

汇添富上证综合指数证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	14
§ 4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	23
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	23
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	26
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	26
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	27
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	28
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	28
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	29
§ 5 托管人报告	29
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	29
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	29
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	29
§ 6 审计报告	29
6.1 审计报告的基本信息	30
6.2 审计报告的基本内容	30
§ 7 年度财务报表	31
7.1 资产负债表	31
7.2 利润表	33
7.3 净资产变动表	34
7.4 报表附注	36
§ 8 投资组合报告	73
8.1 期末基金资产组合情况	73

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	74
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.....	75
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	101
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.....	103
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.....	103
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	103
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	103
8.12 投资组合报告附注.....	103
§ 9 基金份额持有人信息.....	104
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	104
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	105
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.....	105
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.....	105
§ 10 开放式基金份额变动.....	105
§ 11 重大事件揭示.....	106
11.1 基金份额持有人大会决议.....	106
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.....	106
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.....	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	108
11.8 其他重大事件.....	112
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	114
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.....	114
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.....	114
13.3 查阅方式.....	114

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合指数证券投资基金		
基金简称	汇添富上证综合指数		
基金主代码	470007		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2009 年 07 月 01 日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额（份）	795,503,108.25		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y
下属分级基金的交易代码	470007	018536	025883
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	748,722,186.10	46,751,625.08	29,297.07

注：本基金于 2025 年 10 月 31 日新增汇添富上证综合指数 Y 类份额。

2.2 基金产品说明

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

	抽样股票组合构建、股票组合调整、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	上证综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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	2025 年	2024 年	2023 年
---------------------	--------	--------	--------

数据和指标									
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y
本期已实现收益	127,861,508.53	8,680,418.35	1,380.80	36,411,182.92	2,869,888.56	-	18,753,767.93	-21,414.55	-
本期利润	157,960,148.19	10,565,065.30	395.66	142,318,036.78	15,410,113.11	-	-6,745,777.44	-801,072.58	-
加权平均基金份额本期利润	0.1949	0.1757	0.0537	0.1587	0.2516	-	-0.0086	-0.0704	-
本期加权平均	16.80%	15.30%	4.24%	15.43%	24.42%	-	-0.83%	-6.99%	-

净值利润率									
本期基金份额净值增长率	18.59%	18.06%	0.16%	15.17%	14.59%	-	-0.86%	-6.92%	-
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	206,446,529.61	12,318,800.82	8,099.07	115,131,445.12	10,313,499.78	-	-15,270,831.67	-552,687.11	-
期末可供分配基金份额利	0.2757	0.2635	0.2764	0.1310	0.1231	-	-0.0176	-0.0204	-

润									
期末基金资产净值	955,168,715.71	59,070,425.90	37,396.14	993,786,347.91	94,115,941.93	-	850,204,039.13	26,596,747.15	-
期末基金份额净值	1.276	1.263	1.276	1.131	1.123	-	0.982	0.980	-
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	79.57%	25.93%	0.16%	51.42%	6.66%	-	31.47%	-6.92%	-

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富上证综合指数 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去三个月	2.49%	0.66%	2.12%	0.70%	0.37%	-0.04%
过去六个月	14.69%	0.62%	14.44%	0.67%	0.25%	-0.05%
过去一年	18.59%	0.78%	17.49%	0.81%	1.10%	-0.03%
过去三年	35.41%	0.90%	27.15%	0.92%	8.26%	-0.02%
过去五年	23.33%	0.92%	13.94%	0.94%	9.39%	-0.02%
自基金合同生效起至今	79.57%	1.22%	34.67%	1.21%	44.90%	0.01%
汇添富上证综合指数 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
过去三个月	2.35%	0.66%	2.12%	0.70%	0.23%	-0.04%
过去六个月	14.45%	0.62%	14.44%	0.67%	0.01%	-0.05%
过去一年	18.06%	0.78%	17.49%	0.81%	0.57%	-0.03%
自基金合同生效起至今	25.93%	0.92%	19.97%	0.95%	5.96%	-0.03%
汇添富上证综合指数 Y						
阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较基	业绩比较	① - ③	② - ④

	长率①	增长率标准 差②	准收益率③	基准收益 率标准 差④		
自基金 合同生 效起至 今	0.16%	0.59%	0.34%	0.62%	-0.18%	-0.03%

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

汇添富上证综合指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数Y累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



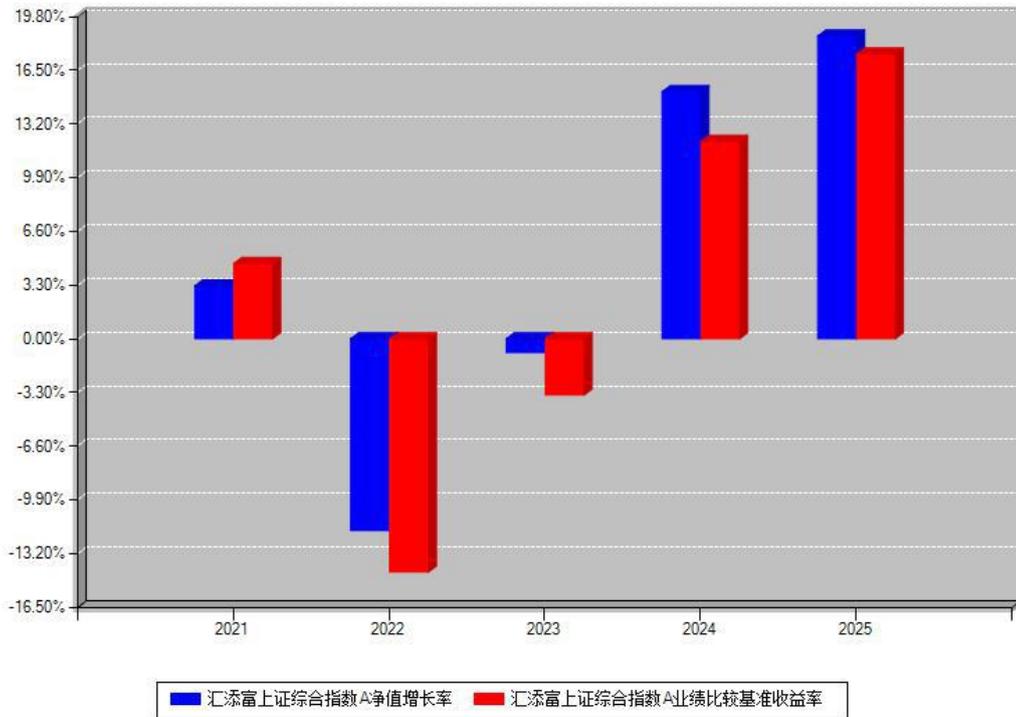
注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2009年07月01日）起3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

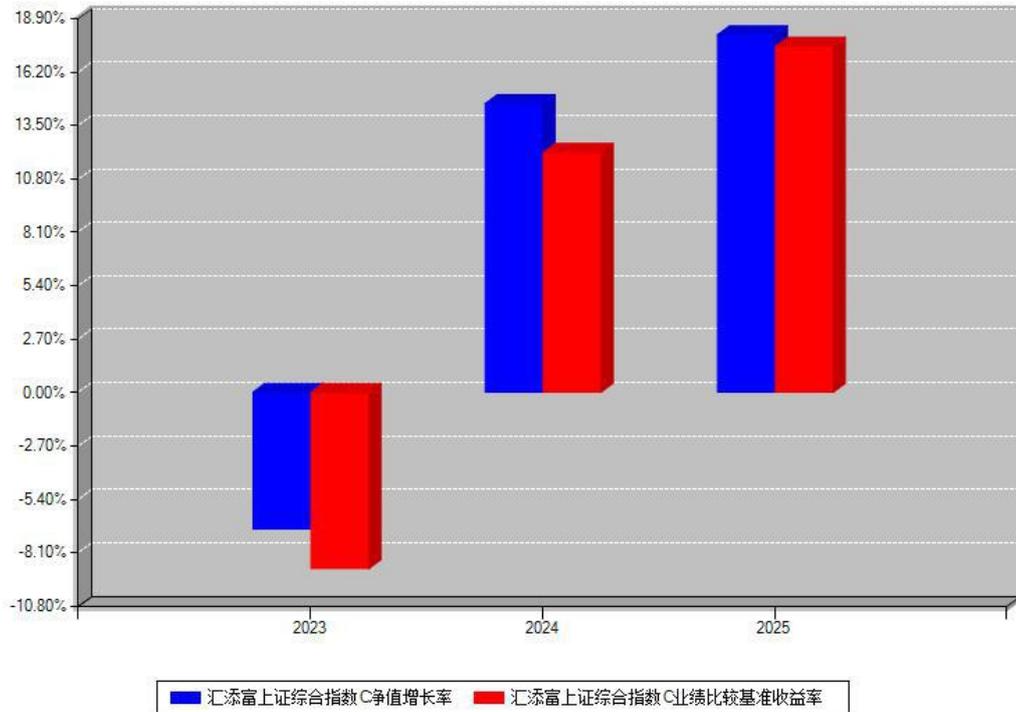
本基金于 2023 年 05 月 19 日新增 C 类份额，于 2025 年 10 月 31 日新增 Y 类份额。

