

汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	19
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	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	22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	23
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	24
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	24
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	24
§ 5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	24
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	25
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	25
§ 6 审计报告	25
6.1 审计报告的基本信息	25
6.2 审计报告的基本内容	25
§ 7 年度财务报表	27
7.1 资产负债表	27
7.2 利润表	28
7.3 净资产变动表	29
7.4 报表附注	31
§ 8 投资组合报告	67
8.1 期末基金资产组合情况	68
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	68
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	69

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	89
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	102
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	102
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	102
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	102
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	102
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	102
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	102
8.12 投资组合报告附注.....	102
§ 9 基金份额持有人信息.....	103
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	103
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	104
9.3 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.....	104
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	104
§ 10 开放式基金份额变动	105
§ 11 重大事件揭示	105
11.1 基金份额持有人大会决议.....	105
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	105
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	106
11.4 基金投资策略的改变.....	106
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	106
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	106
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	107
11.8 其他重大事件	112
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	113
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	113
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	114
§ 13 备查文件目录	114
13.1 备查文件目录	114
13.2 存放地点	115
13.3 查阅方式	115

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富中证 1000 指数增强	
基金主代码	017953	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 05 月 19 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	766,709,448.42	
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 1000 指数增强 A	汇添富中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017953	017954
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	369,885,298.77	396,824,149.65

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，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 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 8.00%，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。</p> <p>股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证的投资策略、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、融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略和国债期货投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	<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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	021-60637228
传真	021-28932998	021-60635778
注册地址	上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200010	100033
法定代表人	鲁伟铭	张金良

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1 .1 期间 数据 和 指标	2025 年		2024 年		2023 年 05 月 19 日（基金 合同生效日）-2023 年 12 月 31 日	
	汇添富中证 1000 指数 增强 A	汇添富中证 1000 指数 增强 C	汇添富中证 1000 指数 增强 A	汇添富中 证 1000 指 数增强 C	汇添富中证 1000 指数 增强 A	汇添富中证 1000 指数 增强 C
本期 已 实 现 收 益	114,795,69 7.25	87,676,058 .95	- 62,895,030 .93	- 38,894,13 1.07	7,498,741. 13	1,461,021. 07
本期 利 润	118,666,12 9.54	93,118,905 .16	- 23,983,442 .77	- 64,635,18 3.94	- 2,723,588. 03	- 2,407,187. 88
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.4847	0.5136	-0.0980	-0.5447	-0.0104	-0.0265
本 期 加 权 平 均 净 值	36.76%	38.09%	-10.86%	-60.21%	-1.03%	-2.64%

利润率						
本期基金份额净值增长率	47.14%	46.79%	4.21%	3.94%	0.74%	0.58%
3.1 .2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	141,641,967.57	148,137,335.07	-11,331,512.45	-5,472,183.65	3,188,098.88	1,712,806.87
期末可供分配基金份额利润	0.3829	0.3733	-0.0667	-0.0707	0.0074	0.0058
期	571,376,78	608,908,19	178,324,38	80,953,99	433,740,79	298,688,97

末基金资产净值	1.69	9.96	7.62	9.58	1.08	0.72
期末基金份额净值	1.5447	1.5345	1.0498	1.0454	1.0074	1.0058
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	54.47%	53.45%	4.98%	4.54%	0.74%	0.58%

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

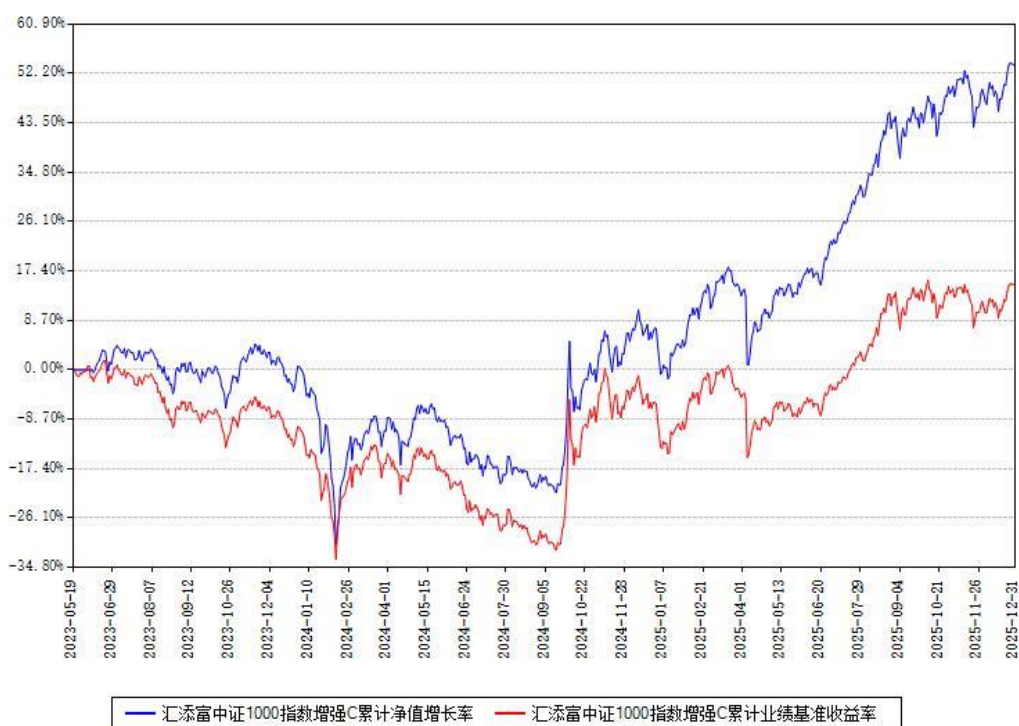
汇添富中证 1000 指数增强 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.82%	1.09%	0.28%	1.07%	4.54%	0.02%
过去六个月	25.92%	1.03%	18.49%	1.06%	7.43%	-0.03%
过去一年	47.14%	1.27%	26.12%	1.32%	21.02%	-0.05%
自基金合同生效起至今	54.47%	1.53%	15.06%	1.55%	39.41%	-0.02%
汇添富中证 1000 指数增强 C						
阶段	份额净值增长率①	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
过去三个月	4.77%	1.09%	0.28%	1.07%	4.49%	0.02%
过去六个月	25.78%	1.03%	18.49%	1.06%	7.29%	-0.03%
过去一年	46.79%	1.27%	26.12%	1.32%	20.67%	-0.05%
自基金合同生效起至今	53.45%	1.53%	15.06%	1.55%	38.39%	-0.02%

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1000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1000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

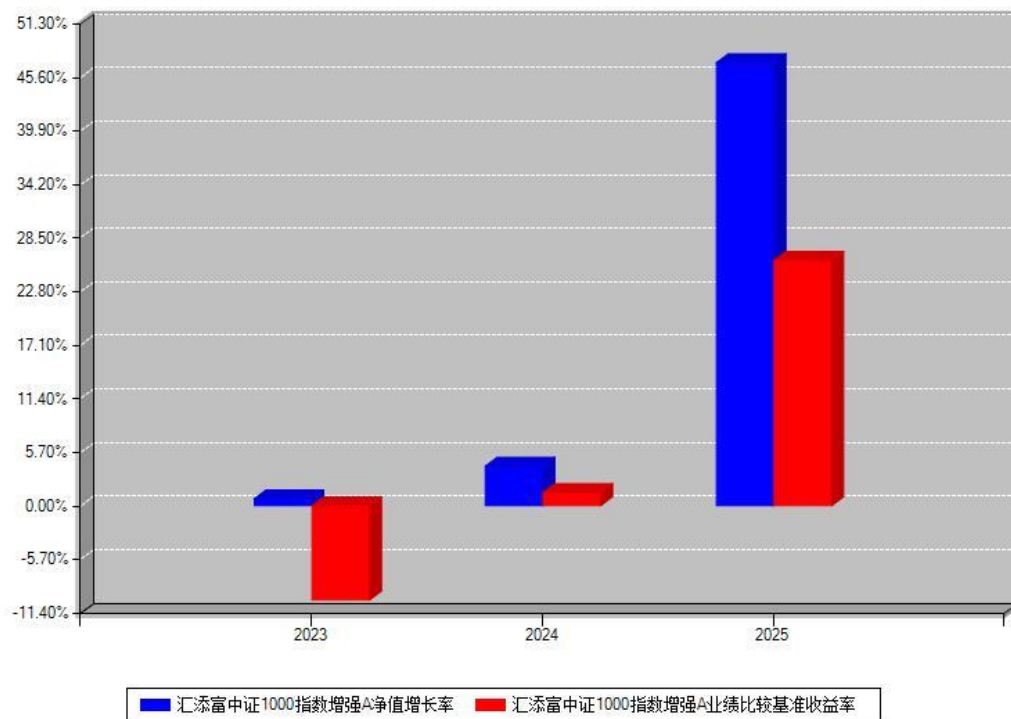


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023年05月19日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

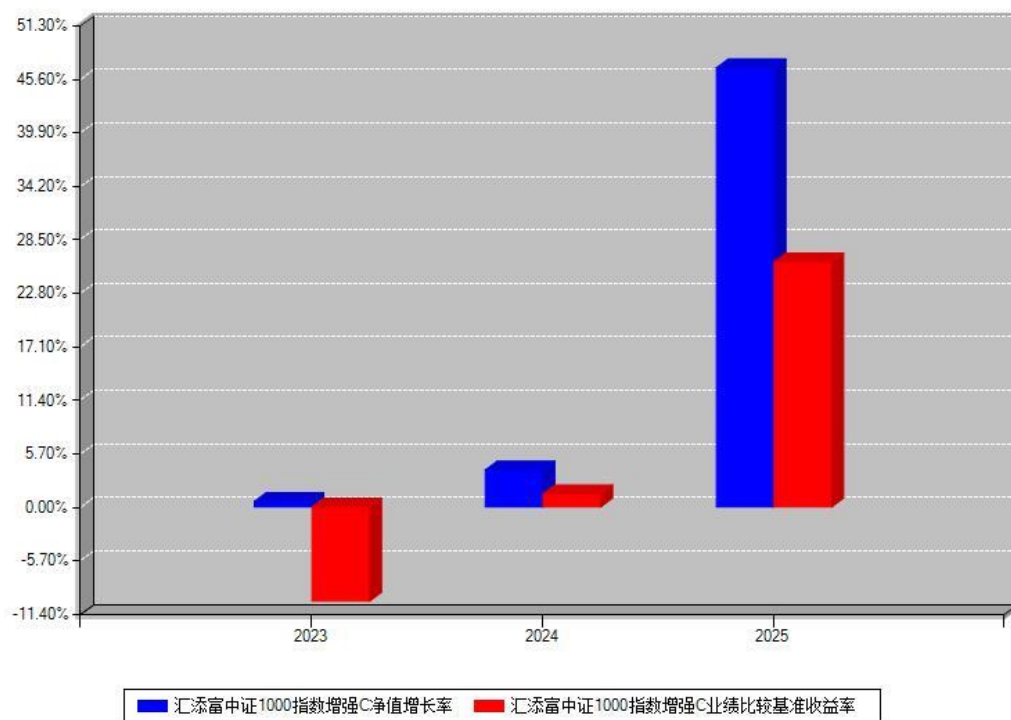
本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

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

汇添富中证1000指数增强A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证1000指数增强C每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 05 月 19 日，合同生效当年按实际存续期计算，不

按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 05 月 19 日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

2025 年，汇添富基金新成立 54 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 12 月 31 日，汇添富基金共管理 395 只公募基金，涵盖股票型基金、指数型基金、QDII 基金、混合型基金、债券型基金、REITs 基金及货币市场基金等各类产品。

2025 年，汇添富基金持续坚持以客户为中心，以提升投资者长期回报为核心导向，持续完善投顾式服务体系，强化全流程投资陪伴与资产配置能力。公司互联网金融业务围绕数字化转型，依托大数据与 AI 等技术，持续优化平台功能与服务流程，提升客户触达效率与服务精准度。同时，汇添富基金持续深耕互联网平台合作，丰富投教内容与工具供给，通过

