603861	白云电器	191,500	1,890,105.00	0.09
69	603115	海星股份	130,300	1,880,229.00	0.09
70	300939	秋田微	61,700	1,875,680.00	0.09
71	000063	中兴通讯	57,400	1,864,926.00	0.09
72	300658	延江股份	274,700	1,777,309.00	0.08
73	002662	峰璟股份	498,900	1,706,238.00	0.08
74	600742	富维股份	176,500	1,678,515.00	0.08
75	000895	双汇发展	65,600	1,601,296.00	0.07
76	600269	赣粤高速	299,800	1,516,988.00	0.07
77	600027	华电国际	274,400	1,500,968.00	0.07
78	002252	上海莱	218,200	1,499,034.00	0.07

		士			
79	603609	禾丰股份	180,200	1,488,452.00	0.07
80	603339	四方科技	119,300	1,431,600.00	0.07
81	300560	中富通	102,700	1,387,477.00	0.06
82	000978	桂林旅游	224,300	1,374,959.00	0.06
83	002802	洪汇新材	93,728	1,311,254.72	0.06
84	300447	全信股份	83,100	1,302,177.00	0.06
85	601989	中国重工	268,500	1,245,840.00	0.06
86	601766	中国中车	176,100	1,239,744.00	0.06
87	300420	五洋自控	357,800	1,230,832.00	0.06
88	002363	隆基机械	160,600	1,222,166.00	0.06
89	600011	华能国际	168,600	1,203,804.00	0.06
90	002625	光启技术	29,600	1,183,408.00	0.05
91	603528	多伦科技	139,000	1,159,260.00	0.05
92	603926	铁流股份	100,600	1,142,816.00	0.05
93	601818	光大银行	261,500	1,085,225.00	0.05
94	688128	中国电器研究院	43,782	1,072,659.00	0.05
95	002661	克明食品	107,000	1,071,070.00	0.05
96	000768	中航西飞	37,000	1,011,580.00	0.05
97	600718	东软集团	102,400	998,400.00	0.05
98	600519	贵州茅台	700	986,664.00	0.05
99	000626	远大控股	137,000	928,860.00	0.04

100	002745	木林森	117,000	921,960.00	0.04
101	002075	沙钢股份	152,000	884,640.00	0.04
102	601288	农业银行	143,700	844,956.00	0.04
103	300025	华星创业	112,500	780,750.00	0.04
104	002815	崇达技术	65,100	737,583.00	0.03
105	002787	华源控股	89,900	734,483.00	0.03
106	300599	雄塑科技	85,300	733,580.00	0.03
107	300292	吴通控股	148,500	723,195.00	0.03
108	000557	西部创业	134,700	686,970.00	0.03
109	605567	春雪食品	64,700	661,881.00	0.03
110	300732	设研院	89,400	645,468.00	0.03
111	600616	金枫酒业	100,400	568,264.00	0.03
112	002022	科华生物	89,500	549,530.00	0.03
113	002885	京泉华	38,600	546,190.00	0.03
114	688334	西高院	30,500	523,990.00	0.02
115	600626	申达股份	139,800	507,474.00	0.02
116	603230	内蒙新华	36,000	464,760.00	0.02
117	000720	新能泰山	121,100	422,639.00	0.02
118	600268	国电南自	52,200	408,204.00	0.02
119	601002	晋亿实业	80,600	397,358.00	0.02
120	600936	广西广电	102,600	388,854.00	0.02
121	002817	黄山胶囊	52,200	385,236.00	0.02
122	002107	沃华医药	61,100	349,492.00	0.02
123	002498	汉缆股	101,000	341,380.00	0.02