3.2.3 过去五年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

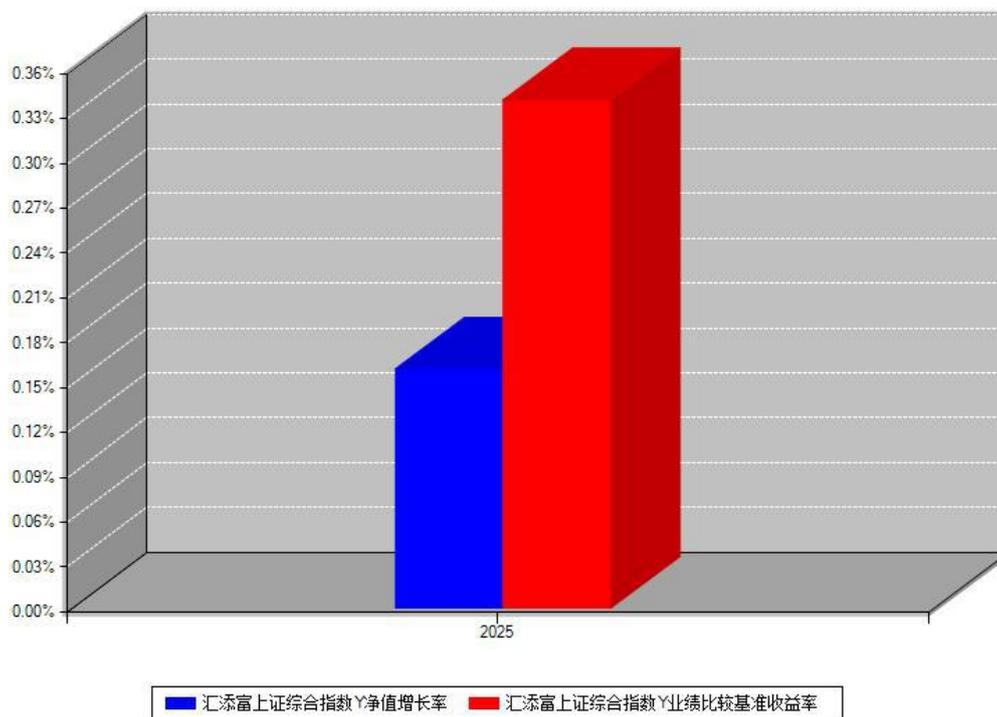
汇添富上证综合指数A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数C每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数Y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 2009 年 07 月 01 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

单位：人民币元

汇添富上证综合指数 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.550	27,453,757.84	19,131,314.22	46,585,072.06	-
2024 年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2023 年	0.110	4,919,315.31	3,540,513.70	8,459,829.01	-
合计	0.660	32,373,073.15	22,671,827.92	55,044,901.07	-
汇添富上证综合指数 C					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.530	3,362,514.43	324,754.44	3,687,268.87	-
2024 年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2023 年	0.110	15,367.47	239.65	15,607.12	-
合计	0.640	3,377,881.90	324,994.09	3,702,875.99	-
汇添富上证综合指数 Y					

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2024年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2023年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
合计	0.000	0.00	0.00	0.00	-

§ 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		
吴振翔	本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监	2010 年 02 月 06 日	-	19	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从

				<p>业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010年2月6日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资</p>
--	--	--	--	--

				<p>资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12</p>
--	--	--	--	--

				<p>月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 8 月 10 日至 2025 年 10 月 30 日任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式</p>
--	--	--	--	---

				<p>指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至 2025 年 11 月 10 日任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回</p>
--	--	--	--	--

					<p>报债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 22 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳丰回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 10 日至 2024 年 12 月 11 日任汇添富中证 A500 指数型证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 3 月 27 日至今任汇添富中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月 31 日至今任汇添富中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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:吴振翔—离任产品类型:公募基金,离任数量:3只,离任时间:2025年3月21日、2025年10月30日、2025年11月10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,原则上兼任组合同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),公司对兼任组合同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同的收益率差异、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

外部环境方面，2025 年的主要影响因素集中在关税政策变化和地缘冲突上。4 月初，美国宣布对其贸易伙伴征收对等关税，我们国家也做出了有力回应，上调了美国进口商品的关税，同时加强了稀土出口管制。当时资本市场对这次关税调整反应比较大，全球权益市场都出现了普遍下跌。5 月份，中美双方开展经贸会谈，取得了一定进展，彼此都大幅下调了关税，贸易争端得到了阶段性缓和。到 6 月份，市场风险偏好慢慢修复，但中东地缘冲突爆发，又给市场带来了新一轮冲击。9 月份，中美两国领导人进行了务实、积极且有建设性的电话沟通，对市场情绪起到了稳定作用。与此同时，美联储在 9 月下旬如期降息 25 个基点，将联邦基金目标利率下调至 4.00%-4.25%，这也是美联储 2025 年的首次降息，正式开启了降息周期，全球流动性预期得到改善。虽然美联储后续的降息节奏，还会受到美国经济数据、联储主席换届等不确定因素影响，但从当前市场数据来看，2026 年预计还会有 1-2 次降息，这会给全球流动性带来潜在改善空间，同时也为国内货币政策进一步宽松留出了余地。

政策层面，2025 年财政政策和货币政策始终协同发力，没有出现单一政策发力不足的情况。积极的财政政策和稳健的货币政策相互配合，为 A 股市场营造了较好的流动性环境，市场资金面整体宽松，有效支撑了市场的稳健运行，也缓解了部分行业和企业的经营压力。

上证综合指数是 A 股市场代表性宽基指数，本基金则是这一代表性指数的产品化形式，为投资者提供了整体配置国内权益资产的优质工具。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富上证综合指数 A 类份额净值增长率为 18.59%，同期业绩比较基准收益率为 17.49%。本报告期汇添富上证综合指数 C 类份额净值增长率为 18.06%，同期业绩比较基准收益率为 17.49%。本报告期内新增汇添富上证综合指数 Y 类份额，自实际有资产之日起至报告期末的份额净值增长率为 0.16%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。

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 年依然会是外部环境高度不确定的一年。地缘冲突越来越频繁，大国之间的竞争，大概率还会扩散到更多领域——从现在的人工智能、工业制造，进一步延伸到资源、太空等各个方面。不过我们也不用过于担心，我国在全球竞争中，有着独特的经济纵深优势，就像 2025 年那样，即便多次受到关税冲击，国内的制造业和出口依然保持了较强的韧性，后续还有充分的发展潜力。另外，随着“十五五”规划的开启，2026 年到 2030 年，是我国迈向远景目标的关键阶段，预计在战略规划和政策执行上，会保持足够的定力，能够较好地推进经济转型，逐步释放经济增长的潜力，这也会给 A 股市场提供长期的支撑。

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，本基金管理人所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：收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转帐或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额；本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次至少将可供分配利润的 20% 进行收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类基金份额、C 类基金份

额默认的收益分配方式是现金分红，Y 类基金份额默认的收益分配方式是红利再投资；在符合上述基金收益分配的前提下，每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20% 进行收益分配，且在收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）之后的 15 个工作日之内完成；基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内，本基金于 2025 年 01 月 14 日实施利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.270 元人民币；C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.270 元人民币；本基金于 2025 年 07 月 11 日实施利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.280 元人民币；C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.260 元人民币。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 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_B09 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	汇添富上证综合指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇添富上证综合指数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。</p> <p>我们认为，后附的汇添富上证综合指数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，公允反映了汇添富上证综合指数证券投资基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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，我们独立于汇添富上证综合指数证券投资基金，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。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富上证综合指数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上证综合指数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>

	治理层负责监督汇添富上证综合指数证券投资基金的财务报告过程。
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，就可能对汇添富上证综合指数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上证综合指数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：汇添富上证综合指数证券投资基金

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	53,477,433.10	54,044,331.25
结算备付金		249,427.95	1,859.97
存出保证金		62,134.29	73,619.75
交易性金融资产	7.4.7.2	962,229,296.62	1,031,789,612.90
其中：股票投资		962,229,296.62	1,025,944,595.37
基金投资		-	-
债券投资		-	5,845,017.53
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		2,615,238.57	4,815,780.73
应收股利		-	-
应收申购款		947,253.39	1,749,225.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,019,580,783.92	1,092,474,430.02
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		-	-
应付赎回款		4,199,078.29	3,493,375.11
应付管理人报酬		648,729.03	691,600.93
应付托管费		129,745.75	138,320.18
应付销售服务费		22,630.36	26,547.92
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	304,062.74	222,296.04
负债合计		5,304,246.17	4,572,140.18
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	795,503,108.25	962,457,344.94
未分配利润	7.4.7.9	218,773,429.50	125,444,944.90
净资产合计		1,014,276,537.75	1,087,902,289.84
负债和净资产总计		1,019,580,783.92	1,092,474,430.02

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 795,503,108.25 份。本基金下属汇添富上证综合指数 A 基金份额净值 1.276 元，基金份额总额 748,722,186.10 份；本基金下属汇添富上证综合指数 C 基金份额净值 1.263 元，基金份额总额 46,751,625.08 份；本基金下属汇添富上证综合指数 Y 基金份额净值 1.276 元，基金份额总额 29,297.07 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	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
一、营业总收入		178,059,784.53	167,037,487.11
1.利息收入		192,192.54	204,059.63
其中：存款利息收入	7.4.7.10	192,192.54	204,059.63
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）		145,364,425.44	47,663,380.46
其中：股票投资收益	7.4.7.11	116,254,594.80	17,719,603.61
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	46,190.14	29,791.06
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	-	-
股利收益	7.4.7.17	29,063,640.50	29,913,985.79
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“-”	7.4.7.18	31,982,301.47	118,447,078.41

号填列)			
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	520,865.08	722,968.61
减：二、营业总支出		9,534,175.38	9,309,337.22
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,569,814.85	7,399,897.10
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,513,962.82	1,479,979.42
3. 销售服务费		275,957.54	254,924.70
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		-	-
8. 其他费用	7.4.7.21	174,440.17	174,536.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		168,525,609.15	157,728,149.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		168,525,609.15	157,728,149.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		168,525,609.15	157,728,149.89