线上线下融合、内容创新与场景化运营，打造更开放、协同的服务生态，更好满足客户多元化、个性化的投资需求，持续提升客户体验与满意度。

2025 年，汇添富基金坚持金融服务实体经济本源，秉持“一切从长期出发”和“客户第一”的经营理念，以高质量发展为核心，持续提升投资者的获得感。在客户服务方面，公司继续坚定推进与核心机构客户的合作战略。公司深化组织变革，通过团队专业化分工，持续提升客户服务及产品运营能力。公司坚定推进与核心机构客户的合作战略，与银行及银行理财公司加快合作，保险规模维持市场领先地位，同时也致力于服务其他机构投资者的专业投资需求。在产品策略上，公司优化产品布局并夯实底层资产布局，构建多元化、多层次的产品矩阵，满足匹配各类机构投资者的差异化配置需求。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合规模持续增加。在数字化建设方面，强化科技赋能，加速数字化转型，深化人工智能（AI）技术在业务全流程的应用，在运营效能与服务质量上取得突破，持续为客户及团队赋能。

2025 年，汇添富渠道业务坚持“一切从长期出发、客户第一”原则，围绕提升“客户获得感”开展各项业务合作和产品布局。顺应行业净值化转型与居民稳健理财需求，以固收+产品为核心，深化银行渠道融合与科技赋能，实现高质量增长。将基金产品精准匹配银行客户多元资产配置需求，助力客户优化风险收益结构。银行渠道深化国有行、股份行战略合作，围绕客户全生命周期理财需求，打造专属资产配置方案。全年线下投教活动 7786 场，覆盖超 50 万人次；线上升级 AI 工具与数字化内容矩阵，全流程赋能银行渠道，获合作伙伴高度认可。

2025 年，汇添富基金持续深化券商专业化服务。全年紧扣机构客户核心需求，打造“添富投资月度策略会”、“云调研固收+基金专题”等系列调研活动；同时面向渠道客户，在全国范围内开展多场投顾赋能培训，助力券商夯实资产配置能力、优化客户服务体系。为拓宽投资者交流渠道，部门全年落地超 300 场线下活动，涵盖“指能添富”、“渠道赋能千场行”及“走进汇添富”等特色活动。秉持“客户第一”的理念，汇添富基金通过为券商提供全流程专业支持，推动优质服务触达更广泛的投资者群体。

2025 年，汇添富基金持续提升客户服务能力，进一步完善服务体系建设，为公司各项业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2025 年，汇添富香港子公司持续深化与母公司的两地一体化运营及垂直化管理模式，

核心业务实现跨越式增长,客户覆盖范围进一步拓宽,客群基础进一步夯实。在产品线维度,公司立足权益投资的核心专长,新增多个主动管理权益专户,同时固定收益与权益类资产规模同步攀升,核心产品竞争力持续凸显。至此,公司境外产品线已形成境外权益、固定收益、货币市场的多元布局,为投资者全球资产分散配置提供了坚实支撑。下一步香港子公司将继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通,进一步完善个性化客户服务体系,积极引导长期资金入市。

2025 年以来,汇添富基金积极开展公益慈善工作,充分发挥公募基金优势,践行社会责任,为助力实现“共同富裕”与中国式现代化贡献力量。公司连续十七年开展“河流·孩子”公益助学项目,举办第十八期乡村优秀青年教师培训和第八届乡村教育管理研习班,助力乡村教育高质量发展;参与中国慈善联合会《慈善组织投资管理指南》团体标准起草,启动“基业上善”慈善资产管理研修营第二期项目,发布《基金会慈善资产管理委员会指南(试行)》,用专业力量推动公益慈善事业可持续发展;发起第三期“致敬城市建设者”公益项目、汇爱社区支持计划一期,助力上海的社区发展,为人民城市增添温度;通过捐赠驰援香港火灾救援工作,与香港同胞共渡难关;参加云南、青海、内蒙古等地产业和教育帮扶等项目,深化东西部协作,助力乡村振兴。

2026 年,汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则,进一步加强风险管理能力,提升客户服务水平,推动业务稳步发展,为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基金经理	2023 年 05 月 19 日	-	15	国籍：中国。 学历：上海财经大学经济学硕士。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

					<p>投资部基金经理。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。</p> <p>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。</p> <p>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发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2023 年 5 月</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2024 年 1 月 31 日至 2025 年 11 月 13 日任汇添富稳元回报债券型发起式证券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。</p>
王星星	本基金的基金经理	2023 年 06 月 29 日	-	10	<p>国籍：中国。</p> <p>学历：中国人民大学金融工程硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2015 年 8 月至 2023 年 2 月任东方证券股份有限公司证券研究所研</p>

					<p>究员、高级研究员、高级分析师、业务总监（研究）。</p> <p>2023 年 2 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。</p> <p>2023 年 6 月 29 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。</p> <p>2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2025 年 3 月 27 日至今任汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2025 年 9 月 30 日至今任汇添富沪深 300 指数量化增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月 10 日至今任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。本报告期内兼任投资人员有产品离任情况,离任产品情况如下:许一尊一离任产品类型:公募基金,离任数量:2只,离任时间:2025年3月8日、2025年11月13日;离任产品类型:私募资产管理计划,离任数量:1只,离任时间:2025年12月29日。

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理的薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或业绩表现不直接挂钩,公司会根据考核结合贡献等情况进行综合评定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合;涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:

在研究分析环节,公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统,规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程,使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节,公司建立健全投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限,合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活

动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人建立了兼任组合公平交易管理制度，从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。

在投资指令管理方面，兼任基金经理原则上应做到“同时同价”。多个组合同日购入或出售同一证券时，应尽量同时发送投资指令，并进行价差监控管理。

在交易行为方面，原则上兼任组合间不得进行同日反向交易（完全按照有关指数的构成比例进行投资的产品等特定情形除外），公司对兼任组合间同日及临近交易日同向交易的价差强化控制和监测。

在交易监测和分析方面，公司对不同时间窗下反向交易和同向交易价差进行分析，最长时间窗为 10 个交易日以上，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素和兼任基金经理的说明，综合分析和评估兼任组合是否存在不公平对待等异常情形。

在事后分析方面，公司定期对兼任组合间的收益率差异、同反向交易的交易时机和交易价差进行事后分析，并对公平交易和异常交易监控分析机制的内部执行情况实施检查。

本报告期内，公司旗下兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 4 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场情绪较好，成交活跃，中证 1000 指数震荡上行，产品在报告期内运作平稳，跑赢基准指数。

本基金采用量化指数增强的方式运作，在控制组合相对基准跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。具体操作上，我们采用多因子模型和 AI 量化选股相结合的方式评价个股，在严控组合和基准之间风格和行业偏离的条件下，超配评价较高的个股、低配评价较低的个股以实现超额收益。报告期内个股偏离相对较低，组合持仓相对分散，以降低组合对个股的依赖，提升组合超额稳定性，同时对风险事件实时监控，及时剔除风险个股，降低组合尾部风险。投资管理过程中我们尽量避免对组合持仓的直接干预，将投资观点和思想转化为规则化的量化投资策略，审慎地调整量化策略去间接调整组合持仓，以保证投资管理的可复制性，同时避免情绪波动对组合投资的负面影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 1000 指数增强 A 类份额净值增长率为 47.14%，同期业绩比较基准收益率为 26.12%。本报告期汇添富中证 1000 指数增强 C 类份额净值增长率为 46.79%，同期业绩比较基准收益率为 26.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年，中国经济预计将在结构调整中实现温和复苏。增长动能主要来自内需的逐步改善与政策的持续支持。固定资产投资整体企稳，房地产投资的拖累作用预期减弱，积极的财政政策将聚焦于促进内需和科技创新，而货币政策料将维持适度宽松的取向，为经济修复提供流动性支持。价格层面，工业品价格有望企稳回升，服务消费预计表现活跃。外部环境中，全球科技投资周期与主要经济体的货币政策转向可能对中国出口构成一定支撑，但地缘政治风险仍是重要的不确定因素。

伴随宏观环境的修复，中国证券市场预计将呈现更具结构性的投资机会，股票配置价值凸显。在产业升级与经济复苏的叙事下，科技制造领域以及部分顺周期行业预计将成为关注重点。港股市场情绪可能随外部流动性环境改善而回暖。大宗商品，特别是部分战略金属，因长期需求与地缘因素保持其配置吸引力。政策层面将持续着力于完善市场基础制度、引导长期资金入市，以增强内在稳定性。需要关注的主要风险包括国内房地产市场的修复节奏、海外经济与政策的潜在波动等。

中证 1000 指数作为 A 股中小盘股票的代表宽基，电子、医药、基础化工等行业占比大，科技、成长属性突出，是配置 A 股中小盘股票的有力工具。本基金作为指数增强基金，将继续严格遵循基金合同约定，在有效控制风险的前提下，力争为投资者创造持续、稳定的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规管理

公司以党的二十届四中全会精神为指导，全面响应公募基金高质量发展行动方案，持续完善合规管理体系建设，在合规管理工作中贯彻落实政策精神及各项法规要求，坚守合规底线、防范合规风险。公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的价值观，通过完善合规管理体系、提升合规专业能力、优化合规资源配置等举措，不断提升合规管理工作的有效性。公司强化合规制度建设，同时深入审慎开展合规审查、合规咨询、合规检查、合规监测等日常工作；高度重视并持续开展员工执业操守和职业道德建设，广泛开展合规培训，强化全员合规意识及合规敏感度；加强监督督促职能，规范人员执业行为，强化一线合规执行效果；高度重视合规管理专业能力建设，保障合规资源配置、优化合规工作机制，不断提升公司合规管理水平。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

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

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

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

3、持续加强稽核工作

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

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人管理的基金能够合法合规开展投资运作。

本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利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、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70015647_B268 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不</p>

	<p>确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔺育化 戴唯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2026 年 03 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	67,654,872.71	16,372,514.53
结算备付金		7,620,145.92	1,498,868.53
存出保证金		1,652,321.83	72,193.89
交易性金融资产	7.4.7.2	1,105,789,791.31	241,950,850.51
其中：股票投资		1,105,789,791.31	241,950,850.51
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		8,874,547.31	663,542.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,191,591,679.08	260,557,969.91
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,609,739.59	179,730.09
应付赎回款		4,213,202.99	477,111.78
应付管理人报酬		1,121,079.72	273,185.25
应付托管费		186,846.64	45,530.90
应付销售服务费		117,481.81	17,403.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,217.74	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	1,048,128.94	286,621.19
负债合计		11,306,697.43	1,279,582.71
净资产:			
实收基金	7.4.7.8	766,709,448.42	247,297,297.03
未分配利润	7.4.7.9	413,575,533.23	11,981,090.17
净资产合计		1,180,284,981.65	259,278,387.20
负债和净资产总计		1,191,591,679.08	260,557,969.91

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 766,709,448.42 份。本基金下属汇添富中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.5447 元，基金份额总额 369,885,298.77 份；本基金下属汇添富中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.5345 元，基金份额总额 396,824,149.65 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 12 月 31 日

一、营业总收入		220,397,578.99	-83,564,846.97
1. 利息收入		143,702.42	105,200.50
其中：存款利息收入	7.4.7.10	143,702.42	105,200.50
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）		210,657,023.88	-96,955,579.49
其中：股票投资收益	7.4.7.11	203,558,887.01	-100,847,230.22
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	77,797.15	27,077.98
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	1,766,511.15	-167,935.96
股利收益	7.4.7.17	5,253,828.57	4,032,508.71
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	9,313,278.50	13,170,535.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	283,574.19	114,996.73
减：二、营业总支出		8,612,544.29	5,053,779.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,700,133.69	3,938,778.53
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,116,688.93	656,463.17
3. 销售服务费		599,333.61	266,531.55
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		6,367.87	-
8. 其他费用	7.4.7.21	190,020.19	192,006.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		211,785,034.70	-88,618,626.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		211,785,034.70	-88,618,626.71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		211,785,034.70	-88,618,626.71