		份			
124	002016	世荣兆业	61,900	339,212.00	0.02
125	000719	中原传媒	26,200	325,142.00	0.02
126	601999	出版传媒	42,400	296,376.00	0.01
127	688432	有研硅	24,155	266,671.20	0.01
128	002322	理工能科	22,000	266,200.00	0.01
129	300639	凯普生物	45,833	265,831.40	0.01
130	002825	纳尔股份	26,500	264,470.00	0.01
131	600594	益佰制药	63,300	243,705.00	0.01
132	003008	开普检测	11,000	233,750.00	0.01
133	002796	世嘉科技	14,950	176,410.00	0.01
134	300866	安克创新	1,400	159,040.00	0.01
135	601319	中国人保	10,700	93,197.00	0.00
136	600061	国投资本	11,300	84,976.00	0.00
137	600758	辽宁能源	21,900	81,906.00	0.00
138	000553	安道麦A	4,000	28,880.00	0.00
139	300911	亿田智能	393	16,686.78	0.00
140	300717	华信新材	50	906.50	0.00
141	002664	信质集团	49	905.03	0.00
142	600081	东风科技	50	654.50	0.00
143	605005	合兴股份	17	310.59	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	300476	胜宏科技	50,155,699.00	1.52
2	002384	东山精密	44,425,063.00	1.35
3	600487	亨通光电	42,371,537.15	1.29
4	300339	润和软件	39,386,021.92	1.20
5	600418	江淮汽车	39,003,770.00	1.18
6	300803	指南针	38,604,747.15	1.17
7	600529	山东药玻	34,363,547.81	1.04
8	300136	信维通信	33,910,195.00	1.03
9	603893	瑞芯微	32,403,450.80	0.98
10	600498	烽火通信	32,182,803.00	0.98
11	300017	网宿科技	32,169,126.56	0.98
12	688099	晶晨半导体	30,391,955.26	0.92
13	002410	广联达	30,219,357.00	0.92
14	002797	第一创业	30,186,410.00	0.92
15	300866	安克创新	30,095,609.30	0.91
16	603596	伯特利	29,210,247.00	0.89
17	300604	长川科技	29,173,711.00	0.89
18	002065	东华软件	28,943,733.00	0.88
19	600879	航天电子	28,438,088.00	0.86
20	002444	巨星科技	28,160,846.00	0.86

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	65,393,010.00	1.99
2	300476	胜宏科技	64,423,255.52	1.96
3	002625	光启技术	48,677,151.00	1.48
4	300866	安克创新	47,075,679.54	1.43
5	300339	润和软件	46,298,494.27	1.41
6	002384	东山精密	45,732,866.00	1.39
7	002156	通富微电	42,784,991.00	1.30
8	002558	巨人网络	40,199,763.50	1.22
9	002340	格林美	39,777,406.00	1.21

10	002273	水晶光电	36,424,367.80	1.11
11	002465	海格通信	36,059,845.00	1.10
12	600487	亨通光电	34,095,868.34	1.04
13	300136	信维通信	33,791,855.53	1.03
14	300803	指南针	33,501,188.70	1.02
15	600529	山东药玻	33,369,336.00	1.01
16	002138	顺络电子	33,192,496.00	1.01
17	002078	太阳纸业	33,023,663.00	1.00
18	002595	豪迈科技	31,648,710.25	0.96
19	002410	广联达	30,550,985.00	0.93
20	002409	雅克科技	30,529,713.00	0.93

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	6,563,812,096.14
卖出股票收入（成交）总额	7,738,521,083.65

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,228,714.08	0.15
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）	134,508.84	0.01
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	3,363,222.92	0.16

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	32,000	3,228,714.08	0.15
2	123257	安克转 债	1,345	134,508.84	0.01

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

<p>本基金按照风险管理的原则，以套期保值为目的，参与股指期货交易。</p> <p>本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。</p> <p>基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，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；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>基金管理人将在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度，并经基金管理人董事会批准后执行。</p> <p>若相关法律法规发生变化时，基金管理人股指期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>

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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	820,987.85
2	应收清算款	207,746,660.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,992,010.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	214,559,658.84

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：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 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	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