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 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	962,457,344.94	125,444,944.90	1,087,902,289.84
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	962,457,344.94	125,444,944.90	1,087,902,289.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-166,954,236.69	93,328,484.60	-73,625,752.09
(一)、综合收益总额	-	168,525,609.15	168,525,609.15
(二)、本期基金份额交易产生	-166,954,236.69	-24,924,783.62	-191,879,020.31

的净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)			
其中: 1.基金申 购款	581,667,688.47	96,736,093.64	678,403,782.11
2.基金赎回款	-748,621,925.16	-121,660,877.26	-870,282,802.42
(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)	-	-50,272,340.93	-50,272,340.93
四、本期期末净 资产	795,503,108.25	218,773,429.50	1,014,276,537.75
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	892,624,305.06	-15,823,518.78	876,800,786.28
加: 会计政策变 更	-	-	-
二、本期期初净 资产	892,624,305.06	-15,823,518.78	876,800,786.28
三、本期增减变 动额(减少以 “-”号填列)	69,833,039.88	141,268,463.68	211,101,503.56
(一)、综合收 益总额	-	157,728,149.89	157,728,149.89
(二)、本期基 金份额交易产生 的净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	69,833,039.88	-16,459,686.21	53,373,353.67
其中: 1.基金申 购款	1,009,627,068.66	35,676,934.98	1,045,304,003.64
2.基金赎回款	-939,794,028.78	-52,136,621.19	-991,930,649.97
(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	962,457,344.94	125,444,944.90	1,087,902,289.84

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：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富上证综合指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2009〕371号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》准予注册，由汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于2009年7月1日生效。首次设立基金募集规模为9,097,758,651.47份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2009）验字第60466941_B02号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

自2025年10月31日起，本基金增设Y类基金份额。

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、本基金同一类别内每一基金份额享有同等分配权；
- 2、收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转帐或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额；
- 3、本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次至少将可供分配利润的 20% 进行收益分配；
- 4、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 5、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红，Y 类基金份额默认的收益分配方式是红利再投资；
- 6、在符合上述基金收益分配的前提下，每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20% 进行收益分配，且在收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）之后的 15 个工作日之内完成；
- 7、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；
- 8、法律法规或监管机关另有规定的，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	53,477,433.10	54,044,331.25
等于：本金	53,470,647.99	54,038,250.02
加：应计利息	6,785.11	6,081.23
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	53,477,433.10	54,044,331.25

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	819,296,045.84	-	962,229,296.62	142,933,250.78
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	819,296,045.84	-	962,229,296.62	142,933,250.78
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	914,986,686.06	-	1,025,944,595.37	110,957,909.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	5,817,400.00	34,577.53	5,845,017.53	-6,960.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	5,817,400.00	34,577.53	5,845,017.53	-6,960.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	920,804,086.06	34,577.53	1,031,789,612.90	110,950,949.31	

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

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

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	上年度末
----	-----	------

	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7,796.36	4,746.01
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	122,266.38	43,550.03
其中：交易所市场	122,266.38	43,550.03
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	54,000.00	54,000.00
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	304,062.74	222,296.04

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富上证综合指数 A		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	878,654,902.79	878,654,902.79
本期申购	325,902,070.51	325,902,070.51
本期赎回（以“-”号填列）	-455,834,787.20	-455,834,787.20
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	748,722,186.10	748,722,186.10
汇添富上证综合指数 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	83,802,442.15	83,802,442.15
本期申购	255,736,320.89	255,736,320.89
本期赎回（以“-”号填列）	-292,787,137.96	-292,787,137.96
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	46,751,625.08	46,751,625.08
汇添富上证综合指数 Y		
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	-	-
本期申购	29,297.07	29,297.07
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	29,297.07	29,297.07

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

汇添富上证综合指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	367,784,934.75	-252,653,489.63	115,131,445.12
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	367,784,934.75	-252,653,489.63	115,131,445.12
本期利润	127,861,508.53	30,098,639.66	157,960,148.19
本期基金份额交易产生的变动数	-55,714,396.09	35,654,404.45	-20,059,991.64

其中：基金申购款	140,699,228.70	-85,786,451.25	54,912,777.45
基金赎回款	-196,413,624.79	121,440,855.70	-74,972,769.09
本期已分配利润	-46,585,072.06	-	-46,585,072.06
本期末	393,346,975.13	-186,900,445.52	206,446,529.61
汇添富上证综合指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,425,437.45	-24,111,937.67	10,313,499.78
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	34,425,437.45	-24,111,937.67	10,313,499.78
本期利润	8,680,418.35	1,884,646.95	10,565,065.30
本期基金份额交易产生的变动数	-15,406,400.01	10,533,904.62	-4,872,495.39
其中：基金申购款	108,634,234.99	-66,818,622.21	41,815,612.78
基金赎回款	-124,040,635.00	77,352,526.83	-46,688,108.17
本期已分配利润	-3,687,268.87	-	-3,687,268.87
本期末	24,012,186.92	-11,693,386.10	12,318,800.82
汇添富上证综合指数 Y			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,380.80	-985.14	395.66
本期基金份额交易产生的变动数	14,030.86	-6,327.45	7,703.41
其中：基金申购款	14,030.86	-6,327.45	7,703.41
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,411.66	-7,312.59	8,099.07

7.4.7.10 存款利息收入

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
活期存款利息收入	188,813.84	197,593.95
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	931.05	4,403.57
其他	2,447.65	2,062.11
合计	192,192.54	204,059.63

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	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
卖出股票成交总额	904,940,224.69	246,721,121.76
减：卖出股票成本总额	787,854,343.62	228,648,099.78
减：交易费用	831,286.27	353,418.37
买卖股票差价收入	116,254,594.80	17,719,603.61

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	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
债券投资收益——利息收入	62,230.14	23,891.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-16,040.00	5,900.00
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	46,190.14	29,791.06

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	7,905,480.00	5,304,520.00
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	7,816,040.00	5,194,100.00
减: 应计利息总额	105,480.00	104,520.00
减: 交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-16,040.00	5,900.00

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具其他投资收益。

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	29,063,640.50	29,913,985.79

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	29,063,640.50	29,913,985.79

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	31,982,301.47	118,447,078.41
——股票投资	31,975,341.47	118,460,458.41
——债券投资	6,960.00	-13,380.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	31,982,301.47	118,447,078.41

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	520,812.47	722,771.73
替代损益	-	-
其他	52.61	196.88
合计	520,865.08	722,968.61

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	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月

	31 日	31 日
审计费用	54,000.00	54,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	436.00	536.00
指数使用费	-	-
登记结算服务费	-	-
IOPV 计算与发布费	-	-
持有人大会-公证费	-	-
持有人大会-律师费	-	-
开户费	-	-
上市费	-	-
或有管理费	-	-
其他	4.17	-
合计	174,440.17	174,536.00

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

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

本基金向截止 2026 年 01 月 15 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，汇添富上证综合指数 A 份额每 10 份基金份额派发红利 0.6000 元；汇添富上证综合指数 C 份额每 10 份基金份额派发红利 0.6000 元；汇添富上证综合指数 Y 份额每 10 份基金份额派发红利 0.6000 元。

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

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
中国工商银行股份有限公司 ("工商银行")	基金托管人,基金代销机构
东方证券股份有限公司 ("东方证券")	基金管理人的股东,基金代销机构
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	47,194,544.13	2.97	6,681,642.27	1.20

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 (%)
东方证券	8,301.98	2.97	-	-
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	4,916.76	2.53	-	-

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	7,569,814.85	7,399,897.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,658,095.51	2,543,216.71
应支付基金管理人的净管理费	4,911,719.34	4,856,680.39

注：本基金各类基金份额的管理费按前一日该类基金份额的基金资产净值的年管理费率计提。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的年管理费率为 0.75%，Y 类基金份额的年管理费率为 0.375%。管理费的计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

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	1,513,962.82	1,479,979.42

注：本基金各类基金份额的托管费按前一日该类基金份额的基金资产净值的年托管费率计提。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的年托管费率为 0.15%，Y 类基金份额的年托管费率为 0.075%。托管费的计算方法如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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			
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	9,625.60	-	9,625.60

东方证券股份有限公司	-	17.25	-	17.25
合计	-	9,642.85	-	9,642.85
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			
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	9,081.71	-	9,081.71
东方证券股份有限公司	-	12.57	-	12.57
合计	-	9,094.28	-	9,094.28

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

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。基金销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

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固有资金投资本基金的情况

注:本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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
工商银行	53,477,433.10	188,813.84	54,044,331.25	197,593.95

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

单位:人民币元

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

	月 14 日		月 14 日					
2	2025 年 07 月 11 日		2025 年 07 月 11 日	0.2800	13,097,992.26	9,518,219.54	22,616,211.80	
合计	-	-		0.5500	27,453,757.84	19,131,314.22	46,585,072.06	
汇添富上证综合指数 C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 01 月 14 日		2025 年 01 月 14 日	0.2700	1,981,052.54	178,963.72	2,160,016.26	
2	2025 年 07 月 11 日		2025 年 07 月 11 日	0.2600	1,381,461.89	145,790.72	1,527,252.61	
合计	-	-		0.5300	3,362,514.43	324,754.44	3,687,268.87	
汇添富上证综合指数 Y								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
				-	-	-	-	
合计	-	-		-	-	-	-	

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

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	成功认购	受限	流通	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日期	期限	受限类型		单价	位：股)			
600930	华电新能源集团	2025年07月09日	6个月	新股流通受限	3.18	6.24	194,990	620,068.20	1,216,737.60	
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	
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	
603370	华新精科	2025年08月27日	6个月	新股流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	
603376	大	2025	6	新	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	

	明电子	年10月28日	个月	股通受限						
603406	天富龙	2025年07月30日	6个月	新股流通受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	
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	
688729	屹唐半导体股份	2025年07月01日	6个月	新股流通受限	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	
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	证	成功	受	流	认购	期末	数量	期末成本	期末估值总	备