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	247,297,297.03	11,981,090.17	259,278,387.20
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	247,297,297.03	11,981,090.17	259,278,387.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	519,412,151.39	401,594,443.06	921,006,594.45
（一）、综合收益总额	-	211,785,034.70	211,785,034.70
（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）	519,412,151.39	189,809,408.36	709,221,559.75
其中：1. 基金申购款	1,320,597,301.44	472,885,166.51	1,793,482,467.95
2. 基金赎回款	-801,185,150.05	-283,075,758.15	-1,084,260,908.20
（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	766,709,448.42	413,575,533.23	1,180,284,981.65
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	727,528,856.05	4,900,905.75	732,429,761.80
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	727,528,856.05	4,900,905.75	732,429,761.80
三、本期增减变动	-480,231,559.02	7,080,184.42	-473,151,374.60

动额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	-88,618,626.71	-88,618,626.71
（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）	-480,231,559.02	95,698,811.13	-384,532,747.89
其中：1. 基金申购款	682,066,065.42	-53,575,080.31	628,490,985.11
2. 基金赎回款	-1,162,297,624.44	149,273,891.44	-1,013,023,733.00
（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	247,297,297.03	11,981,090.17	259,278,387.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金（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（2022）2395 号文《关于准予汇添富中证 1000 指数增强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 2023 年 5 月 19 日生效。首次设立基金募集规模为 465,286,355.50 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 60466941_B26 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债),按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受

相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金可进行基金收益分配,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种: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、C 类基金份额分别选择不同的分红方式;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、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;

4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

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

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

2. 增值税

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

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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	67,654,872.71	16,372,514.53
等于：本金	67,647,292.42	16,370,773.41
加：应计利息	7,580.29	1,741.12
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	67,654,872.71	16,372,514.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,097,918,506.74	-	1,105,789,791.31	7,871,284.57
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,097,918,506.74	-	1,105,789,791.31	7,871,284.57
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	242,870,853.33	-	241,950,850.51	-920,002.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	242,870,853.33	-	241,950,850.51	-920,002.82

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	11,380,408.89	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	11,380,408.89	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,380,408.89	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	

7.4.7.3.2 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
IM2603	IM2603	8	11,902,400.00	521,991.11

合计	521,991.11
减：可抵销期货暂收款	521,991.11
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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	883,128.94	121,621.19
其中：交易所市场	883,128.94	121,621.19
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	45,000.00	45,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	-	-
应付账户维护费	-	-

应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	-	-
应付持有人大会费-律师费	-	-
应付或有管理费	-	-
申购款利息	-	-
应付登记结算费	-	-
应付 IOPV 计算与发布费	-	-
其他	-	-
合计	1,048,128.94	286,621.19

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 1000 指数增强 A		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	169,861,789.85	169,861,789.85
本期申购	549,189,742.37	549,189,742.37
本期赎回（以“-”号填列）	-349,166,233.45	-349,166,233.45
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	369,885,298.77	369,885,298.77
汇添富中证 1000 指数增强 C		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,435,507.18	77,435,507.18
本期申购	771,407,559.07	771,407,559.07
本期赎回（以“-”号填列）	-452,018,916.60	-452,018,916.60
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）	-	-

号填列)		
本期末	396,824,149.65	396,824,149.65

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 1000 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	-11,331,512.45	19,794,110.22	8,462,597.77
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-11,331,512.45	19,794,110.22	8,462,597.77
本期利润	114,795,697.25	3,870,432.29	118,666,129.54
本期基金份额交易产生的变动数	38,177,782.77	36,184,972.84	74,362,755.61
其中：基金申购款	100,537,412.98	92,112,279.25	192,649,692.23
基金赎回款	-62,359,630.21	-55,927,306.41	-118,286,936.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	141,641,967.57	59,849,515.35	201,491,482.92
汇添富中证 1000 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	-5,472,183.65	8,990,676.05	3,518,492.40
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-5,472,183.65	8,990,676.05	3,518,492.40
本期利润	87,676,058.95	5,442,846.21	93,118,905.16
本期基金份额交易产生的变动数	65,933,459.77	49,513,192.98	115,446,652.75
其中：基金申购款	158,172,025.82	122,063,448.46	280,235,474.28
基金赎回款	-92,238,566.05	-72,550,255.48	-164,788,821.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	148,137,335.07	63,946,715.24	212,084,050.31

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	119,057.96	73,552.74
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	18,849.65	28,456.40
其他	5,794.81	3,191.36
合计	143,702.42	105,200.50

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益——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 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	4,224,696,301.46	2,168,993,564.62
减：卖出股票成本总额	4,016,842,080.51	2,267,083,642.71
减：交易费用	4,295,333.94	2,757,152.13
买卖股票差价收入	203,558,887.01	-100,847,230.22

7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	2,115.48	7,233.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	75,681.67	19,844.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-

合计	77,797.15	27,077.98
----	-----------	-----------

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,076,884.02	16,579,292.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,975,256.00	16,448,872.00
减：应计利息总额	25,936.30	110,576.45
减：交易费用	10.05	-
买卖债券差价收入	75,681.67	19,844.00

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-	-
股指期货投资收益	1,766,511.15	-167,935.96
外汇远期投资收益	-	-
外汇期货投资收益	-	-

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,253,828.57	4,032,508.71
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,253,828.57	4,032,508.71

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	8,791,287.39	13,170,535.29
——股票投资	8,791,287.39	13,170,535.29
——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	521,991.11	-
——权证投资	-	-
——期货投资	521,991.11	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	9,313,278.50	13,170,535.29

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	283,574.19	114,996.73
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	283,574.19	114,996.73

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	7,016.35	8,985.72
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	3.84	20.77
合计	190,020.19	192,006.49

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	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
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富基金销售（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	50,585,628.60	1.27

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	8,898.26	0.63	733.90	0.60

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

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,700,133.69	3,938,778.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,709,733.33	607,155.71
应支付基金管理人的净管理费	4,990,400.36	3,331,622.82

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至

法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,116,688.93	656,463.17

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 1000 指数增强 A	汇添富中证 1000 指数增强 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	66,015.80	66,015.80
东方证券股份有限公司	-	903.38	903.38
中国建设银行	-	116,065.85	116,065.85

股份有限公司			
合计	-	182,985.03	182,985.03
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 1000 指数增强 A	汇添富中证 1000 指数增强 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	106,774.31	106,774.31
东方证券股份有限公司	-	1,014.34	1,014.34
中国建设银行股份有限公司	-	23,784.55	23,784.55
合计	-	131,573.20	131,573.20

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	67,654,872.71	119,057.96	16,372,514.53	73,552.74

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

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

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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	认购价格	期末估值单价	数量（单位）	期末成本总额	期末估值总额	备注

	称			限 类 型			股)			
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	
301563	云汉芯城	2025 年 09 月 23 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	
301584	建发致新	2025 年 09 月 18 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	
301638	南网数字	2025 年 11 月 11	6 个 月	新 股 流 通 受	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	

		日		限						
301656	联合动力	2025年09月17日	6个月	新股流通受限	12.48	25.46	4,345	54,225.60	110,623.70	
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新股流通受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	
301668	昊创瑞通	2025年09月15日	6个月	新股流通受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	
601026	道生天合材料科技	2025年10月09日	6个月	新股流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新股流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	
603248	锡华科技	2025年12月16日	6个月	新股流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	

		日		限						
603334	丰倍生物	2025年10月29日	6个月	新股流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	
603418	友升股份	2025年09月16日	6个月	新股流通受限	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	
688765	武汉禾元生物	2025年10月16日	9个月	新股流通受限	29.06	52.80	12,494	363,075.64	659,683.20	
688805	健信超导	2025年12月17日	6个月	新股流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	
688807	优迅芯片股份	2025年12月10日	6个月	新股流通受限	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	
688809	强一股份	2025年12月23日	6个月	新股流通受限	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	

7.4.12.1.2 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
					-	-	-	-	-	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600058	五矿发展	2025年12月30日	重大事项停牌	11.52	2026年01月15日	12.67	391,200	3,740,592.21	4,506,624.00	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组

织架构，并明确了相应的风险管理职能。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1- 3 个月	3 个月 -1 年	1- 5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	67,654,872.71	-	-	-	-	-	67,654,872.71
结算备付金	7,620,145.92	-	-	-	-	-	7,620,145.92
存出保证金	224,033.83	-	-	-	-	1,428,288.00	1,652,321.83
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,105,789,791.31	1,105,789,791.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	8,874,547.31	8,874,547.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	75,499,052.46	-	-	-	-	1,116,092,626.62	1,191,591,679.08
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	-	-	-	-	-	4,609,739.59	4,609,739.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,213,202.99	4,213,202.99
应付	-	-	-	-	-	1,121,079.72	1,121,079.72

管理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	186,846.64	186,846.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	117,481.81	117,481.81
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	10,217.74	10,217.74
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,048,128.94	1,048,128.94
负债总计	-	-	-	-	-	11,306,697.43	11,306,697.43
利率敏感度缺口	75,499,052.46	-	-	-	-	1,104,785,929.19	1,180,284,981.65
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	16,372,514.53	-	-	-	-	-	16,372,514.53
结算备付金	1,498,868.53	-	-	-	-	-	1,498,868.53
存出保证	72,193.89	-	-	-	-	-	72,193.89

金							
交易性金融资产	-	-	-	-	-	241,950,850.51	241,950,850.51
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	663,542.45	663,542.45
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,943,576.95	-	-	-	-	242,614,392.96	260,557,969.91
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	-	-	-	-	-	179,730.09	179,730.09
应付赎回款	-	-	-	-	-	477,111.78	477,111.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	273,185.25	273,185.25
应付托管费	-	-	-	-	-	45,530.90	45,530.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,403.50	17,403.50
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	-	-	-	-	-	286,621.19	286,621.19
负债总计	-	-	-	-	-	1,279,582.71	1,279,582.71
利率敏感度缺口	17,943,576.95	-	-	-	-	241,334,810.25	259,278,387.20

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,105,789,791.31	93.69	241,950,850.51	93.32
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,105,789,791.31	93.69	241,950,850.51	93.32

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险,即从长期来看,本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关,且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变; 2. 以下分析中,除市场基准发生变动,其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证 1000 指数	53,044,685.73	11,965,828.35

	上涨 5%		
	中证 1000 指数	-53,044,685.73	-11,965,828.35
	下跌 5%		

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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	1,100,263,229.52	241,950,850.51
第二层次	4,506,624.00	-
第三层次	1,019,937.79	-
合计	1,105,789,791.31	241,950,850.51

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	533,885.99	533,885.99
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	486,051.80	486,051.80
其中：计入损益的利得或损失	-	486,051.80	486,051.80
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,019,937.79	1,019,937.79
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	486,051.80	486,051.80
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,019,937.79	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.2208-3.0323	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
	-				

7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,105,789,791.31	92.80
	其中：股票	1,105,789,791.31	92.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	75,275,018.63	6.32
8	其他各项资产	10,526,869.14	0.88
9	合计	1,191,591,679.08	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,056,186.00	0.26
B	采矿业	26,634,580.00	2.26
C	制造业	665,559,372.50	56.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,075,491.00	1.79
E	建筑业	14,278,925.00	1.21
F	批发和零售业	17,951,906.00	1.52
G	交通运输、仓储和邮政业	6,316,506.00	0.54
H	住宿和餐饮业	4,862,525.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	71,847,494.00	6.09
J	金融业	6,886,799.40	0.58
K	房地产业	8,015,850.00	0.68
L	租赁和商务服务业	7,554,768.00	0.64
M	科学研究和技术服务业	20,300,469.00	1.72
N	水利、环境和公共设施管理业	10,824,859.00	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,417,395.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	5,936,813.00	0.50
S	综合	4,512,774.00	0.38

合计	900,032,712.90	76.26
----	----------------	-------

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	2,602,378.00	0.22
B	采矿业	-	-
C	制造业	158,109,281.19	13.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,906,494.00	0.42
E	建筑业	2,518,582.00	0.21
F	批发和零售业	2,080,518.44	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,366,049.26	1.39
J	金融业	4,107,694.00	0.35
K	房地产业	2,623,672.00	0.22
L	租赁和商务服务业	3,268,204.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	7,657,194.52	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	1,517,011.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		205,757,078.41	17.43