		额	持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
汇添 富中 证 500 指数 增强 A	139,691	7,300.19	254,695,425.90	24.98	765,075,147.96	75.02
汇添 富中 证 500 指数 增强 C	30,507	8,336.65	52,878,965.47	20.79	201,447,273.79	79.21
汇添 富中 证 500 指数 增强 Y	1,680	2,962.41	0.00	0.00	4,976,849.29	100.00
合计	171,878	7,441.75	307,574,391.37	24.05	971,499,271.04	75.95

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 （%）
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	汇添富中证 500 指数增强 A	633,753.79	0.06
	汇添富中证 500 指数增强 C	158,430.56	0.06
	汇添富中证 500 指数增强 Y	218,491.12	4.39
	合计	1,010,675.47	0.08

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金	汇添富中证 500 指数增强	10~50

投资和研究部门负责人持有 本开放式基金	A	
	汇添富中证 500 指数增强 C	0
	汇添富中证 500 指数增强 Y	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放 式基金	汇添富中证 500 指数增强 A	10~50
	汇添富中证 500 指数增强 C	0
	汇添富中证 500 指数增强 Y	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数增 强 A	汇添富中证 500 指数 增强 C	汇添富中证 500 指 数增强 Y
基金合同生 效日（2023 年 04 月 25 日）基金份 额总额	1, 515, 240, 799. 06	484, 457, 922. 62	—
本报告期期 初基金份额 总额	1, 402, 936, 087. 41	629, 549, 825. 66	1, 594, 438. 65
本报告期基 金总申购份 额	1, 058, 025, 323. 60	311, 606, 519. 33	4, 005, 353. 01
减：本报告 期基金总赎 回份额	1, 441, 190, 837. 15	686, 830, 105. 73	622, 942. 37
本报告期基 金拆分变动 份额	—	—	—
本报告期期 末基金份额 总额	1, 019, 770, 573. 86	254, 326, 239. 26	4, 976, 849. 29

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	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
----	----	------	-----------	----

名称	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
光大证券	1	3,795,605,529.12	26.54	667,596.04	26.54	
国信证券	2	2,584,325,161.50	18.07	454,586.61	18.07	
银河证券	5	2,546,469,277.91	17.80	447,923.68	17.81	
国泰海通	4	1,893,140,036.71	13.24	333,009.10	13.24	
招商证券	4	1,227,704,791.55	8.58	215,952.16	8.58	
广发证券	1	712,622,188.22	4.98	125,338.04	4.98	
中金公司	2	565,902,037.67	3.96	99,541.97	3.96	
东方证券	4	393,555,587.22	2.75	69,219.44	2.75	
兴业证券	2	217,324,723.35	1.52	38,229.68	1.52	
中信建投证券	1	199,441,151.84	1.39	35,074.25	1.39	
华泰证券	2	166,242,694.70	1.16	29,237.55	1.16	
长江证券	1	-	-	-	-	
东吴证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	
高盛中国	1	-	-	-	-	
国都证券	1	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国投证券	2	-	-	-	-	
国新	2	-	-	-	-	

证券						
华鑫 证券	3	-	-	-	-	
上海 证券	1	-	-	-	-	
申万 宏源 证券	1	-	-	-	-	
西南 证券	1	-	-	-	-	
中金 财富	1	-	-	-	-	
中泰 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 (%)
光大 证券	3,197,654.00	100.00	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 海通	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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:招商证券(上交所单元,深交所单元)、银河证券(深交所单元,上交所单元);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旗下基金 2024 年第四季度报告	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报	2025 年 01 月 22 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 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
3	汇添富基金管理股份有限公司旗	公司网站, 中国证监	2025 年 03 月 31 日

	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）	会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 上证报	
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 04 月 18 日
5	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	深交所, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 18 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 22 日
7	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 16 日
8	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行（中国）有限公司合作关系的公告	上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 指数增强型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 500 指数增强型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