码	券名称	认购日	限期	通受限类型	价格	估值单价	(单位:张)	总额	额	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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微半导体设备	2025年12月19日	重大事项停牌	272.72	2026年01月05日	278.00	10,740	1,966,500.85	2,929,012.80	

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约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

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	53,477,433.10	-	-	-	-	-	53,477,433.10
结算 备付 金	249,427.95	-	-	-	-	-	249,427.95
存出 保证	62,134.29	-	-	-	-	-	62,134.29

金							
交易性金融资产	-	-	-	-	-	962,229,296.62	962,229,296.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,615,238.57	2,615,238.57
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	947,253.39	947,253.39
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	53,788,995.34	-	-	-	-	965,791,788.58	1,019,580,783.92
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产	-	-	-	-	-	-	-

款							
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,199,078.29	4,199,078.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	648,729.03	648,729.03
应付托管费	-	-	-	-	-	129,745.75	129,745.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	22,630.36	22,630.36
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	-	-	-	-	-	304,062.74	304,062.74
负债总计	-	-	-	-	-	5,304,246.17	5,304,246.17
利率敏感度缺口	53,788,995.34	-	-	-	-	960,487,542.41	1,014,276,537.75
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
货币资金	54,044,331.25	-	-	-	-	-	54,044,331.25
结算备付金	1,859.97	-	-	-	-	-	1,859.97
存出保证金	73,619.75	-	-	-	-	-	73,619.75
交易性金融资产	-	-	5,845,017.53	-	-	1,025,944,595.37	1,031,789,612.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	4,815,780.73	4,815,780.73
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,749,225.42	1,749,225.42
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	54,119,810.97	-	5,845,017.53	-	-	1,032,509,601.52	1,092,474,430.02
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负	-	-	-	-	-	-	-

债							
衍生 金融 负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	3,493,375.11	3,493,375.11
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	691,600.93	691,600.93
应付 托管 费	-	-	-	-	-	138,320.18	138,320.18
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	26,547.92	26,547.92
应付 投资 顾问 费	-	-	-	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税负 债	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	222,296.04	222,296.04
负债 总计	-	-	-	-	-	4,572,140.18	4,572,140.18
利率 敏感	54,119,810.97	-	5,845,017.53	-	-	1,027,937,461.34	1,087,902,289.84

度缺口							
-----	--	--	--	--	--	--	--

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

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

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	962,229,296.62	94.87	1,025,944,595.37	94.30
交易性金融资产 - 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 - 债券投资	-	-	5,845,017.53	0.54
交易性金融资产 - 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产 - 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	962,229,296.62	94.87	1,031,789,612.90	94.84

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
	上证综合指数 上涨 5%	45,993,174.15	49,601,319.30
	上证综合指数 下跌 5%	-45,993,174.15	-49,601,319.30

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

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	957,876,614.21	1,025,944,595.37
第二层次	2,929,012.80	5,845,017.53
第三层次	1,423,669.61	-
合计	962,229,296.62	1,031,789,612.90

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	-	706,752.63	706,752.63
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	-	716,916.98	716,916.98
其中：计入损益的利得或损失	-	716,916.98	716,916.98
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	1,423,669.61	1,423,669.61
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	-	716,916.98	716,916.98
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	-	280,406.65	280,406.65
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	280,406.65	280,406.65
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	1,423,669.61	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.1628-3.0323	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	962,229,296.62	94.37
	其中：股票	962,229,296.62	94.37
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	53,726,861.05	5.27
8	其他各项资产	3,624,626.25	0.36

9	合计	1,019,580,783.92	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	1,736,530.25	0.17
B	采矿业	88,386,893.50	8.71
C	制造业	417,432,474.76	41.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,645,284.59	3.91
E	建筑业	13,501,640.70	1.33
F	批发和零售业	14,415,006.13	1.42
G	交通运输、仓储和邮政业	37,457,984.95	3.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,407,841.44	6.35
J	金融业	242,692,799.93	23.93
K	房地产业	10,211,472.70	1.01
L	租赁和商务服务业	4,509,239.80	0.44
M	科学研究和技术服务业	12,630,039.44	1.25
N	水利、环境和公共设施管理业	6,810,976.70	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,110,120.00	0.11
Q	卫生和社会工作	879,352.49	0.09
R	文化、体育和娱乐业	2,260,525.00	0.22
S	综合	622,432.00	0.06
	合计	958,710,614.38	94.52

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,301,529.50	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,217,152.74	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,518,682.24	0.35

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	601288	农业银行	6,203,773	47,644,976.64	4.70
2	601988	中国银行	5,392,472	30,898,864.56	3.05
3	601857	中国石油	2,654,957	27,638,102.37	2.72
4	600519	贵州茅台	19,329	26,619,512.22	2.62
5	601138	工业富联	309,000	19,173,450.00	1.89
6	601628	中国人寿	344,271	15,664,330.50	1.54
7	600036	招商银行	336,815	14,179,911.50	1.40
8	601318	中国平安	178,523	12,210,973.20	1.20
9	601088	中国神华	282,615	11,445,907.50	1.13
10	601899	紫金矿业	329,342	11,352,418.74	1.12

11	600900	长江电力	402,511	10,944,274.09	1.08
12	688256	寒武纪科技	8,066	10,933,866.30	1.08
13	600028	中国石化	1,562,577	9,656,725.86	0.95
14	601328	交通银行	1,156,317	8,383,298.25	0.83
15	601658	邮储银行	1,524,168	8,306,715.60	0.82
16	601728	中国电信	1,312,100	8,266,230.00	0.81
17	688041	海光信息	35,937	8,064,622.17	0.80
18	601166	兴业银行	347,006	7,307,946.36	0.72
19	600276	恒瑞医药	102,392	6,099,491.44	0.60
20	600030	中信证券	205,950	5,912,824.50	0.58
21	600000	浦发银行	470,992	5,859,140.48	0.58
22	603993	洛阳钼业	287,939	5,758,780.00	0.57
23	601601	中国太保	131,078	5,493,478.98	0.54
24	603259	药明康德	59,620	5,403,956.80	0.53
25	601319	中国人保	560,000	5,012,000.00	0.49
26	601998	中信银行	650,472	5,008,634.40	0.49
27	600989	宝丰能源	238,900	4,689,607.00	0.46
28	601211	国泰海通	218,739	4,495,086.45	0.44
29	600183	生益科技	61,853	4,416,922.73	0.44
30	600406	国电南瑞	183,706	4,129,710.88	0.41
31	601066	中信建投	147,590	3,950,984.30	0.39
32	600309	万华化学	50,111	3,842,511.48	0.38

33	601816	京沪高铁	741,000	3,816,150.00	0.38
34	600547	山东黄金	96,390	3,731,256.90	0.37
35	601668	中国建筑	688,985	3,534,493.05	0.35
36	601012	隆基绿能	190,859	3,473,633.80	0.34
37	601225	陕西煤业	162,881	3,472,622.92	0.34
38	601005	重庆钢铁	2,317,300	3,383,258.00	0.33
39	601919	中远海控	221,948	3,369,170.64	0.33
40	603288	海天味业	90,660	3,356,233.20	0.33
41	600809	山西汾酒	19,367	3,325,313.90	0.33
42	601336	新华保险	47,255	3,293,673.50	0.32
43	601939	建设银行	343,311	3,185,926.08	0.31
44	601366	利群股份	652,200	3,182,736.00	0.31
45	601818	光大银行	906,467	3,163,569.83	0.31
46	600160	巨化股份	81,500	3,131,230.00	0.31
47	600919	江苏银行	300,340	3,123,536.00	0.31
48	601633	长城汽车	136,125	3,080,508.75	0.30
49	600887	伊利股份	107,361	3,070,524.60	0.30
50	605118	力鼎光电	99,800	3,004,978.00	0.30
51	688172	燕东微电子股份	102,899	2,977,897.06	0.29
52	600104	上汽集团	193,200	2,940,504.00	0.29
53	688012	中微半导体设备	10,740	2,929,012.80	0.29

54	600690	海尔智家	111,500	2,909,035.00	0.29
55	601985	中国核电	330,100	2,855,365.00	0.28
56	600038	中直股份	78,900	2,850,657.00	0.28
57	603501	豪威集团	22,520	2,835,268.00	0.28
58	600029	南方航空	352,641	2,824,654.41	0.28
59	600031	三一重工	132,694	2,803,824.22	0.28
60	601127	赛力斯	22,700	2,745,792.00	0.27
61	601766	中国中车	401,061	2,735,236.02	0.27
62	600115	中国东航	454,826	2,728,956.00	0.27
63	601009	南京银行	237,376	2,713,207.68	0.27
64	601065	江西省盐业集团	325,800	2,704,140.00	0.27
65	603380	易德龙	70,400	2,675,200.00	0.26
66	600025	华能水电	293,800	2,667,704.00	0.26
67	600019	宝钢股份	358,043	2,667,420.35	0.26
68	601600	中国铝业	216,565	2,646,424.30	0.26
69	605499	东鹏饮料	9,760	2,609,726.40	0.26
70	600699	均胜电子	82,800	2,596,608.00	0.26
71	600050	中国联通	505,042	2,580,764.62	0.25
72	688103	国力电子	42,205	2,557,200.95	0.25
73	600549	厦门钨业	61,800	2,537,508.00	0.25
74	600739	辽宁成大	221,700	2,478,606.00	0.24
75	688008	澜起科技	20,880	2,459,664.00	0.24