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300953	震裕科技	37,200	6,250,344.00	0.53

2	600100	同方股份	699,900	6,243,108.00	0.53
3	300620	光库科技	42,100	6,190,805.00	0.52
4	002222	福晶科技	108,200	6,095,988.00	0.52
5	002245	蔚蓝锂芯	337,300	6,003,940.00	0.51
6	002487	大金重工	114,100	5,925,213.00	0.50
7	300438	鹏辉能源	109,300	5,816,946.00	0.49
8	603306	华懋科技	92,200	5,809,522.00	0.49
9	300049	福瑞医科	81,900	5,766,579.00	0.49
10	002428	云南锗业	180,500	5,730,875.00	0.49
11	300409	道氏技术	253,112	5,692,488.88	0.48
12	601208	东材科技	206,100	5,583,249.00	0.47
13	688123	聚辰半导体	43,600	5,475,288.00	0.46
14	605376	博迁新材	83,400	5,454,360.00	0.46
15	688536	思瑞浦股份	34,000	5,435,920.00	0.46
16	002484	江海股份	182,700	5,426,190.00	0.46
17	300779	惠城环保	41,500	5,399,565.00	0.46
18	300777	中简科技	132,000	5,385,600.00	0.46
19	688048	长光华芯	42,600	5,339,910.00	0.45
20	000811	冰轮环境	286,300	5,302,276.00	0.45
21	002373	千方科技	437,300	5,147,021.00	0.44
22	688484	南芯科技	126,400	5,139,424.00	0.44
23	002324	普利特	312,900	5,003,271.00	0.42

24	300775	三角防务	164,100	4,988,640.00	0.42
25	600761	安徽合力	238,500	4,982,265.00	0.42
26	688519	南亚新材料	61,400	4,964,804.00	0.42
27	300811	铂科新材	69,500	4,956,045.00	0.42
28	600850	电科数字	166,800	4,943,952.00	0.42
29	601636	旗滨集团	832,400	4,936,132.00	0.42
30	002182	宝武镁业	321,800	4,923,540.00	0.42
31	600320	振华重工	955,400	4,920,310.00	0.42
32	000686	东北证券	523,600	4,879,952.00	0.41
33	300602	飞荣达	147,000	4,874,520.00	0.41
34	603876	鼎胜新材	324,300	4,867,743.00	0.41
35	600258	首旅酒店	290,300	4,862,525.00	0.41
36	600596	新安股份	421,588	4,835,614.36	0.41
37	002006	精工科技	208,600	4,831,176.00	0.41
38	000923	河钢资源	227,000	4,805,590.00	0.41
39	688372	伟测科技	44,000	4,799,960.00	0.41
40	300008	天海防务	606,400	4,784,496.00	0.41
41	603119	浙江荣泰股份	41,200	4,765,604.00	0.40
42	601778	晶科科技	1,280,000	4,761,600.00	0.40
43	000612	焦作万方	429,900	4,737,498.00	0.40
44	300098	高新兴	775,400	4,729,940.00	0.40
45	603588	高能环境	609,700	4,706,884.00	0.40
46	000555	神州信	282,200	4,670,410.00	0.40

		息			
47	600641	先导基电	264,400	4,664,016.00	0.40
48	002539	云图控股	394,400	4,661,808.00	0.39
49	002745	木林森	487,100	4,661,547.00	0.39
50	002815	崇达技术	339,800	4,641,668.00	0.39
51	600490	鹏欣资源	600,400	4,641,092.00	0.39
52	000758	中色股份	696,700	4,626,088.00	0.39
53	300682	朗新集团	302,300	4,597,983.00	0.39
54	600057	厦门象屿	538,800	4,590,576.00	0.39
55	002897	意华股份	84,800	4,585,136.00	0.39
56	600478	科力远	665,300	4,583,917.00	0.39
57	600459	贵研铂业	245,500	4,568,755.00	0.39
58	000682	东方电子	383,400	4,547,124.00	0.39
59	600686	金龙汽车	255,700	4,536,118.00	0.38
60	688062	迈威生物	117,800	4,531,766.00	0.38
61	301219	腾远钴业	66,200	4,520,136.00	0.38
62	002023	海特高新	333,700	4,518,298.00	0.38
63	000833	粤桂股份	231,900	4,512,774.00	0.38
64	600058	五矿发展	391,200	4,506,624.00	0.38
65	301095	广立微	62,700	4,496,217.00	0.38
66	688439	振华风光	69,600	4,496,160.00	0.38
67	688127	蓝特光学	116,800	4,495,632.00	0.38
68	300776	帝尔激光	72,300	4,492,722.00	0.38
69	603171	税友股	81,400	4,487,582.00	0.38

		份			
70	605020	永和股份	166,200	4,469,118.00	0.38
71	688158	优刻得科技	158,800	4,460,692.00	0.38
72	301217	铜冠铜箔	129,300	4,432,404.00	0.38
73	300244	迪安诊断	278,700	4,417,395.00	0.37
74	600409	三友化工	713,400	4,415,946.00	0.37
75	600399	抚顺特钢	752,600	4,395,184.00	0.37
76	301526	国际复材	626,800	4,387,600.00	0.37
77	300323	华灿光电	547,500	4,369,050.00	0.37
78	600507	方大特钢	741,000	4,364,490.00	0.37
79	600353	旭光电子	268,800	4,333,056.00	0.37
80	603663	三祥新材	122,500	4,330,375.00	0.37
81	300319	麦捷科技	369,100	4,314,779.00	0.37
82	002099	海翔药业	690,500	4,308,720.00	0.37
83	688153	唯捷创芯	114,400	4,306,016.00	0.36
84	688091	上海谊众药业	91,544	4,302,568.00	0.36
85	601678	滨化股份	1,009,100	4,278,584.00	0.36
86	600577	精达股份	344,000	4,275,920.00	0.36
87	300416	苏试试验	239,200	4,267,328.00	0.36
88	600888	新疆众和	520,300	4,261,257.00	0.36
89	601890	亚星锚链	412,000	4,239,480.00	0.36
90	000589	贵州轮胎	818,400	4,239,312.00	0.36

91	002967	广电计量	191,700	4,219,317.00	0.36
92	300428	立中集团	180,661	4,218,434.35	0.36
93	603256	宏和科技	113,900	4,192,659.00	0.36
94	002243	力合科创	421,300	4,191,935.00	0.36
95	301031	中熔电气	37,300	4,184,687.00	0.35
96	601369	陕鼓动力	417,600	4,180,176.00	0.35
97	300443	金雷股份	148,400	4,174,492.00	0.35
98	000880	潍柴重机	152,400	4,163,568.00	0.35
99	002511	中顺洁柔	486,100	4,161,016.00	0.35
100	000422	湖北宜化	292,400	4,155,004.00	0.35
101	002626	金达威	210,800	4,154,868.00	0.35
102	603915	国茂股份	225,400	4,149,614.00	0.35
103	600361	创新新材	978,100	4,147,144.00	0.35
104	301589	诺瓦星云	25,200	4,146,660.00	0.35
105	600366	宁波韵升	299,400	4,128,726.00	0.35
106	002913	奥士康	96,500	4,124,410.00	0.35
107	688700	东威科技	116,800	4,120,704.00	0.35
108	002993	奥海科技	93,900	4,104,369.00	0.35
109	600125	铁龙物流	636,000	4,095,840.00	0.35
110	000990	诚志股份	516,700	4,092,264.00	0.35
111	688300	联瑞新材	65,800	4,085,522.00	0.35
112	000049	德赛电池	151,800	4,080,384.00	0.35
113	600252	中恒集	1,480,100	4,055,474.00	0.34

		团			
114	000928	中钢国际	613,400	4,054,574.00	0.34
115	002978	安宁股份	122,400	4,045,320.00	0.34
116	002612	朗姿股份	197,900	4,045,076.00	0.34
117	603118	共进股份	351,600	4,043,400.00	0.34
118	002110	三钢闽光	919,000	4,034,410.00	0.34
119	002498	汉缆股份	1,051,411	4,026,904.13	0.34
120	002038	双鹭药业	544,000	4,009,280.00	0.34
121	300134	大富科技	318,700	3,983,750.00	0.34
122	600328	中盐化工	482,700	3,977,448.00	0.34
123	301175	中科环保	672,500	3,974,475.00	0.34
124	002125	湘潭电化	280,100	3,966,216.00	0.34
125	002516	旷达科技	601,000	3,960,590.00	0.34
126	002946	新乳业	212,500	3,937,625.00	0.33
127	001337	四川黄金	140,400	3,911,544.00	0.33
128	003039	顺控发展	244,400	3,893,292.00	0.33
129	002233	塔牌集团	430,500	3,878,805.00	0.33
130	002051	中工国际	427,400	3,876,518.00	0.33
131	605116	奥锐特	154,300	3,865,215.00	0.33
132	002489	浙江永强	1,005,800	3,852,214.00	0.33
133	002882	金龙羽	127,700	3,851,432.00	0.33
134	002698	博实股份	227,500	3,824,275.00	0.32
135	603327	福蓉科技	348,600	3,785,796.00	0.32
136	002216	三全食	331,800	3,746,022.00	0.32

		品			
137	301215	中汽股份	541,400	3,708,590.00	0.31
138	000899	赣能股份	372,800	3,690,720.00	0.31
139	603103	横店影视	222,100	3,682,418.00	0.31
140	688001	苏州华兴源创科技	121,400	3,663,852.00	0.31
141	688351	微创电生理股份	158,200	3,662,330.00	0.31
142	000603	盛达资源	118,100	3,656,376.00	0.31
143	002242	九阳股份	347,100	3,623,724.00	0.31
144	000597	东北制药	691,600	3,610,152.00	0.31
145	603505	金石资源	192,500	3,595,900.00	0.30
146	301458	钧崴电子	111,900	3,590,871.00	0.30
147	688209	英集芯科技	180,000	3,589,200.00	0.30
148	605118	力鼎光电	118,900	3,580,079.00	0.30
149	601038	一拖股份	252,300	3,575,091.00	0.30
150	600726	华电能源	1,491,500	3,564,685.00	0.30
151	000019	深粮控股	512,100	3,559,095.00	0.30
152	002011	盾安环境	279,700	3,546,596.00	0.30
153	601068	中铝国际	669,700	3,542,713.00	0.30
154	002079	苏州固锴	370,300	3,536,365.00	0.30
155	688182	灿勤科技	116,200	3,430,224.00	0.29
156	002004	华邦健康	716,400	3,424,392.00	0.29
157	300723	一品红	101,200	3,395,260.00	0.29

158	002292	奥飞娱乐	379,300	3,356,805.00	0.28
159	002405	四维图新	365,400	3,292,254.00	0.28
160	000902	新洋丰	206,900	3,231,778.00	0.27
161	600623	华谊集团	415,500	3,203,505.00	0.27
162	688177	百奥泰生物	138,275	3,199,683.50	0.27
163	002408	齐翔腾达	650,400	3,173,952.00	0.27
164	002100	天康生物	427,600	3,151,412.00	0.27
165	600075	新疆天业	633,270	3,134,686.50	0.27
166	002531	天顺风能	456,900	3,134,334.00	0.27
167	600063	皖维高新	523,800	3,085,182.00	0.26
168	603638	艾迪精密	162,100	3,068,553.00	0.26
169	002458	益生股份	364,700	3,056,186.00	0.26
170	600750	江中药业	129,400	2,998,198.00	0.25
171	000059	华锦股份	559,400	2,992,790.00	0.25
172	002987	京北方	138,500	2,981,905.00	0.25
173	002258	利尔化学	227,400	2,967,570.00	0.25
174	300185	通裕重工	1,037,500	2,946,500.00	0.25
175	002654	万润科技	206,000	2,898,420.00	0.25
176	000672	上峰水泥	221,900	2,882,481.00	0.24
177	301508	中机认检	91,900	2,872,794.00	0.24
178	002060	广东建工	779,200	2,805,120.00	0.24
179	603063	禾望电气	83,900	2,774,573.00	0.24
180	000791	甘肃能	425,500	2,744,475.00	0.23

