

汇添富量化选股混合型证券投资基金 2025 年 中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1 资产负债表	20
6.2 利润表	21
6.3 净资产变动表	22
6.4 报表附注	24
§ 7 投资组合报告.....	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
7.3 期末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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	62
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	63
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	63

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§ 8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	65
§ 9 开放式基金份额变动.....	65
§ 10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§ 12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富量化选股混合型证券投资基金	
基金简称	汇添富量化选股混合	
基金主代码	018440	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 06 月 06 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	100,672,474.26	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富量化选股混合 A	汇添富量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	018440	018441
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	43,011,617.23	57,660,857.03

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理和严格的风险控制，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用基金管理人开发的多因子量化选股策略进行选股。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与业绩比较基准指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越业绩比较基准收益率的投资目标。本基金在股票投资过程中将坚持量化模型驱动的投资决策流程，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，力争基金资产长期稳定增值。本基金投资策略还包括资产配置策略、多因子量化选股策略、港股通标的股票的投资策略、存托凭证的投资策略、债券投资策略、可转债及可交换债投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*80%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%+中债综合指数收益率*10%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险与收益低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。 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。

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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	杨军智
	联系电话	021-28932888	010-60834299
	电子邮箱	service@99fund.com	yjz@citics.com
客户服务电话		400-888-9918	010-60836588
传真		021-28932998	010-60834004
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市朝阳区亮马桥路 48 号 中信证券大厦 5 层
邮政编码		200010	100125
法定代表人		鲁伟铭	张佑君

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日 – 2025 年 06 月 30 日)	
	汇添富量化选股混合 A	汇添富量化选股混合 C
本期已实现收益	1,495,624.23	179,592.63
本期利润	509,839.67	135,291.66
加权平均基金份额本	0.0092	0.0032

期利润		
本期加权平均净值利 润率	1.04%	0.37%
本期基金份额净值增 长率	1.24%	0.93%
3.1.2 期末数据和指 标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	-3,970,953.63	-5,967,264.61
期末可供分配基金份 额利润	-0.0923	-0.1035
期末基金资产净值	39,040,663.60	51,693,592.42
期末基金份额净值	0.9077	0.8965
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增 长率	-9.23%	-10.35%

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

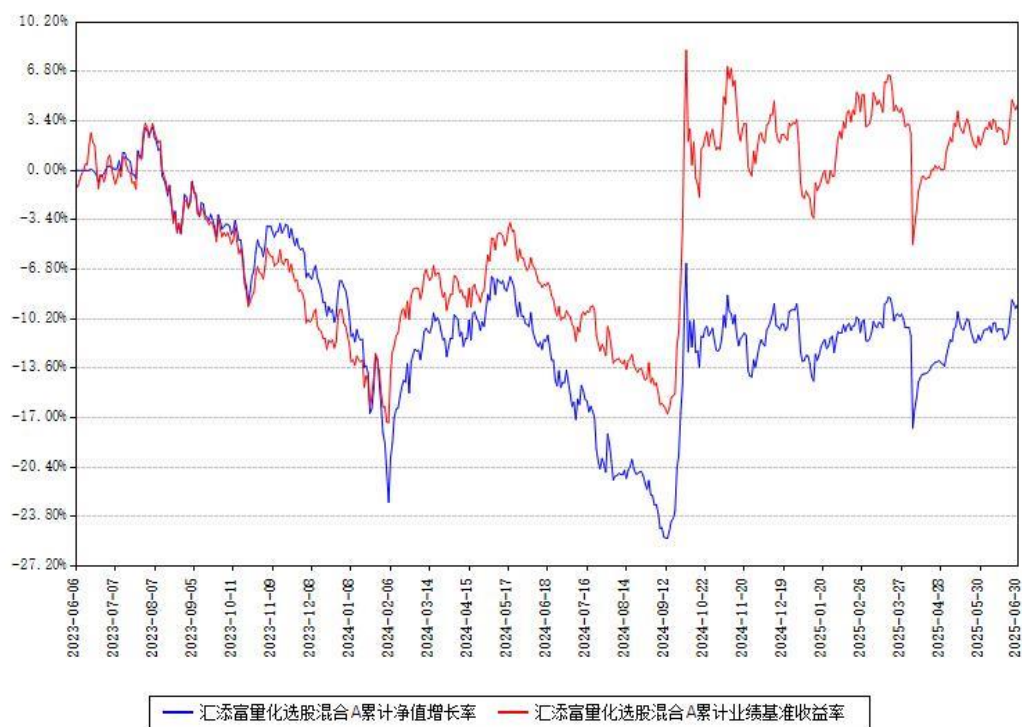
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富量化选股混合 A						
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去一 个月	2.76%	0.54%	2.69%	0.57%	0.07%	-0.03%
过去三 个月	1.76%	1.09%	1.43%	1.13%	0.33%	-0.04%
过去六 个月	1.24%	0.93%	2.53%	1.02%	-1.29%	-0.09%
过去一 年	6.25%	1.20%	16.22%	1.27%	-9.97%	-0.07%