76	600760	中航沈飞	43,052	2,417,369.80	0.24
77	601168	西部矿业	87,300	2,412,972.00	0.24
78	601229	上海银行	238,306	2,406,890.60	0.24
79	605376	博迁新材	36,700	2,400,180.00	0.24
80	688681	科汇电力自动化	135,244	2,377,589.52	0.23
81	600075	新疆天业	464,300	2,298,285.00	0.23
82	688002	睿创微纳	22,521	2,270,116.80	0.22
83	600415	小商品城	138,700	2,212,265.00	0.22
84	600660	福耀玻璃	33,930	2,197,646.10	0.22
85	688506	百利天恒药业	6,800	2,197,080.00	0.22
86	600936	广西广电	516,300	2,178,786.00	0.21
87	600150	中国船舶	65,376	2,174,405.76	0.21
88	688027	科大国盾量子	4,316	2,174,357.64	0.21
89	688188	上海柏楚电子科技	16,000	2,174,240.00	0.21
90	600999	招商证券	130,486	2,171,287.04	0.21
91	688111	金山办公	7,065	2,169,449.55	0.21
92	601898	中煤能源	173,287	2,155,690.28	0.21
93	600489	中金黄金	90,143	2,105,740.48	0.21
94	688521	芯原微电子	15,200	2,081,944.00	0.21
95	601727	上海电气	241,600	2,080,176.00	0.21
96	600512	腾达建设	845,800	2,046,836.00	0.20

97	600346	恒力石化	90,689	2,043,223.17	0.20
98	688207	格灵深瞳	134,391	2,042,743.20	0.20
99	600018	上港集团	376,590	2,041,117.80	0.20
100	603267	鸿远电子	37,400	2,035,682.00	0.20
101	601528	瑞丰银行	352,000	2,006,400.00	0.20
102	603050	科林电气	111,100	2,002,022.00	0.20
103	600116	三峡水利	304,900	1,994,046.00	0.20
104	603085	天成自控	165,300	1,958,805.00	0.19
105	688259	创耀通信科技	46,501	1,943,741.80	0.19
106	688512	慧智微电子	172,471	1,924,776.36	0.19
107	600089	特变电工	86,009	1,911,119.98	0.19
108	601169	北京银行	347,572	1,904,694.56	0.19
109	688261	东微半导体	22,992	1,885,573.92	0.19
110	600926	杭州银行	123,080	1,880,662.40	0.19
111	600905	三峡能源	457,400	1,870,766.00	0.18
112	600675	中华企业	689,900	1,869,629.00	0.18
113	688981	中芯国际	15,160	1,862,102.80	0.18
114	601607	上海医药	104,095	1,859,136.70	0.18
115	688023	安恒信息	36,032	1,852,405.12	0.18
116	688533	上声电子股份	63,325	1,851,623.00	0.18
117	688295	中复神鹰碳纤维	56,188	1,843,528.28	0.18
118	688380	中微半	57,187	1,838,562.05	0.18

		导			
119	600875	东方电气	75,599	1,835,543.72	0.18
120	688015	交控科技	80,538	1,834,655.64	0.18
121	603323	苏农银行	363,190	1,834,109.50	0.18
122	600015	华夏银行	264,881	1,819,732.47	0.18
123	601881	中国银河	115,604	1,817,294.88	0.18
124	601375	中原证券	419,300	1,802,990.00	0.18
125	600909	华安证券	264,550	1,793,649.00	0.18
126	601688	华泰证券	75,760	1,787,178.40	0.18
127	603160	汇顶科技	22,500	1,777,500.00	0.18
128	688566	吉贝尔药业	59,244	1,768,433.40	0.17
129	600210	紫江企业	238,500	1,752,975.00	0.17
130	600064	南京高科	201,800	1,751,624.00	0.17
131	688001	苏州华兴源创科技	57,819	1,744,977.42	0.17
132	688114	华大智造	28,654	1,741,017.04	0.17
133	600332	白云山	67,577	1,739,431.98	0.17
134	688515	裕太微电子	16,577	1,699,971.35	0.17
135	603797	联泰环保	363,000	1,695,210.00	0.17
136	603893	瑞芯微	9,500	1,693,660.00	0.17
137	688213	思特威电子科技	17,801	1,692,697.09	0.17
138	601877	正泰电器	60,162	1,677,918.18	0.17
139	600886	国投电力	127,705	1,675,489.60	0.17

140	688549	中巨芯科技	181,718	1,657,268.16	0.16
141	600166	福田汽车	565,400	1,650,968.00	0.16
142	603167	渤海轮渡	175,000	1,650,250.00	0.16
143	603629	利通电子	61,600	1,641,640.00	0.16
144	603328	依顿电子	149,700	1,640,712.00	0.16
145	688158	优刻得科技	58,173	1,634,079.57	0.16
146	600585	海螺水泥	74,481	1,628,154.66	0.16
147	688063	派能科技	28,615	1,625,904.30	0.16
148	601669	中国电建	312,583	1,625,431.60	0.16
149	600716	凤凰股份	419,600	1,623,852.00	0.16
150	600496	精工钢构	390,200	1,619,330.00	0.16
151	688113	联测科技	40,564	1,603,494.92	0.16
152	600741	华域汽车	79,150	1,583,000.00	0.16
153	600893	航发动力	39,452	1,579,263.56	0.16
154	603199	九华旅游	42,800	1,573,328.00	0.16
155	603071	物产环能	118,600	1,567,892.00	0.15
156	600590	泰豪科技	166,600	1,567,706.00	0.15
157	603519	立霸股份	129,600	1,559,088.00	0.15
158	603927	中科软	81,500	1,555,835.00	0.15
159	600061	国投资本	202,913	1,552,284.45	0.15
160	688093	世华科技	42,033	1,548,916.05	0.15
161	688077	大地熊新材料	50,600	1,545,830.00	0.15

162	688200	华峰测控	8,113	1,543,092.60	0.15
163	601390	中国中铁	284,928	1,541,460.48	0.15
164	600795	国电电力	305,128	1,537,845.12	0.15
165	688080	映翰通网络	30,377	1,534,038.50	0.15
166	601226	华电科工	195,500	1,532,720.00	0.15
167	603166	福达股份	97,600	1,532,320.00	0.15
168	600497	驰宏锌锗	209,585	1,532,066.35	0.15
169	688183	生益电子	16,001	1,531,135.69	0.15
170	601577	长沙银行	155,600	1,509,320.00	0.15
171	600269	赣粤高速	288,600	1,497,834.00	0.15
172	600098	广州发展	229,000	1,497,660.00	0.15
173	601901	方正证券	191,200	1,491,360.00	0.15
174	688616	西力科技	121,877	1,490,555.71	0.15
175	603799	华友钴业	21,800	1,488,068.00	0.15
176	688677	青岛海泰新光	34,455	1,487,077.80	0.15
177	603444	吉比特	3,500	1,483,475.00	0.15
178	600642	申能股份	190,280	1,480,378.40	0.15
179	601018	宁波港	407,174	1,478,041.62	0.15
180	600499	科达制造	106,500	1,477,155.00	0.15
181	601880	辽港股份	921,700	1,474,720.00	0.15
182	603187	海容冷链	93,420	1,465,759.80	0.14
183	600011	华能国际	195,896	1,461,384.16	0.14
184	600004	白云机	154,100	1,457,786.00	0.14

		场			
185	603989	艾华集团	86,600	1,453,148.00	0.14
186	688208	道通科技	39,320	1,446,976.00	0.14
187	601995	中金公司	41,100	1,438,500.00	0.14
188	601555	东吴证券	158,472	1,435,756.32	0.14
189	600522	中天科技	78,773	1,427,366.76	0.14
190	688052	纳芯微电子	9,000	1,423,620.00	0.14
191	600048	保利发展	232,569	1,418,670.90	0.14
192	600908	无锡银行	238,100	1,411,933.00	0.14
193	603019	中科曙光	16,400	1,404,496.00	0.14
194	603661	恒林股份	43,780	1,401,397.80	0.14
195	600177	雅戈尔	184,091	1,399,091.60	0.14
196	600584	长电科技	37,971	1,396,573.38	0.14
197	600282	南钢股份	262,100	1,378,646.00	0.14
198	600016	民生银行	359,708	1,377,681.64	0.14
199	603197	保隆科技	37,200	1,376,028.00	0.14
200	688419	耐科装备	48,897	1,368,627.03	0.13
201	601108	财通证券	155,950	1,359,884.00	0.13
202	600020	中原高速	318,700	1,357,662.00	0.13
203	600111	北方稀土	29,400	1,355,928.00	0.13
204	688182	灿勤科技	45,648	1,347,528.96	0.13
205	600037	歌华有线	182,600	1,332,980.00	0.13
206	603885	吉祥航	88,400	1,315,392.00	0.13

		空			
207	688100	威胜信息	33,321	1,309,515.30	0.13
208	601963	重庆银行	120,800	1,308,264.00	0.13
209	603317	天味食品	104,400	1,307,088.00	0.13
210	688069	德林海环保	58,250	1,306,547.50	0.13
211	603195	公牛集团	31,819	1,299,169.77	0.13
212	603920	世运电路	26,800	1,297,388.00	0.13
213	600420	国药现代	128,300	1,295,830.00	0.13
214	688799	华纳大药厂	26,944	1,285,228.80	0.13
215	600803	新奥股份	60,900	1,264,284.00	0.12
216	600469	风神股份	182,100	1,263,774.00	0.12
217	600776	东方通信	76,100	1,255,650.00	0.12
218	688072	拓荆科技	3,800	1,254,000.00	0.12
219	601111	中国国航	133,081	1,246,968.97	0.12
220	600641	先导基电	70,520	1,243,972.80	0.12
221	603986	兆易创新	5,780	1,238,365.00	0.12
222	600352	浙江龙盛	115,022	1,226,134.52	0.12
223	600109	国金证券	131,270	1,220,811.00	0.12
224	601677	明泰铝业	82,300	1,217,217.00	0.12
225	601128	常熟银行	172,600	1,215,104.00	0.12
226	603038	华立股份	75,200	1,210,720.00	0.12
227	600517	国网英大	201,100	1,208,611.00	0.12