		源			
181	688639	华恒生物	84,000	2,736,720.00	0.23
182	301345	涛涛车业	10,800	2,714,256.00	0.23
183	600859	王府井	173,300	2,691,349.00	0.23
184	603328	依顿电子	243,100	2,664,376.00	0.23
185	688515	裕太微电子	25,800	2,645,790.00	0.22
186	600782	新钢股份	672,100	2,607,748.00	0.22
187	688150	莱特光电股份	95,000	2,567,850.00	0.22
188	000761	本钢板材	764,700	2,561,745.00	0.22
189	688549	中巨芯科技	276,600	2,522,592.00	0.21
190	000581	威孚高科	118,700	2,447,594.00	0.21
191	301376	致欧科技	135,300	2,444,871.00	0.21
192	605507	国邦医药	97,900	2,427,920.00	0.21
193	688390	固德威电源	38,800	2,410,644.00	0.20
194	002063	远光软件	396,800	2,408,576.00	0.20
195	301571	国科天成	41,700	2,405,256.00	0.20
196	603218	日月股份	178,000	2,358,500.00	0.20
197	600586	金晶科技	407,300	2,293,099.00	0.19
198	300232	洲明科技	322,000	2,282,980.00	0.19
199	002755	奥赛康	136,000	2,220,880.00	0.19
200	000029	深深房 A	100,200	2,206,404.00	0.19
201	002315	焦点科技	48,200	2,205,632.00	0.19
202	001308	康冠科技	105,300	2,196,558.00	0.19

203	301606	绿联科技	37,200	2,185,128.00	0.19
204	300618	寒锐钴业	48,009	2,170,486.89	0.18
205	301109	军信股份	142,900	2,143,500.00	0.18
206	688548	广钢气体股份	145,600	2,117,024.00	0.18
207	600158	中体产业	231,000	2,016,630.00	0.17
208	002399	海普瑞	170,300	2,007,837.00	0.17
209	600403	大有能源	283,700	1,980,226.00	0.17
210	688800	瑞可达连接系统	23,400	1,942,200.00	0.16
211	300747	锐科激光	71,500	1,932,645.00	0.16
212	002174	游族网络	157,700	1,930,248.00	0.16
213	002302	西部建设	301,000	1,842,120.00	0.16
214	000065	北方国际	146,000	1,819,160.00	0.15
215	301511	德福科技	50,000	1,789,500.00	0.15
216	600114	东睦股份	57,700	1,762,735.00	0.15
217	600210	紫江企业	237,800	1,747,830.00	0.15
218	002345	潮宏基	127,000	1,587,500.00	0.13
219	603219	富佳股份	92,000	1,549,280.00	0.13
220	600618	氯碱化工	128,500	1,526,580.00	0.13
221	688088	虹软科技	30,600	1,514,700.00	0.13
222	688185	康希诺生物	24,084	1,513,679.40	0.13
223	688352	颀中科技	119,600	1,508,156.00	0.13
224	300171	东富龙	93,700	1,471,090.00	0.12
225	688584	上海合	62,000	1,360,280.00	0.12

		晶硅材料			
226	605599	菜百股份	79,000	1,293,230.00	0.11
227	688686	奥普特科技	9,873	1,225,535.49	0.10
228	601702	华峰铝业	59,500	1,217,965.00	0.10
229	601619	嘉泽新能	272,000	1,207,680.00	0.10
230	301381	赛维时代	57,100	1,175,689.00	0.10
231	688097	博众精工科技	31,000	1,170,250.00	0.10
232	000778	新兴铸管	276,800	1,157,024.00	0.10
233	688116	天奈科技	24,400	1,150,460.00	0.10
234	600649	城投控股	257,400	1,145,430.00	0.10
235	300913	兆龙互连	21,400	1,126,282.00	0.10
236	301316	慧博云通	23,300	1,041,044.00	0.09
237	603027	千禾味业	99,300	976,119.00	0.08
238	688029	南微医学科技	11,800	962,408.00	0.08
239	000810	创维数字	75,400	888,212.00	0.08
240	601975	招商南油	289,100	873,082.00	0.07
241	000030	富奥股份	135,300	776,622.00	0.07
242	603043	广州酒家	43,200	761,616.00	0.06
243	688343	云天励飞股份	9,400	715,152.00	0.06
244	000636	风华高科	43,000	700,040.00	0.06
245	000600	建投能源	80,300	684,959.00	0.06
246	002073	软控股份	83,100	677,265.00	0.06

247	688380	中微半 导	20,800	668,720.00	0.06
248	600933	爱柯迪	32,800	659,280.00	0.06
249	002145	钛能化 学	130,400	638,960.00	0.05
250	002075	沙钢股 份	109,100	627,325.00	0.05
251	000813	德展健 康	162,700	624,768.00	0.05
252	688798	艾为电 子	8,000	608,880.00	0.05
253	600643	爱建集 团	108,000	597,240.00	0.05
254	002706	良信股 份	52,700	568,106.00	0.05
255	000767	晋控电 力	188,600	528,080.00	0.04
256	000557	西部创 业	105,900	527,382.00	0.04
257	002536	飞龙股 份	17,200	510,840.00	0.04
258	601107	四川成 渝	81,700	496,736.00	0.04
259	300475	香农芯 创	3,200	461,888.00	0.04
260	603093	南华期 货	23,400	456,066.00	0.04
261	600640	国脉文 化	36,300	455,928.00	0.04
262	301631	壹连科 技	4,400	455,620.00	0.04
263	301665	泰禾股 份	15,700	443,368.00	0.04
264	002839	张家港 行	95,320	435,612.40	0.04
265	688131	皓元医 药	6,000	432,480.00	0.04
266	002588	史丹利	43,300	432,134.00	0.04
267	688362	甬矽电 子	12,400	401,884.00	0.03
268	002807	江阴银 行	79,700	364,229.00	0.03
269	688200	华峰测	1,800	342,360.00	0.03

		控			
270	603713	密尔克卫	5,800	323,466.00	0.03
271	002901	大博医疗	5,900	279,483.00	0.02
272	600867	通化东宝	30,000	245,100.00	0.02
273	601858	中国科传	13,100	237,765.00	0.02
274	002690	美亚光电	11,000	226,270.00	0.02
275	002020	京新药业	11,900	225,862.00	0.02
276	688331	荣昌生物	2,800	217,812.00	0.02
277	002675	东诚药业	15,800	217,092.00	0.02
278	601096	宏盛华源铁塔集团	49,400	205,010.00	0.02
279	603733	仙鹤股份	7,900	190,943.00	0.02
280	688779	五矿新能	20,800	155,792.00	0.01
281	001236	弘业期货	14,500	153,700.00	0.01
282	603279	景津装备	9,100	153,517.00	0.01
283	300080	易成新能	29,900	145,314.00	0.01
284	300034	钢研高纳	6,900	135,102.00	0.01
285	603317	天味食品	10,100	126,452.00	0.01
286	300861	美畅股份	6,700	100,031.00	0.01
287	000927	中国铁物	25,200	65,772.00	0.01
288	002550	千红制药	8,100	63,666.00	0.01
289	300357	我武生物	1,700	48,195.00	0.00
290	688313	仕佳光子	400	35,512.00	0.00

291	300151	昌红科技	2,000	30,160.00	0.00
292	600338	西藏珠峰	900	13,536.00	0.00

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

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	301338	凯格精机	43,700	3,850,407.00	0.33
2	000301	东方盛虹	318,800	3,471,732.00	0.29
3	603799	华友钴业	50,600	3,453,956.00	0.29
4	603759	海天股份	321,000	3,383,340.00	0.29
5	002655	共达电声	261,500	3,378,580.00	0.29
6	301507	民生健康	218,100	3,350,016.00	0.28
7	002587	奥拓电子	495,400	3,348,904.00	0.28
8	600808	马钢股份	791,600	3,340,552.00	0.28
9	600965	福成股份	559,600	3,329,620.00	0.28
10	600860	京城股份	265,300	3,326,862.00	0.28
11	002331	皖通科技	372,000	3,318,240.00	0.28
12	000987	越秀资本	407,500	3,317,050.00	0.28
13	000619	海螺新材	534,100	3,316,761.00	0.28
14	300550	和仁科技	228,400	3,314,084.00	0.28
15	601138	工业富联	53,400	3,313,470.00	0.28
16	002404	嘉欣丝	472,200	3,310,122.00	0.28

		绸			
17	300162	雷曼光电	406,700	3,306,471.00	0.28
18	002436	兴森科技	156,000	3,302,520.00	0.28
19	002284	亚太股份	221,100	3,301,023.00	0.28
20	002523	天桥起重	768,900	3,298,581.00	0.28
21	600487	亨通光电	133,100	3,291,563.00	0.28
22	002414	高德红外	224,100	3,287,547.00	0.28
23	600844	金煤科技	1,141,500	3,287,520.00	0.28
24	600851	海欣股份	481,200	3,286,596.00	0.28
25	603259	药明康德	36,200	3,281,168.00	0.28
26	300283	温州宏丰	434,900	3,274,797.00	0.28
27	300707	威唐工业	198,600	3,266,970.00	0.28
28	300949	奥雅股份	82,500	3,234,000.00	0.27
29	603877	太平鸟	221,000	3,211,130.00	0.27
30	300206	理邦仪器	250,300	3,201,337.00	0.27
31	000017	深中华 A	404,600	3,184,202.00	0.27
32	002824	和胜股份	161,700	3,136,980.00	0.27
33	002593	日上集团	530,700	3,136,437.00	0.27
34	301539	宏鑫科技	144,000	3,009,600.00	0.25
35	300644	南京聚隆	79,400	2,930,654.00	0.25
36	002555	三七互娱	120,400	2,841,440.00	0.24
37	003007	直真科技	73,400	2,737,086.00	0.23
38	688636	智明达	62,800	2,690,352.00	0.23

		电子			
39	002448	中原内配	204,300	2,641,599.00	0.22
40	300647	超频三	380,500	2,621,645.00	0.22
41	002234	民和股份	301,900	2,602,378.00	0.22
42	300486	东杰智能	130,900	2,566,949.00	0.22
43	002426	胜利精密	667,200	2,555,376.00	0.22
44	603015	弘讯科技	201,200	2,525,060.00	0.21
45	002431	棕榈股份	1,053,800	2,518,582.00	0.21
46	300263	隆华科技	263,000	2,324,920.00	0.20
47	002671	龙泉股份	433,900	2,273,636.00	0.19
48	301169	零点有数	43,000	2,154,300.00	0.18
49	002631	德尔未来	331,400	1,981,772.00	0.17
50	603966	法兰泰克	166,000	1,975,400.00	0.17
51	301176	逸豪新材	78,200	1,968,294.00	0.17
52	300852	四会富仕	50,200	1,916,636.00	0.16
53	301499	维科精密	61,000	1,795,230.00	0.15
54	002493	荣盛石化	146,900	1,720,199.00	0.15
55	002109	兴化股份	463,500	1,645,425.00	0.14
56	688256	寒武纪科技	1,200	1,626,660.00	0.14
57	603629	利通电子	60,600	1,614,990.00	0.14
58	000717	中南股份	600,800	1,556,072.00	0.13
59	002314	南山控股	540,000	1,539,000.00	0.13
60	000639	西王食	454,800	1,505,388.00	0.13

		品			
61	002758	浙农股份	147,900	1,489,353.00	0.13
62	300394	天孚通信	7,100	1,441,513.00	0.12
63	000421	南京公用	202,800	1,401,348.00	0.12
64	301548	崇德科技	25,100	1,388,281.00	0.12
65	003030	祖名股份	62,400	1,259,856.00	0.11
66	003027	同兴科技	56,400	1,257,720.00	0.11
67	300791	仙乐健康	42,080	1,088,188.80	0.09
68	002968	新大正	89,200	1,084,672.00	0.09
69	002309	中利集团	319,700	1,083,783.00	0.09
70	001319	铭科精技	38,300	1,052,101.00	0.09
71	300103	达刚控股	123,600	992,508.00	0.08
72	301568	思泰克	20,000	970,600.00	0.08
73	002590	万安科技	63,400	951,000.00	0.08
74	002333	罗普斯金	164,700	925,614.00	0.08
75	600936	广西广电	214,600	905,612.00	0.08
76	300243	瑞丰高材	86,400	901,152.00	0.08
77	688288	鸿泉技术	31,200	836,472.00	0.07
78	002486	嘉麟杰	260,500	810,155.00	0.07
79	600927	永安期货	49,200	790,644.00	0.07
80	002625	光启技术	15,500	755,780.00	0.06
81	688530	欧莱新材	43,622	717,145.68	0.06
82	002475	立讯精密	12,500	708,875.00	0.06
83	300977	深圳瑞	39,100	672,129.00	0.06