228	603105	芯能科技	129,800	1,192,862.00	0.12
229	600035	楚天高速	306,400	1,188,832.00	0.12
230	688439	振华风光	18,352	1,185,539.20	0.12
231	688508	芯朋微电子	19,416	1,182,434.40	0.12
232	603057	上海紫燕食品	57,700	1,173,618.00	0.12
233	601006	大秦铁路	226,944	1,171,031.04	0.12
234	600918	中泰证券	180,000	1,170,000.00	0.12
235	688557	兰剑智能	32,059	1,167,909.37	0.12
236	601868	中国能建	495,974	1,165,538.90	0.11
237	600988	赤峰黄金	37,200	1,162,128.00	0.11
238	600966	博汇纸业	169,800	1,159,734.00	0.11
239	603678	火炬电子	32,600	1,151,432.00	0.11
240	600266	城建发展	226,400	1,147,848.00	0.11
241	688185	康希诺生物	18,259	1,147,578.15	0.11
242	688558	国盛智科股份	39,507	1,142,937.51	0.11
243	688550	瑞联新材料	25,174	1,140,633.94	0.11
244	603383	顶点软件	31,400	1,133,854.00	0.11
245	603982	泉峰汽车	135,300	1,132,461.00	0.11
246	600009	上海机场	34,465	1,129,073.40	0.11
247	600339	中油工程	337,000	1,128,950.00	0.11
248	601117	中国化学	149,827	1,128,197.31	0.11
249	600997	开滦股份	195,900	1,126,425.00	0.11

250	601958	金铂股份	71,900	1,120,202.00	0.11
251	601825	沪农商行	120,300	1,117,587.00	0.11
252	603111	康尼机电	162,000	1,109,700.00	0.11
253	600598	北大荒	73,895	1,104,730.25	0.11
254	603456	九洲药业	61,600	1,102,640.00	0.11
255	688223	晶科能源	195,167	1,100,741.88	0.11
256	603118	共进股份	95,300	1,095,950.00	0.11
257	600310	广西能源	286,900	1,093,089.00	0.11
258	688819	天能电池集团股份	32,676	1,085,496.72	0.11
259	688202	美迪西生物医药	19,000	1,071,600.00	0.11
260	601860	紫金银行	384,300	1,060,668.00	0.10
261	688267	中触媒股份	37,566	1,058,234.22	0.10
262	603309	维力医疗	77,100	1,047,789.00	0.10
263	688526	武汉科前生物	68,122	1,039,541.72	0.10
264	603916	苏博特	109,500	1,035,870.00	0.10
265	688132	邦彦技术股份	56,076	1,032,919.92	0.10
266	603310	巍华新材	61,400	1,032,134.00	0.10
267	688519	南亚新材料	12,754	1,031,288.44	0.10
268	603737	三棵树	22,146	1,024,695.42	0.10
269	688668	鼎通科技	8,245	1,022,380.00	0.10
270	603237	五芳斋实业	60,700	1,012,476.00	0.10
271	601997	贵阳银行	170,900	1,003,183.00	0.10

272	601368	绿城水务	202,200	1,002,912.00	0.10
273	600032	浙江新能	134,800	998,868.00	0.10
274	603390	通达电气	76,000	993,320.00	0.10
275	603368	柳药集团	55,700	992,574.00	0.10
276	603018	华设集团	129,600	986,256.00	0.10
277	688629	四川华丰科技	9,800	980,588.00	0.10
278	600655	豫园股份	191,041	980,040.33	0.10
279	601827	三峰环境	115,600	979,132.00	0.10
280	600186	莲花控股	163,300	976,534.00	0.10
281	600436	片仔癀	5,737	968,290.86	0.10
282	601100	恒立液压	8,800	967,208.00	0.10
283	603025	大豪科技	53,800	966,248.00	0.10
284	688552	航天南湖	26,600	966,112.00	0.10
285	600863	内蒙华电	213,400	956,032.00	0.09
286	600845	宝信软件	45,540	943,133.40	0.09
287	688459	哈铁科技	97,696	942,766.40	0.09
288	605168	三人行	24,300	937,494.00	0.09
289	603788	宁波高发	56,800	928,112.00	0.09
290	600643	爱建集团	166,800	922,404.00	0.09
291	600548	深高速	104,600	920,480.00	0.09
292	600995	南网储能	73,200	920,124.00	0.09
293	600372	中航机载	68,309	916,706.78	0.09
294	688686	奥普特科技	7,358	913,348.54	0.09

295	600562	国睿科技	32,100	907,146.00	0.09
296	601003	柳钢股份	180,000	905,400.00	0.09
297	603558	健盛集团	80,600	905,138.00	0.09
298	688060	江苏云涌电子科技	21,250	899,512.50	0.09
299	688067	爱威科技	36,249	890,275.44	0.09
300	600261	阳光照明	264,000	889,680.00	0.09
301	689009	九号公司	15,900	883,881.00	0.09
302	603416	信捷电气	16,000	883,680.00	0.09
303	600188	兖矿能源	66,963	880,563.45	0.09
304	600763	通策医疗	21,869	879,352.49	0.09
305	688702	盛科通信	6,200	878,478.00	0.09
306	603387	基蛋生物	104,800	877,176.00	0.09
307	600998	九州通	171,234	876,718.08	0.09
308	688271	联影医疗	6,964	873,982.00	0.09
309	688105	诺唯赞生物	43,374	868,347.48	0.09
310	600132	重庆啤酒	16,600	867,184.00	0.09
311	603170	宝立食品科技	60,500	863,940.00	0.09
312	603766	隆鑫通用	53,200	857,052.00	0.08
313	600623	华谊集团	111,000	855,810.00	0.08
314	600377	宁沪高速	70,510	853,876.10	0.08
315	600597	光明乳业	105,388	852,588.92	0.08
316	601808	中海油服	60,700	852,228.00	0.08

317	600867	通化东宝	104,100	850,497.00	0.08
318	603569	长久物流	111,100	849,915.00	0.08
319	601717	中创智领	34,600	849,430.00	0.08
320	603936	博敏电子	66,800	848,360.00	0.08
321	603325	博隆技术	10,900	847,693.00	0.08
322	601788	光大证券	48,238	846,576.90	0.08
323	688390	固德威电源	13,600	844,968.00	0.08
324	600583	海油工程	153,800	844,362.00	0.08
325	603786	科博达	10,800	843,480.00	0.08
326	688591	泰凌微	19,803	842,815.68	0.08
327	600600	青岛啤酒	13,751	841,561.20	0.08
328	603899	晨光股份	30,900	836,154.00	0.08
329	600862	中航高科	35,197	831,705.11	0.08
330	603005	晶方科技	30,000	829,800.00	0.08
331	688355	明志科技	46,586	829,230.80	0.08
332	688123	聚辰半导体	6,600	828,828.00	0.08
333	603379	三美股份	13,600	825,792.00	0.08
334	600131	国网信通	51,000	823,140.00	0.08
335	688522	纳睿雷达科技	20,600	822,558.00	0.08
336	603578	三星新材	68,000	821,440.00	0.08
337	600410	华胜天成	45,600	815,328.00	0.08
338	605020	永和股份	30,300	814,767.00	0.08
339	601991	大唐发	233,441	814,709.09	0.08

		电			
340	603707	健友股份	89,500	808,185.00	0.08
341	600307	酒钢宏兴	488,100	805,365.00	0.08
342	600196	复星医药	30,191	799,759.59	0.08
343	600251	冠农股份	86,200	795,626.00	0.08
344	600827	百联股份	88,100	792,019.00	0.08
345	688029	南微医学科技	9,684	789,827.04	0.08
346	688050	爱博诺德医疗	13,000	788,580.00	0.08
347	600873	梅花生物	77,100	781,023.00	0.08
348	688428	诺诚健华	38,014	780,047.28	0.08
349	600449	宁夏建材	63,100	779,916.00	0.08
350	688363	华熙生物	17,804	777,678.72	0.08
351	601158	重庆水务	173,164	774,043.08	0.08
352	600330	天通股份	58,700	770,731.00	0.08
353	603043	广州酒家	43,600	768,668.00	0.08
354	601966	玲珑轮胎	52,717	765,978.01	0.08
355	603596	伯特利	14,880	762,897.60	0.08
356	603500	祥和实业	63,500	760,730.00	0.08
356	603639	海利尔	59,900	760,730.00	0.08
358	601163	三角轮胎	53,200	760,228.00	0.07
359	603035	常熟汽饰	49,000	758,030.00	0.07
360	600848	上海临港	64,600	755,820.00	0.07
361	688180	君实生物	22,003	751,622.48	0.07

362	688636	智明达电子	17,539	751,370.76	0.07
363	688429	时创能源	57,383	751,143.47	0.07
364	600363	联创光电	11,900	750,414.00	0.07
365	600523	贵航股份	47,700	749,367.00	0.07
366	603700	宁水集团	55,100	748,809.00	0.07
367	600500	中化国际	188,200	737,744.00	0.07
368	603345	安井食品	9,300	737,304.00	0.07
369	601702	华峰铝业	35,700	730,779.00	0.07
370	601888	中国中免	7,705	728,584.80	0.07
371	600987	航民股份	105,600	727,584.00	0.07
372	600582	天地科技	124,400	725,252.00	0.07
373	601882	海天精工	37,200	723,912.00	0.07
374	600885	宏发股份	23,784	723,033.60	0.07
375	601866	中远海发	285,200	718,704.00	0.07
376	605123	派克新材	6,900	716,910.00	0.07
377	600661	昂立教育	69,600	713,400.00	0.07
378	688006	浙江杭可科技	24,099	705,859.71	0.07
379	600563	法拉电子	6,700	703,165.00	0.07
380	603305	旭升集团	43,400	702,212.00	0.07
381	600392	盛和资源	32,600	701,878.00	0.07
382	600100	同方股份	77,822	694,172.24	0.07
383	600323	瀚蓝环境	24,192	691,891.20	0.07