		捷			
84	000565	渝三峡 A	91,800	670,140.00	0.06
85	688765	武汉禾 元生物	12,494	659,683.20	0.06
86	688486	龙迅股 份	8,800	653,928.00	0.06
87	688809	强一股 份	2,584	649,717.29	0.06
88	688030	山石网 科	35,400	643,218.00	0.05
89	002115	三维通 信	49,600	631,904.00	0.05
90	002162	悦心健 康	124,900	582,034.00	0.05
91	300711	广哈通 信	23,900	554,958.00	0.05
92	603669	灵康药 业	114,800	523,488.00	0.04
93	600293	三峡新 材	165,400	521,010.00	0.04
94	300318	博晖创 新	80,600	505,362.00	0.04
95	300242	佳云科 技	96,400	482,000.00	0.04
96	300011	鼎汉技 术	51,100	438,438.00	0.04
97	603126	中材节 能	64,500	433,440.00	0.04
98	300239	东宝生 物	72,100	422,506.00	0.04
99	300452	山河药 辅	29,600	396,048.00	0.03
100	300932	三友联 众	31,200	374,088.00	0.03
101	300565	科信技 术	29,100	366,951.00	0.03
102	300449	汉邦高 科	42,600	324,612.00	0.03
103	301313	凡拓数 创	10,700	283,657.00	0.02
104	301060	兰卫医 学	30,600	283,050.00	0.02

105	600078	澄星股份	28,300	271,397.00	0.02
106	300140	节能环保	38,300	259,291.00	0.02
107	301138	华研精机	5,900	228,920.00	0.02
108	603188	亚邦股份	37,900	173,961.00	0.01
109	001369	双欣环保	8,966	144,781.52	0.01
110	002340	格林美	17,300	144,628.00	0.01
111	300972	万辰集团	700	140,749.00	0.01
112	600128	苏豪弘业	12,800	140,672.00	0.01
113	301687	新广益	1,942	135,202.09	0.01
114	600796	钱江生化	20,100	121,806.00	0.01
115	300839	博汇股份	9,700	116,788.00	0.01
116	603982	泉峰汽车	13,500	112,995.00	0.01
117	301656	联合动力	4,345	110,623.70	0.01
118	688805	健信超导	2,643	108,786.97	0.01
119	000635	英力特	10,800	96,012.00	0.01
120	000553	安道麦A	14,600	80,008.00	0.01
121	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
122	688160	步科自动化	200	30,500.00	0.00
123	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
124	001396	誉帆科技	688	29,151.76	0.00
125	688807	优迅芯片股份	131	17,758.36	0.00
126	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
127	301584	建发致	447	11,988.54	0.00

		新			
128	688213	思特威 电子科 技	96	9,128.64	0.00
129	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
130	603418	友升股 份	139	8,209.34	0.00
131	603175	超颖电 子	169	8,206.64	0.00
132	301668	昊创瑞 通	165	7,392.00	0.00
133	301449	天溯计 量	112	7,305.76	0.00
134	601026	道生天 合材料 科技	451	6,440.28	0.00
135	603248	锡华科 技	260	4,238.00	0.00
136	603376	大明电 子	111	2,909.31	0.00
137	603334	丰倍生 物	88	2,888.16	0.00
138	300619	金银河	45	1,975.50	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资 产净值比例 (%)
1	688048	长光华芯	19,529,802.06	7.53
2	688166	博瑞生物 医药	19,038,484.73	7.34
3	301511	德福科技	18,979,301.40	7.32
4	301217	铜冠铜箔	18,519,833.00	7.14
5	688498	源杰科技	17,457,591.52	6.73
6	300672	国科微	17,400,515.00	6.71
7	600601	方正科技	17,359,697.00	6.70
8	001203	大中矿业	17,240,511.49	6.65
9	603171	税友股份	17,232,707.00	6.65
10	002428	云南锗业	16,882,430.00	6.51

11	300620	光库科技	16,874,812.00	6.51
12	300779	惠城环保	16,549,237.00	6.38
13	000917	电广传媒	16,472,664.00	6.35
14	688270	浙江臻镭 科技股份	16,442,399.64	6.34
15	688372	伟测科技	16,119,296.89	6.22
16	300682	朗新集团	15,911,939.00	6.14
17	002484	江海股份	15,544,155.00	6.00
18	603083	剑桥科技	15,525,320.00	5.99
19	300593	新雷能	15,202,149.00	5.86
20	002326	永太科技	14,760,534.00	5.69
21	600759	洲际油气	14,373,972.00	5.54
22	300570	太辰光	14,094,052.00	5.44
23	300244	迪安诊断	13,923,053.00	5.37
24	603063	禾望电气	13,648,158.00	5.26
25	300775	三角防务	13,246,220.00	5.11
26	688343	云天励飞 股份	13,183,810.67	5.08
27	002126	银轮股份	13,082,623.00	5.05
28	688262	苏州国芯 科技	13,064,111.19	5.04
29	300624	万兴科技	13,046,032.99	5.03
30	600877	电科芯片	12,944,738.00	4.99
31	001309	德明利	12,787,593.00	4.93
32	601208	东材科技	12,683,438.98	4.89
33	688536	思瑞浦股 份	12,427,847.68	4.79
34	603306	华懋科技	12,293,105.00	4.74
35	603119	浙江荣泰 股份	11,972,720.41	4.62
36	002314	南山控股	11,912,383.00	4.59
37	002174	游族网络	11,813,017.00	4.56
38	300972	万辰集团	11,806,784.00	4.55
39	688347	华虹半导 体公司	11,761,727.55	4.54
40	000603	盛达资源	11,717,963.00	4.52
41	300602	飞荣达	11,680,356.36	4.50
42	601869	长飞光纤	11,650,598.00	4.49
43	603533	掌阅科技	11,520,103.00	4.44
44	000811	冰轮环境	11,463,565.80	4.42
45	000612	焦作万方	11,354,710.00	4.38
46	300049	福瑞医科	11,189,033.60	4.32
47	601519	大智慧	11,175,632.00	4.31

48	301095	广立微	11,043,728.00	4.26
49	688150	莱特光电股份	11,042,507.91	4.26
50	600478	科力远	10,993,521.00	4.24
51	300409	道氏技术	10,989,204.01	4.24
52	301510	固高科技	10,909,635.00	4.21
53	300811	铂科新材	10,846,720.69	4.18
54	002245	蔚蓝锂芯	10,828,574.00	4.18
55	300438	鹏辉能源	10,818,075.00	4.17
56	600475	华光环能	10,709,633.00	4.13
57	300870	欧陆通	10,709,319.00	4.13
58	000061	农产品	10,695,261.00	4.13
59	600850	电科数字	10,557,436.00	4.07
60	002125	湘潭电化	10,489,030.00	4.05
61	603667	五洲新春	10,433,635.08	4.02
62	002048	宁波华翔	10,416,674.00	4.02
63	002755	奥赛康	10,323,098.00	3.98
64	300101	振芯科技	10,264,118.00	3.96
65	002320	海峡股份	10,147,486.00	3.91
66	603876	鼎胜新材	10,095,329.00	3.89
67	605123	派克新材	10,092,676.00	3.89
68	002204	大连重工	10,009,937.00	3.86
69	688629	四川华丰科技	9,958,791.13	3.84
70	600320	振华重工	9,948,611.00	3.84
71	600577	精达股份	9,905,126.00	3.82
72	002987	京北方	9,854,813.00	3.80
73	688018	乐鑫科技	9,800,799.91	3.78
74	002706	良信股份	9,776,268.70	3.77
75	301316	慧博云通	9,769,051.00	3.77
76	688403	汇成股份	9,655,140.40	3.72
77	601778	晶科科技	9,639,063.00	3.72
78	603103	横店影视	9,570,837.00	3.69
79	300953	震裕科技	9,555,214.00	3.69
80	301069	凯盛新材	9,535,337.00	3.68
81	002222	福晶科技	9,517,730.00	3.67
82	301171	易点天下	9,457,387.56	3.65
83	000555	神州信息	9,344,048.00	3.60
84	601890	亚星锚链	9,209,982.00	3.55
85	603678	火炬电子	9,181,210.00	3.54
86	601126	四方股份	9,161,429.00	3.53
87	688206	概伦电子	9,158,649.19	3.53
88	300327	中颖电子	9,145,142.82	3.53

89	605376	博迁新材	9,097,464.00	3.51
90	600996	贵广网络	9,053,580.00	3.49
91	600507	方大特钢	9,025,241.00	3.48
92	301526	国际复材	9,008,547.00	3.47
93	600301	华锡有色	8,985,159.00	3.47
94	601975	招商南油	8,920,710.00	3.44
95	002913	奥士康	8,916,961.00	3.44
96	000813	德展健康	8,877,371.00	3.42
97	600618	氯碱化工	8,856,418.00	3.42
98	688484	南芯科技	8,788,719.01	3.39
99	300776	帝尔激光	8,780,521.00	3.39
100	301232	飞沃科技	8,755,704.00	3.38
101	002612	朗姿股份	8,751,628.00	3.38
102	300548	长芯博创	8,684,325.00	3.35
103	603236	移远通信	8,626,002.00	3.33
104	300568	星源材质	8,578,702.00	3.31
105	300777	中简科技	8,414,980.00	3.25
106	002925	盈趣科技	8,405,056.00	3.24
107	603267	鸿远电子	8,400,257.36	3.24
108	002020	京新药业	8,398,416.00	3.24
109	300428	立中集团	8,386,651.04	3.23
110	603613	国联股份	8,307,012.00	3.20
111	000422	湖北宜化	8,261,119.00	3.19
112	300170	汉得信息	8,243,467.00	3.18
113	300726	宏达电子	8,210,033.00	3.17
114	000686	东北证券	8,185,821.71	3.16
115	300260	新莱应材	8,153,553.00	3.14
116	002373	千方科技	8,117,345.00	3.13
117	601020	华钰矿业	8,068,356.20	3.11
118	688362	甬矽电子	8,059,651.50	3.11
119	300226	上海钢联	8,050,224.00	3.10
120	300034	钢研高纳	7,989,443.60	3.08
121	000019	深粮控股	7,983,482.00	3.08
122	300036	超图软件	7,911,623.00	3.05
123	002967	广电计量	7,868,781.00	3.03
124	603026	石大胜华	7,856,455.00	3.03
125	002249	大洋电机	7,854,809.00	3.03
126	000657	中钨高新	7,831,458.30	3.02
127	688141	杰华特微 电子	7,831,270.87	3.02
128	688062	迈威生物	7,807,815.61	3.01
129	002378	章源钨业	7,746,062.00	2.99
130	002545	东方铁塔	7,744,276.00	2.99

131	002182	宝武镁业	7,693,171.00	2.97
132	301338	凯格精机	7,669,764.40	2.96
133	600416	湘电股份	7,635,072.00	2.94
134	002698	博实股份	7,590,024.00	2.93
135	603662	柯力传感	7,572,212.00	2.92
136	002023	海特高新	7,471,244.00	2.88
137	600728	佳都科技	7,453,599.00	2.87
138	002544	普天科技	7,432,053.00	2.87
139	002815	崇达技术	7,421,157.00	2.86
140	300747	锐科激光	7,397,514.00	2.85
141	000901	航天科技	7,354,312.00	2.84
142	300666	江丰电子	7,343,386.00	2.83
143	002006	精工科技	7,327,569.29	2.83
144	688001	苏州华兴 源创科技	7,324,812.78	2.83
145	300323	华灿光电	7,319,543.00	2.82
146	300443	金雷股份	7,283,583.27	2.81
147	002315	焦点科技	7,260,334.00	2.80
148	688123	聚辰半导 体	7,202,717.24	2.78
149	688567	孚能科技	7,147,113.98	2.76
150	002163	海南发展	7,079,533.00	2.73
151	688300	联瑞新材	7,054,896.57	2.72
152	601138	工业富联	7,031,953.00	2.71
153	000681	视觉中国	7,004,524.00	2.70
154	688256	寒武纪科 技	6,986,051.55	2.69
155	300416	苏试试验	6,976,044.00	2.69
156	002626	金达威	6,961,896.00	2.69
157	300456	赛微电子	6,942,003.00	2.68
158	688006	浙江杭可 科技	6,931,028.32	2.67
159	300618	寒锐钴业	6,884,916.85	2.66
160	688116	天奈科技	6,868,548.16	2.65
161	603327	福蓉科技	6,867,728.00	2.65
162	600761	安徽合力	6,859,548.00	2.65
163	300134	大富科技	6,836,676.00	2.64
164	002516	旷达科技	6,781,742.00	2.62
165	600477	杭萧钢构	6,780,552.00	2.62
166	300068	南都电源	6,776,057.00	2.61
167	600114	东睦股份	6,748,736.00	2.60
168	603663	三祥新材	6,741,127.00	2.60
169	605020	永和股份	6,731,357.00	2.60

170	688800	瑞可达连接系统	6,720,751.89	2.59
171	002036	联创电子	6,718,489.00	2.59
172	688333	西安铂力特	6,665,216.70	2.57
173	300319	麦捷科技	6,655,863.00	2.57
174	688208	道通科技	6,620,087.63	2.55
175	688127	蓝特光学	6,593,778.98	2.54
176	300475	香农芯创	6,580,610.00	2.54
177	601069	西部黄金	6,565,474.00	2.53
178	002487	大金重工	6,562,360.00	2.53
179	000065	北方国际	6,551,358.00	2.53
180	301215	中汽股份	6,539,497.00	2.52
181	600158	中体产业	6,531,534.00	2.52
182	603505	金石资源	6,527,471.20	2.52
183	600645	中源协和	6,501,497.00	2.51
184	600550	保变电气	6,472,553.00	2.50
185	600490	鹏欣资源	6,472,206.00	2.50
186	603118	共进股份	6,457,366.00	2.49
187	601068	中铝国际	6,443,567.00	2.49
188	605168	三人行	6,441,150.00	2.48
189	002851	麦格米特	6,435,755.00	2.48
190	601678	滨化股份	6,434,457.00	2.48
191	600201	生物股份	6,413,138.00	2.47
192	300725	药石科技	6,407,988.20	2.47
193	301219	腾远钴业	6,392,218.00	2.47
194	600267	海正药业	6,356,043.00	2.45
195	601360	三六零	6,311,951.00	2.43
196	300185	通裕重工	6,290,231.00	2.43
197	002511	中顺洁柔	6,217,304.00	2.40
198	603259	药明康德	6,208,760.00	2.39
199	603256	宏和科技	6,183,931.00	2.39
200	600986	浙文互联	6,165,011.59	2.38
201	300129	泰胜风能	6,159,526.00	2.38
202	600063	皖维高新	6,108,028.00	2.36
203	600057	厦门象屿	6,099,177.00	2.35
204	000059	华锦股份	6,098,463.00	2.35
205	300925	法本信息	6,067,128.00	2.34
206	600409	三友化工	6,057,877.00	2.34
207	000735	罗牛山	6,048,910.00	2.33
208	002335	科华数据	6,040,691.00	2.33
209	301377	鼎泰高科	6,033,525.00	2.33
210	002993	奥海科技	6,029,706.40	2.33

211	000762	西藏矿业	6,005,529.00	2.32
212	600100	同方股份	5,999,877.00	2.31
213	002219	新里程	5,992,319.00	2.31
214	688779	五矿新能	5,985,244.37	2.31
215	002498	汉缆股份	5,980,160.81	2.31
216	603308	应流股份	5,964,170.80	2.30
217	002539	云图控股	5,929,235.00	2.29
218	688209	英集芯科技	5,919,314.66	2.28
219	000581	威孚高科	5,902,526.00	2.28
220	300119	瑞普生物	5,902,162.00	2.28
221	600782	新钢股份	5,886,461.00	2.27
222	600330	天通股份	5,854,117.00	2.26
223	688158	优刻得科技	5,853,224.50	2.26
224	600058	五矿发展	5,846,559.28	2.25
225	002434	万里扬	5,844,321.00	2.25
226	002745	木林森	5,828,100.00	2.25
227	002099	海翔药业	5,790,716.00	2.23
228	000990	诚志股份	5,784,780.00	2.23
229	688007	光峰科技	5,778,742.76	2.23
230	601908	京运通	5,776,816.00	2.23
231	300598	诚迈科技	5,762,796.00	2.22
232	600807	济高发展	5,754,044.70	2.22
233	600643	爱建集团	5,739,353.00	2.21
234	600783	鲁信创投	5,714,117.00	2.20
235	603920	世运电路	5,630,920.00	2.17
236	300083	创世纪	5,598,925.00	2.16
237	603986	兆易创新	5,589,601.00	2.16
238	600726	华电能源	5,563,214.00	2.15
239	600604	市北高新	5,558,328.00	2.14
240	600552	凯盛科技	5,543,655.00	2.14
241	300655	晶瑞电材	5,524,288.00	2.13
242	000923	河钢资源	5,500,565.00	2.12
243	603169	兰石重装	5,488,728.00	2.12
244	300102	乾照光电	5,443,585.00	2.10
245	001311	多利科技	5,439,610.06	2.10
246	002110	三钢闽光	5,418,540.00	2.09
247	688584	上海合晶硅材料	5,406,531.89	2.09
248	000987	越秀资本	5,396,294.00	2.08
249	601369	陕鼓动力	5,395,075.00	2.08
250	600860	京城股份	5,362,328.00	2.07

251	002489	浙江永强	5,351,870.00	2.06
252	000049	德赛电池	5,344,109.00	2.06
253	002824	和胜股份	5,343,205.20	2.06
254	600428	中远海特	5,327,814.00	2.05
255	002399	海普瑞	5,315,357.00	2.05
256	300085	银之杰	5,292,651.00	2.04
257	600361	创新新材	5,282,772.00	2.04
258	603915	国茂股份	5,270,704.00	2.03
259	300171	东富龙	5,263,925.00	2.03
260	600868	梅雁吉祥	5,261,024.00	2.03
261	002414	高德红外	5,234,171.00	2.02
262	000969	安泰科技	5,232,262.00	2.02
263	002100	天康生物	5,225,421.00	2.02
264	600252	中恒集团	5,214,186.00	2.01
265	002426	胜利精密	5,191,312.00	2.00
266	300648	星云股份	5,186,435.00	2.00

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	001203	大中矿业	20,498,627.00	7.91
2	600601	方正科技	19,394,147.00	7.48
3	301511	德福科技	18,440,292.45	7.11
4	688498	源杰科技	18,309,158.02	7.06
5	300672	国科微	17,939,874.00	6.92
6	688270	浙江臻镭科技股份	17,540,512.76	6.77
7	000917	电广传媒	17,372,493.00	6.70
8	688048	长光华芯	16,557,695.42	6.39
9	688166	博瑞生物医药	16,514,740.91	6.37
10	600759	洲际油气	16,177,688.00	6.24
11	603083	剑桥科技	16,109,690.00	6.21
12	300593	新雷能	16,000,435.38	6.17
13	002126	银轮股份	15,969,591.00	6.16
14	002326	永太科技	14,609,211.00	5.63
15	300570	太辰光	14,307,048.00	5.52
16	301217	铜冠铜箔	14,279,568.00	5.51

17	001309	德明利	13,752,842.00	5.30
18	601519	大智慧	13,621,442.00	5.25
19	601869	长飞光纤	13,560,985.00	5.23
20	603171	税友股份	13,420,937.00	5.18
21	600877	电科芯片	13,366,476.00	5.16
22	688262	苏州国芯科技	13,041,416.21	5.03
23	002428	云南锗业	12,823,842.00	4.95
24	688372	伟测科技	12,775,089.16	4.93
25	688343	云天励飞股份	12,462,714.43	4.81
26	002204	大连重工	12,294,778.89	4.74
27	300972	万辰集团	12,285,797.00	4.74
28	300624	万兴科技	12,255,289.00	4.73
29	688347	华虹半导体公司	12,155,050.91	4.69
30	000061	农产品	12,070,548.00	4.66
31	002484	江海股份	12,060,841.00	4.65
32	300682	朗新集团	11,922,608.00	4.60
33	300620	光库科技	11,900,548.00	4.59
34	002048	宁波华翔	11,676,902.00	4.50
35	300101	振芯科技	11,528,563.00	4.45
36	002320	海峡股份	11,352,984.00	4.38
37	301510	固高科技	11,284,639.00	4.35
38	688206	概伦电子	10,975,194.09	4.23
39	600475	华光环能	10,844,631.00	4.18
40	603533	掌阅科技	10,817,066.00	4.17
41	000603	盛达资源	10,783,173.00	4.16
42	603667	五洲新春	10,744,161.76	4.14
43	688018	乐鑫科技	10,737,552.11	4.14
44	301069	凯盛新材	10,714,368.00	4.13
45	300870	欧陆通	10,714,140.00	4.13
46	603236	移远通信	10,634,520.40	4.10
47	002174	游族网络	10,630,873.00	4.10
48	688403	汇成股份	10,614,199.98	4.09
49	002314	南山控股	10,562,120.00	4.07
50	603063	禾望电气	10,541,226.00	4.07
51	605123	派克新材	10,435,064.00	4.02
52	300548	长芯博创	10,368,840.00	4.00
53	300244	迪安诊断	10,324,200.00	3.98
54	300779	惠城环保	10,259,648.00	3.96
55	600728	佳都科技	10,256,151.99	3.96
56	688629	四川华丰	10,240,352.76	3.95

		科技		
57	600301	华锡有色	10,237,240.00	3.95
58	002378	章源钨业	10,100,730.66	3.90
59	301171	易点天下	10,063,893.12	3.88
60	601126	四方股份	9,804,242.00	3.78
61	002249	大洋电机	9,737,693.00	3.76
62	301232	飞沃科技	9,642,004.65	3.72
63	000657	中钨高新	9,611,034.00	3.71
64	002545	东方铁塔	9,441,201.00	3.64
65	600996	贵广网络	9,426,946.00	3.64
66	300726	宏达电子	9,396,922.00	3.62
67	002020	京新药业	9,392,925.00	3.62
68	300327	中颖电子	9,290,453.84	3.58
69	300034	钢研高纳	9,271,819.00	3.58
70	300666	江丰电子	9,258,296.00	3.57
71	603026	石大胜华	9,256,701.00	3.57
72	301316	慧博云通	9,175,213.00	3.54
73	002706	良信股份	9,078,297.00	3.50
74	688150	莱特光电 股份	9,049,315.76	3.49
75	300568	星源材质	8,989,236.00	3.47
76	601020	华钰矿业	8,922,491.80	3.44
77	002925	盈趣科技	8,798,577.00	3.39
78	300775	三角防务	8,756,823.00	3.38
79	603678	火炬电子	8,662,533.00	3.34
80	603267	鸿远电子	8,503,945.00	3.28
81	688362	甬矽电子	8,413,132.51	3.24
82	000813	德展健康	8,392,068.00	3.24
83	688208	道通科技	8,382,995.26	3.23
84	300260	新莱应材	8,336,089.00	3.22
85	000901	航天科技	8,274,042.99	3.19
86	300170	汉得信息	8,224,409.40	3.17
87	603119	浙江荣泰 股份	8,119,964.84	3.13
88	300602	飞荣达	8,105,694.21	3.13
89	688006	浙江杭可 科技	8,031,692.45	3.10
90	002544	普天科技	8,004,722.10	3.09
91	603613	国联股份	7,986,795.00	3.08
92	600618	氯碱化工	7,968,079.00	3.07
93	688567	孚能科技	7,878,315.03	3.04
94	300438	鹏辉能源	7,867,323.50	3.03
95	603306	华懋科技	7,849,851.05	3.03