384	603728	鸣志电 器	9,500	687,325.00	0.07
385	603713	密尔克 卫	12,300	685,971.00	0.07
386	603297	永新光 学	6,500	684,450.00	0.07
387	688653	康希通 信	56,177	682,550.55	0.07
388	600854	春兰股 份	136,100	679,139.00	0.07
389	601101	昊华能 源	94,200	674,472.00	0.07
390	600114	东睦股 份	22,000	672,100.00	0.07
391	600985	淮北矿 业	59,600	662,156.00	0.07
392	600378	昊华科 技	20,500	655,180.00	0.06
393	688798	艾为电 子	8,600	654,546.00	0.06
394	688538	和辉光 电	245,758	653,716.28	0.06
395	601990	南京证 券	82,316	651,942.72	0.06
396	601198	东兴证 券	46,898	650,944.24	0.06
397	600780	通宝能 源	114,300	649,224.00	0.06
398	688238	和元生 物	96,416	642,130.56	0.06
399	603897	长城科 技	23,500	639,200.00	0.06
400	600380	健康元	55,300	638,715.00	0.06
401	603330	天洋新 材	88,100	637,844.00	0.06
402	600820	隧道股 份	97,900	635,371.00	0.06
403	688020	方邦股 份	9,333	634,830.66	0.06
404	600176	中国巨 石	37,000	632,700.00	0.06
405	688443	智翔金 泰	23,217	632,431.08	0.06

406	688389	深圳普 门科技	48,703	632,164.94	0.06
407	601118	海南橡 胶	108,000	631,800.00	0.06
408	600861	北京人 力	34,400	630,896.00	0.06
409	600125	铁龙物 流	97,900	630,476.00	0.06
410	601689	拓普集 团	8,095	624,772.10	0.06
411	600834	申通地 铁	73,400	622,432.00	0.06
412	601900	南方传 媒	45,800	614,178.00	0.06
413	600935	华塑股 份	249,500	611,275.00	0.06
414	603995	甬金股 份	33,700	609,296.00	0.06
415	603213	镇洋发 展	46,400	609,232.00	0.06
416	601083	锦江航 运	54,000	602,640.00	0.06
417	688582	芯动联 科	9,000	594,990.00	0.06
418	688619	罗普特 科技	43,595	592,892.00	0.06
419	688321	微芯生 物	20,216	590,711.52	0.06
420	688112	鼎阳科 技	15,700	587,965.00	0.06
421	601096	宏盛华 源铁塔 集团	141,500	587,225.00	0.06
422	688571	杭华油 墨股份	78,264	583,066.80	0.06
423	688106	金宏气 体	29,732	582,449.88	0.06
424	688689	常州银 河微电	20,456	580,541.28	0.06
425	605258	协和电 子	18,400	575,368.00	0.06
426	600732	爱旭股 份	42,600	570,840.00	0.06
427	601800	中国交	69,239	570,529.36	0.06

		建			
428	688092	爱科科技股份	22,547	566,831.58	0.06
429	600054	黄山旅游	49,900	564,868.00	0.06
430	600395	盘江股份	121,200	564,792.00	0.06
431	601518	吉林高速	199,900	563,718.00	0.06
432	600391	航发科技	14,900	552,790.00	0.05
433	688018	乐鑫科技	3,203	544,510.00	0.05
434	688391	钜泉科技	19,200	543,936.00	0.05
435	600612	老凤祥	12,104	538,264.88	0.05
436	688222	成都先导	22,800	534,660.00	0.05
437	688187	时代电气	10,400	533,416.00	0.05
438	603006	联明股份	40,600	532,672.00	0.05
439	603876	鼎胜新材	35,200	528,352.00	0.05
440	600039	四川路桥	53,100	528,345.00	0.05
441	600535	天士力	35,000	527,450.00	0.05
442	688565	力源科技	47,007	526,008.33	0.05
443	603699	纽威股份	10,100	524,897.00	0.05
444	688303	大全能源	19,543	524,143.26	0.05
445	688133	泰坦股份	23,490	520,068.60	0.05
446	688613	奥精医疗	25,210	512,015.10	0.05
447	601236	红塔证券	62,000	507,780.00	0.05
448	600633	浙数文化	39,300	505,398.00	0.05
449	688249	晶合集成	15,173	503,591.87	0.05

450	603233	大参林	28,521	502,540.02	0.05
451	603887	城地香江	36,300	490,776.00	0.05
452	601865	福莱特	31,300	490,471.00	0.05
453	600906	财达证券	73,500	490,245.00	0.05
454	600717	天津港	108,151	483,434.97	0.05
455	603070	万控智造	37,200	482,112.00	0.05
456	688025	杰普特光电	3,400	481,338.00	0.05
457	601928	凤凰传媒	47,800	479,912.00	0.05
458	600961	株冶集团	29,800	479,780.00	0.05
459	603867	新化股份	18,800	477,520.00	0.05
460	600023	浙能电力	94,179	466,186.05	0.05
461	600486	扬农化工	6,660	462,137.40	0.05
462	603151	邦基科技股份	25,600	461,312.00	0.05
463	603861	白云电器	37,800	460,026.00	0.05
464	688126	上海硅产业集团	21,200	458,768.00	0.05
465	600787	中储股份	81,200	456,344.00	0.04
466	603638	艾迪精密	23,820	450,912.60	0.04
467	688163	赛伦生物	20,604	448,549.08	0.04
468	600821	金开新能	87,700	447,270.00	0.04
469	603408	建霖家居	33,000	446,820.00	0.04
470	601061	中信金属	30,900	444,960.00	0.04
471	603663	三祥新材	12,500	441,875.00	0.04
472	688311	盟升电	9,600	437,760.00	0.04

		子			
473	600570	恒生电子	14,340	432,351.00	0.04
474	601858	中国科传	23,800	431,970.00	0.04
475	600928	西安银行	116,400	430,680.00	0.04
476	600628	新世界	54,400	427,584.00	0.04
477	688326	经纬恒润	3,600	423,000.00	0.04
478	605006	山东玻纤	57,500	419,750.00	0.04
479	600983	惠而浦	43,800	418,728.00	0.04
480	603659	璞泰来	15,100	412,834.00	0.04
481	603201	常润股份	24,200	408,496.00	0.04
482	600718	东软集团	40,400	406,828.00	0.04
483	600609	金杯汽车	87,500	405,125.00	0.04
484	688088	虹软科技	8,115	401,692.50	0.04
485	605577	龙版传媒	30,700	401,249.00	0.04
486	600325	华发股份	94,800	400,056.00	0.04
487	600382	广东明珠	55,900	398,567.00	0.04
488	603689	皖天然气	49,100	398,201.00	0.04
489	605098	行动教育	9,500	396,720.00	0.04
490	603602	纵横通信	27,200	396,032.00	0.04
491	600853	龙建股份	91,400	395,762.00	0.04
492	603816	顾家家居	12,800	393,472.00	0.04
493	603611	诺力股份	16,000	391,200.00	0.04
494	600588	用友网络	29,221	387,470.46	0.04
495	600010	包钢股	162,200	386,036.00	0.04

		份			
496	603357	设计总院	47,300	385,495.00	0.04
497	603787	新日股份	27,200	382,432.00	0.04
498	603311	金海高科	24,900	380,472.00	0.04
499	603583	捷昌驱动	9,900	376,893.00	0.04
500	605001	威奥股份	49,000	373,870.00	0.04
501	603282	亚光科技股份	18,800	372,992.00	0.04
502	600356	恒丰纸业	42,300	371,394.00	0.04
503	600968	海油发展	95,900	368,256.00	0.04
504	600770	综艺股份	70,400	363,968.00	0.04
505	600221	海航控股	200,500	362,905.00	0.04
506	688131	皓元医药	5,000	360,400.00	0.04
507	603855	华荣股份	18,400	356,040.00	0.04
508	603236	移远通信	3,700	353,017.00	0.03
509	600480	凌云股份	28,700	352,723.00	0.03
510	688599	天合光能	21,211	351,042.05	0.03
511	603172	浙江万丰股份	19,400	345,320.00	0.03
512	600429	三元股份	65,700	340,326.00	0.03
513	688590	新致软件	18,206	339,723.96	0.03
514	688343	云天励飞股份	4,400	334,752.00	0.03
515	603466	风语筑	35,600	333,216.00	0.03
516	603270	金帝精密科技股份	12,300	332,469.00	0.03

517	600195	中牧股份	42,100	331,327.00	0.03
518	600606	绿地控股	198,600	329,676.00	0.03
519	688137	近岸蛋白	8,100	324,405.00	0.03
520	600866	星湖科技	46,400	322,480.00	0.03
521	688382	益方生物科技	11,800	321,432.00	0.03
522	688584	上海合晶硅材料	14,600	320,324.00	0.03
523	688416	恒烁股份	5,800	319,754.00	0.03
524	688379	华光新材	5,803	319,513.18	0.03
525	601016	节能风电	108,000	318,600.00	0.03
526	605056	咸亨国际	18,800	310,200.00	0.03
527	688128	中国电器研究院	10,662	310,050.96	0.03
528	688305	科德数控	5,003	309,185.40	0.03
529	601156	东航物流	16,600	305,606.00	0.03
530	600398	海澜之家	50,500	305,525.00	0.03
531	688327	云从科技	21,222	304,960.14	0.03
532	603185	弘元绿能	9,900	301,950.00	0.03
533	688318	财富趋势	2,280	301,689.60	0.03
534	600300	维维股份	84,000	294,840.00	0.03
535	600438	通威股份	14,185	291,076.20	0.03
536	688435	英方软件	6,200	289,974.00	0.03
537	600764	中国海防	10,400	284,336.00	0.03