96	600267	海正药业	7,808,798.00	3.01
97	300036	超图软件	7,782,933.00	3.00
98	601975	招商南油	7,777,728.00	3.00
99	000612	焦作万方	7,645,347.00	2.95
100	603662	柯力传感	7,604,821.00	2.93
101	300456	赛微电子	7,572,272.00	2.92
102	002755	奥赛康	7,528,645.00	2.90
103	600550	保变电气	7,448,680.00	2.87
104	300226	上海钢联	7,414,799.00	2.86
105	000681	视觉中国	7,364,734.00	2.84
106	600201	生物股份	7,350,166.86	2.83
107	601208	东材科技	7,342,430.70	2.83
108	600416	湘电股份	7,330,801.54	2.83
109	002163	海南发展	7,308,723.00	2.82
110	000811	冰轮环境	7,285,707.00	2.81
111	688333	西安铂力特	7,256,321.10	2.80
112	600850	电科数字	7,222,544.62	2.79
113	002987	京北方	7,210,439.12	2.78
114	300475	香农芯创	7,188,129.00	2.77
115	600577	精达股份	7,171,248.00	2.77
116	688141	杰华特微电子	7,166,461.05	2.76
117	002125	湘潭电化	7,161,508.00	2.76
118	600478	科力远	7,158,573.00	2.76
119	300598	诚迈科技	7,154,389.50	2.76
120	600320	振华重工	7,152,872.00	2.76
121	002151	北斗星通	7,142,355.16	2.75
122	688536	思瑞浦股份	7,121,276.38	2.75
123	002851	麦格米特	6,986,836.10	2.69
124	601069	西部黄金	6,978,101.00	2.69
125	600783	鲁信创投	6,916,551.56	2.67
126	000735	罗牛山	6,884,545.00	2.66
127	603169	兰石重装	6,876,481.00	2.65
128	300035	中科电气	6,788,441.55	2.62
129	688116	天奈科技	6,774,000.13	2.61
130	000762	西藏矿业	6,768,445.00	2.61
131	603876	鼎胜新材	6,756,312.00	2.61
132	600477	杭萧钢构	6,701,205.00	2.58
133	002036	联创电子	6,682,017.00	2.58
134	300618	寒锐钴业	6,681,419.21	2.58
135	300725	药石科技	6,679,222.80	2.58

136	300811	铂科新材	6,613,682.20	2.55
137	688256	寒武纪科技	6,600,011.46	2.55
138	688779	五矿新能	6,589,333.79	2.54
139	002396	星网锐捷	6,560,701.00	2.53
140	600645	中源协和	6,555,519.50	2.53
141	600330	天通股份	6,520,157.00	2.51
142	300068	南都电源	6,498,235.00	2.51
143	300119	瑞普生物	6,459,357.00	2.49
144	600643	爱建集团	6,432,967.00	2.48
145	300129	泰胜风能	6,403,589.00	2.47
146	001311	多利科技	6,376,918.38	2.46
147	301095	广立微	6,363,303.00	2.45
148	300083	创世纪	6,345,933.00	2.45
149	600633	浙数文化	6,318,920.00	2.44
150	603986	兆易创新	6,311,343.00	2.43
151	600428	中远海特	6,289,660.00	2.43
152	301377	鼎泰高科	6,265,019.00	2.42
153	601360	三六零	6,217,863.00	2.40
154	002434	万里扬	6,175,864.00	2.38
155	300409	道氏技术	6,175,165.89	2.38
156	600807	济高发展	6,170,412.00	2.38
157	603308	应流股份	6,140,725.10	2.37
158	300747	锐科激光	6,138,372.60	2.37
159	300236	上海新阳	6,096,514.00	2.35
160	000881	中广核技	6,095,851.00	2.35
161	605168	三人行	6,087,973.87	2.35
162	000718	苏宁环球	6,031,784.00	2.33
163	600776	东方通信	6,001,172.00	2.31
164	300648	星云股份	5,985,171.00	2.31
165	600869	远东股份	5,977,083.00	2.31
166	688007	光峰科技	5,970,887.13	2.30
167	688131	皓元医药	5,965,830.74	2.30
168	002222	福晶科技	5,895,064.40	2.27
169	688523	航天环宇科技	5,881,702.86	2.27
170	002219	新里程	5,874,959.00	2.27
171	600868	梅雁吉祥	5,866,377.00	2.26
172	600246	万通发展	5,841,448.00	2.25
173	603103	横店影视	5,839,230.40	2.25
174	002335	科华数据	5,814,729.78	2.24
175	300821	东岳硅材	5,790,112.00	2.23
176	600986	浙文互联	5,786,085.00	2.23

177	000969	安泰科技	5,721,130.00	2.21
178	300113	顺网科技	5,681,282.00	2.19
179	601908	京运通	5,667,010.00	2.19
180	603920	世运电路	5,663,242.00	2.18
181	300085	银之杰	5,641,312.00	2.18
182	300102	乾照光电	5,636,541.00	2.17
183	002315	焦点科技	5,612,850.00	2.16
184	688596	正帆科技	5,612,831.78	2.16
185	300655	晶瑞电材	5,604,580.00	2.16
186	301207	华兰疫苗	5,600,795.00	2.16
187	600114	东睦股份	5,552,519.00	2.14
188	600094	大名城	5,541,205.00	2.14
189	300925	法本信息	5,536,708.00	2.14
190	688432	有研硅	5,495,562.97	2.12
191	002245	蔚蓝锂芯	5,468,958.00	2.11
192	002913	奥士康	5,443,214.00	2.10
193	603305	旭升集团	5,441,761.00	2.10
194	300253	卫宁健康	5,432,358.00	2.10
195	600667	太极实业	5,427,738.00	2.09
196	002226	江南化工	5,420,653.00	2.09
197	300776	帝尔激光	5,418,379.00	2.09
198	601778	晶科科技	5,408,703.00	2.09
199	688981	中芯国际	5,406,801.70	2.09
200	600604	市北高新	5,381,892.00	2.08
201	000019	深粮控股	5,322,456.05	2.05
202	601890	亚星锚链	5,284,845.00	2.04
203	300049	福瑞医科	5,257,566.00	2.03
204	002497	雅化集团	5,244,352.00	2.02
205	601137	博威合金	5,239,846.50	2.02
206	603013	亚普股份	5,230,871.00	2.02
207	600458	时代新材	5,230,267.00	2.02
208	000950	重药控股	5,210,603.00	2.01
209	603567	珍宝岛	5,201,740.00	2.01

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,871,889,733.92
卖出股票收入（成交）总额	4,224,696,301.46

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,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,以降低交易成本和组合风险,提高投资效率。

基金管理人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。

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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,652,321.83
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,874,547.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,526,869.14

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
汇添富中证 1000 指数	16,845	21,958.17	182,935,496.89	49.46	186,949,801.88	50.54

增强 A						
汇添富中证 1000 指数增强 C	63,268	6,272.11	159,344,968.39	40.16	237,479,181.26	59.84
合计	80,113	9,570.35	342,280,465.28	44.64	424,428,983.14	55.36

9.2 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 1000 指数增强 A	1,933,046.22	0.52
	汇添富中证 1000 指数增强 C	61,859.24	0.02
	合计	1,994,905.46	0.26

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证 1000 指数增强 A	50~100
	汇添富中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 1000 指数增强 A	10~50
	汇添富中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 1000 指数增强 A	汇添富中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 05 月 19 日) 基金份额总额	209,388,299.59	255,898,055.91
本报告期期初基金份 额总额	169,861,789.85	77,435,507.18
本报告期基金总申购 份额	549,189,742.37	771,407,559.07
减: 本报告期基金总 赎回份额	349,166,233.45	452,018,916.60
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	369,885,298.77	396,824,149.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2023 年 05 月 19 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 45,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作、其他问题(基金销售等)
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题及整改要求，通过完善制度、优化管理等完成相关问题整改并已通过监管检查验收。公司将从严加强内控及各业务管理，持续提升管理质效。
其他	无

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2；高级管理人员 3
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日；2025 年 11 月 11 日； 2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海证监局；中国证监会上海证监局； 中国证监会上海证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施；行政监管措施；行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函；出具警示函；出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作；其他问题(基金销售)； 合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金管理公司管理办法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》；《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题及整改要求，通过完善制度、优化管理等完成相关问题整改并已通过监管检查验收。公司将从严加强内控及各业务管理，持续提升管理质效。
其他	无

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国投证券	2	2,467,756,697.39	27.13	434,086.67	27.13	
平安	1	2,462,594,132.91	27.08	433,185.20	27.08	

证券						
申万宏源证券	3	1,484,063,477.88	16.32	261,034.15	16.32	
中信证券	5	1,129,228,317.38	12.42	198,637.02	12.42	
中信建投证券	4	627,783,230.86	6.90	110,427.16	6.90	
华泰证券	4	418,570,029.59	4.60	73,629.31	4.60	
招商证券	4	408,510,678.12	4.49	71,854.47	4.49	
国泰海通	6	96,365,812.16	1.06	16,951.26	1.06	
财通证券	2	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
大和证券	2	-	-	-	-	
东北证券	1	-	-	-	-	
东方证券	2	-	-	-	-	
东吴证券	3	-	-	-	-	
方正证券	2	-	-	-	-	
广发证券	3	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国联民生	2	-	-	-	-	
华安证券	1	-	-	-	-	
华西证券	2	-	-	-	-	
华兴证券	2	-	-	-	-	
摩根大通证券	2	-	-	-	-	

上海 证券	2	-	-	-	-	
太平 洋证 券	1	-	-	-	-	
天风 证券	2	-	-	-	-	
西部 证券	2	-	-	-	-	
野村 东方 国际	2	-	-	-	-	
银河 证券	2	-	-	-	-	
粤开 证券	1	-	-	-	-	
浙商 证券	1	-	-	-	-	
中金 财富	2	-	-	-	-	
中泰 证券	2	-	-	-	-	
中邮 证券	2	-	-	-	-	

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商 名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交 金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例 (%)	成交 金额	占当期 权证成 交总额 的比例 (%)	成交 金额	占当期 基金成 交总额 的比例 (%)
国投 证券	3,000,960.00	38.22	-	-	-	-	-	-
平安 证券	250,867.50	3.19	-	-	-	-	-	-
申万	4,600,206.00	58.59	-	-	-	-	-	-

宏源 证券								
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 海通	-	-	-	-	-	-	-	-
财通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大和 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 民生	-	-	-	-	-	-	-	-
华安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根 大通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 8 家证券公司的 16 个交易单元：招商证券（深交所单元，上交所单元）、华泰证券（上交所单元，深交所单元）、银河证券（深交所单元，上交所单元）、中金财富（深交所单元，上交所单元）、国泰海通（深交所单元，上交所单元）、广发证券（深交所单元，上交所单元）、中信证券（上交所单元，深交所单元）、华西证券（上交所单元，深交所单元）；不再租用 3 家证券公司的 5 个交易单元：川财证券（上交所单元，深交所单元）、平安证券（上交所单元）、开源证券（上交所单元，深交所单元）。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 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
4	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
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	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 05 月 23 日
6	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 05 月 23 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
9	汇添富基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	深交所, 上交所, 上证报, 中国证监会基	2025 年 07 月 15 日

		金电子披露网站, 公司网站	
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025 年 07 月 21 日
11	关于汇添富基金管理股份有限公司住所变更的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025 年 07 月 29 日
12	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上证报	2025 年 08 月 07 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上交所, 上证报	2025 年 08 月 26 日
14	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025 年 08 月 29 日
15	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025 年 10 月 28 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于设立汇添富基金销售(上海)有限公司的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025 年 12 月 24 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		时间 区间					
机构	1	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 2 月 18 日	56,706,408.09	-	19,500,000.00	37,206,408.09	4.85
产品持有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 1000 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 1000 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。

13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

13.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2026 年 03 月 31 日