538	688579	山大地纬软件	26,200	282,436.00	0.03
539	688022	瀚川智能	18,401	281,535.30	0.03
540	603511	爱慕股份	18,100	280,369.00	0.03
541	600750	江中药业	12,100	280,357.00	0.03
542	603256	宏和科技	7,600	279,756.00	0.03
543	688678	福立旺精密	11,531	278,819.58	0.03
544	600369	西南证券	61,900	277,312.00	0.03
545	603066	音飞储存	25,700	276,275.00	0.03
546	600572	康恩贝	60,500	269,830.00	0.03
547	688609	广东九联科技	26,400	269,544.00	0.03
548	600529	山东药玻	13,225	263,574.25	0.03
549	688728	格科微有限公司	17,084	255,234.96	0.03

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	600930	华电新能源集团	195,056	1,217,152.74	0.12
2	688729	屹唐半导体股份	34,234	837,347.32	0.08
3	688809	强一股份	2,584	649,717.29	0.06
4	688807	优迅芯片股份	1,303	237,273.96	0.02
5	688775	影石创新	573	134,597.70	0.01
6	603175	超颖电子	1,683	111,461.44	0.01
7	688805	健信超导	2,643	108,786.97	0.01

8	603418	友升股份	1,383	83,471.34	0.01
9	603248	锡华科技	2,592	55,472.04	0.01
10	603370	华新精科	811	38,275.11	0.00
11	603049	中策橡胶	478	26,744.10	0.00
12	601026	道生天合材料科技	451	6,440.28	0.00
13	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
14	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
15	603334	丰倍生物	88	2,888.16	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	601328	交通银行	10,986,712.00	1.01
2	600519	贵州茅台	9,463,912.00	0.87
3	601288	农业银行	9,243,436.00	0.85
4	601988	中国银行	8,798,732.00	0.81
5	600512	腾达建设	6,023,046.00	0.55
6	688589	力合微电子	5,767,186.77	0.53
7	601857	中国石油	5,670,657.00	0.52
8	688093	世华科技	5,378,935.00	0.49
9	603757	大元泵业	4,827,602.00	0.44
10	601211	国泰海通	4,634,402.32	0.43
11	603456	九洲药业	4,092,542.00	0.38
12	601366	利群股份	3,847,214.00	0.35
13	603676	卫信康	3,678,237.00	0.34
14	600036	招商银行	3,634,783.00	0.33
15	601628	中国人寿	3,632,630.00	0.33
16	601005	重庆钢铁	3,439,637.00	0.32
17	688330	宏力达信息	3,432,024.83	0.32
18	688219	会通股份	3,290,752.16	0.30
19	601939	建设银行	3,164,544.00	0.29
20	688127	蓝特光学	3,104,675.96	0.29

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 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	25,840,570.00	2.38
2	600519	贵州茅台	17,074,085.00	1.57
3	601988	中国银行	15,754,328.00	1.45
4	601939	建设银行	15,104,934.00	1.39
5	601857	中国石油	11,696,059.00	1.08
6	601328	交通银行	8,610,566.00	0.79
7	603757	大元泵业	8,517,639.00	0.78
8	600036	招商银行	7,871,540.00	0.72
9	601628	中国人寿	6,819,836.00	0.63
10	601138	工业富联	6,682,296.00	0.61
11	688093	世华科技	6,156,556.68	0.57
12	600900	长江电力	5,600,654.00	0.51
13	688589	力合微电子	5,473,809.38	0.50
14	601318	中国平安	5,191,675.00	0.48
15	601088	中国神华	5,128,822.00	0.47
16	601728	中国电信	4,935,794.00	0.45
17	601231	环旭电子	4,762,937.82	0.44
18	600028	中国石化	4,452,756.00	0.41
19	600030	中信证券	4,152,765.00	0.38
20	603676	卫信康	4,129,542.00	0.38

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	692,163,703.40
卖出股票收入（成交）总额	904,940,224.69

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

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

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	62,134.29
2	应收清算款	2,615,238.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	947,253.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,624,626.25

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600930	华电新能源集团	1,216,737.60	0.12	新股流通受限
2	688729	屹唐半导体股份	85,101.40	0.01	新股流通受限
3	688809	强一股份	52,657.29	0.01	新股流通受限
4	688807	优迅芯片股份	17,758.36	0.00	新股流通受限

§ 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(%)
汇添富上证综合指数 A	39,604	18,905.22	4,265,549.79	0.57	744,456,636.31	99.43
汇添富上证综合指数 C	5,898	7,926.69	0.00	0.00	46,751,625.08	100.00
汇添富上	7	4,185.30	0.00	0.00	29,297.07	100.00

证综合指数 Y						
合计	45,509	17,480.13	4,265,549.79	0.54	791,237,558.46	99.46

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	汇添富上证综合指数 A	84,098.77	0.01
	汇添富上证综合指数 C	823.76	0.00
	汇添富上证综合指数 Y	10,316.68	35.21
	合计	95,239.21	0.01

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	汇添富上证综合指数 A	0
	汇添富上证综合指数 C	0
	汇添富上证综合指数 Y	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富上证综合指数 A	0
	汇添富上证综合指数 C	0
	汇添富上证综合指数 Y	0
	合计	0

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	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	汇添富上证综合指数 Y
----	-------------	-------------	-------------

基金合同生效日 (2009年07月 01日)基金份额 总额	9,097,758,651.47	-	-
本报告期期初基 金份额总额	878,654,902.79	83,802,442.15	-
本报告期基金总 申购份额	325,902,070.51	255,736,320.89	29,297.07
减:本报告期基 金总赎回份额	455,834,787.20	292,787,137.96	-
本报告期基金拆 分变动份额	-	-	-
本报告期期末基 金份额总额	748,722,186.10	46,751,625.08	29,297.07

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。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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(2009年07月01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54,000.00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通过监管检查验收。公司将从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

本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

本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(%)	
国信证券	2	799,122,228.70	50.37	140,558.96	50.36	
兴业证券	3	258,627,360.54	16.30	45,491.34	16.30	
广发证券	1	177,782,521.95	11.20	31,268.45	11.20	
华泰证券	2	89,818,773.65	5.66	15,799.16	5.66	
申万宏源证券	3	80,628,275.63	5.08	14,183.19	5.08	
中信建投证券	1	74,012,627.16	4.66	13,017.53	4.66	
国泰海通	6	59,470,901.51	3.75	10,460.31	3.75	
东方证券	6	47,194,544.13	2.97	8,301.98	2.97	
财通证	2	-	-	-	-	

券						
长城证 券	2	-	-	-	-	
长江证 券	1	-	-	-	-	
东北证 券	2	-	-	-	-	
东吴证 券	1	-	-	-	-	
东兴证 券	1	-	-	-	-	
国海证 券	2	-	-	-	-	
国联民 生	2	-	-	-	-	
恒泰证 券	2	-	-	-	-	
华安证 券	1	-	-	-	-	
摩根大 通证券	2	-	-	-	-	
平安证 券	3	-	-	-	-	
瑞银证 券	2	-	-	-	-	
信达证 券	1	-	-	-	-	
银河证 券	1	-	-	-	-	
中金财 富	2	-	-	-	-	
中金公 司	2	-	-	-	-	
中泰证 券	1	-	-	-	-	
中信证 券	4	-	-	-	-	

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

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 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	1,998,640.00	100.00	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 7 家证券公司的 15 个交易单元:国泰海通(深交所单元,上交所单

元)、平安证券(深交所单元)、申万宏源证券(深交所单元,上交所单元)、兴业证券(深交所单元,上交所单元)、中金财富(深交所单元,上交所单元)、中信建投证券(深交所单元,上交所单元)、中信证券(深交所单元,上交所单元);不再租用2家证券公司的4个交易单元:太平洋证券(深交所单元,上交所单元)、中信建投证券(深交所单元,上交所单元)。

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	关于汇添富上证综合指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年01月08日
2	汇添富上证综合指数证券投资基金收益分配公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年01月10日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2024年第四季度报告	上交所,深交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站,上证报	2025年01月22日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2024年年报	上交所,深交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年03月31日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024年度)	公司网站,中国证监会基金电子披露网站,上交所,深交所,上证报	2025年03月31日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2025年第一季度报告	上交所,深交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年04月22日
7	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年06月16日
8	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行(中国)有限公司合作关系的公告	上证报,中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025年06月26日
9	关于汇添富上证综合指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年07月07日
10	汇添富上证综合指数证券投资基金	上证报,公司网站,中	2025年07月09日

	金收益分配公告	中国证监会基金电子披露网站	
11	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,中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025 年 07 月 15 日
12	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	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2025 年 07 月 18 日
13	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	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,深交所,上交所	2025 年 07 月 18 日
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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 09 月 05 日
19	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
20	汇添富上证综合指数证券投资基金 Y 类份额开放日常申购、赎回和定期定额投资业务公告	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2025 年 10 月 29 日
21	汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025 年 10 月 29 日
22	汇添富上证综合指数证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025 年 10 月 29 日
23	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富上证综合指数证券投资基金增设 Y 类基金份额并修订基	中国证监会基金电子披露网站,公司网站,上证报	2025 年 10 月 29 日

	金合同、托管协议的公告		
24	汇添富上证综合指数证券投资基金更新招募说明书（2025 年 10 月 31 日更新）	中国证监会基金电子披露网站,公司网站	2025 年 10 月 31 日
25	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

注：无。

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上证综合指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富上证综合指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

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