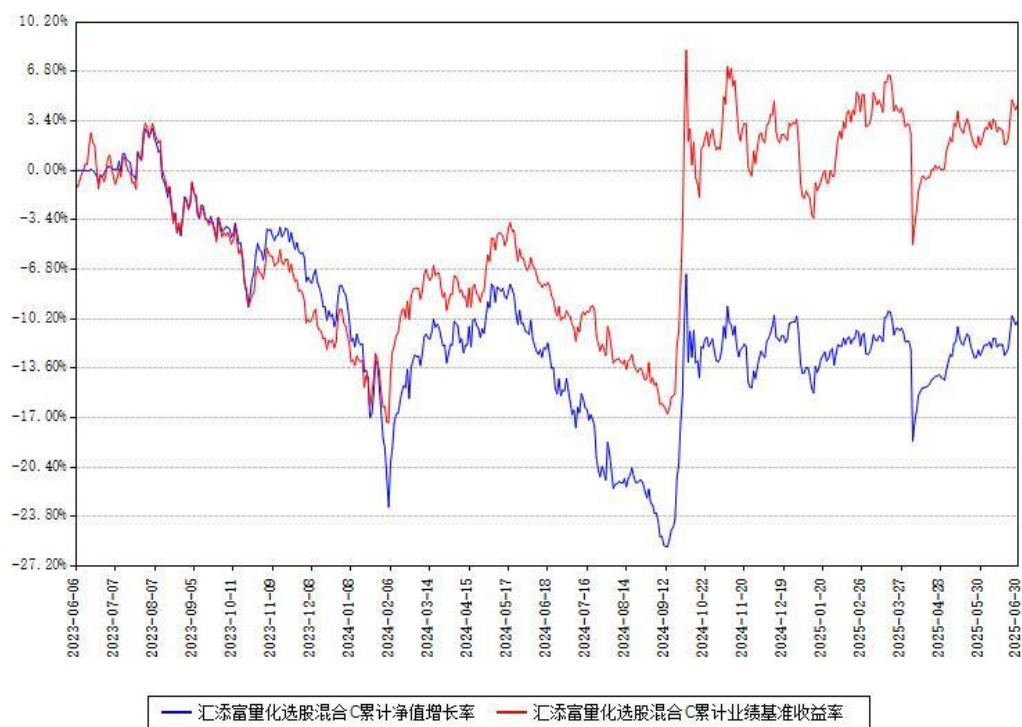
自基金 合同生 效起至 今	-9.23%	1.06%	4.48%	1.06%	-13.71%	0.00%
汇添富量化选股混合 C						
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去一 个月	2.70%	0.54%	2.69%	0.57%	0.01%	-0.03%
过去三 个月	1.61%	1.09%	1.43%	1.13%	0.18%	-0.04%
过去六 个月	0.93%	0.93%	2.53%	1.02%	-1.60%	-0.09%
过去一 年	5.62%	1.20%	16.22%	1.27%	-10.60%	-0.07%
自基金 合同生 效起至 今	-10.35%	1.06%	4.48%	1.06%	-14.83%	0.00%

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

汇添富量化选股混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富量化选股混合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 06 月 06 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2023 年 06 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 基金管理股份有 限公司，历任产 品开发高级经理、 数量投资高级分 析师、基金经理 助理，现任指数 与量化投资部副 总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇 添富上证综合指 数证券投资基金 的基金经理。 2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放 式指数证券投资 基金的基金经 理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任 汇添富深证 300 交易型开放式指 数证券投资基金 联接基金的基金 经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任 中证金融地产交 易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交 易型开放式指数 证券投资基金的
--	--	--	--	--	--

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

					日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至今任汇添富量化选股混
--	--	--	--	--	--

					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。
--	--	--	--	--	---

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司

决议确定的解聘日期。

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
吴振翔	公募基金	13	18,477,998,430.56	2010年2月6日
	私募资产管理计划	1	10,373,627.74	2025年3月11日
	其他组合	-	-	
	合计	14	18,488,372,058.30	

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，离任产品情况如下：

吴振翔—离任产品类型：公募基金，离任数量：1只，离任时间：2025年3月21日；离任产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0只，离任时间：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，A 股市场震荡较大的阶段主要是年初和 4 月初，其它阶段都是稳步修复性上涨态势，各宽基指数整体表现较好。风格上小盘优于大盘，成长优于价值，当前经济在结构转型阶段，市场往往也呈现出结构性特征。细分板块方面，科技、创新药等板块是阶段性市场关注焦点。

宏观经济上，外部环境是全球关税政策突发、地缘冲突等不确定因素持续冲击，但国内环境还是处于政策组合效应持续释放，整体上国民经济保持总体平稳、稳中有进的发展态势。

货币、财政、房地产、资本市场等一系列政策的推出，对于稳市场、稳预期发挥了重要作用。

虽然有外部环境不确定性的影响，但是在政策支持、基本面改善等因素的驱动下，上半年国内经济增长仍然实现了较好的结果，经济温和修复的背景下，上市公司基本面预期表现稳健，权益资产表现也得到了较好的支撑，当前 A 股主要宽基指数估值适中，具有较好的投资价值。

今年市场风格变化较快，本基金选择了相对均衡的量化模型来进行组合管理，以适应未来风格和行业变化的不确定性。

汇添富量化选股混合基金，旨在通过量化的投资方式，为投资者提供投资权益市场的工具品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富量化选股混合 A 类份额净值增长率为 1.24%，同期业绩比较基准收益率为 2.53%。本报告期汇添富量化选股混合 C 类份额净值增长率为 0.93%，同期业绩比较基准收益率为 2.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前外部环境出现了多方挑战，美国关税政策、地缘冲突等因素对全球的影响存在反复的可能。国内来看，2025 年上半年宏观经济温和修复，预计下半年有望保持韧性，CPI 数据上半年稳步增长，半年末社零数据明显走强，体现出内需修复的韧性。尽管生产端的 PPI 数据仍体现出一定压力，展望下半年，“反内卷”等政策有助于推进全国统一大市场建设，依法治理企业低价无序竞争，引导企业提升产品品质，相关价格条件或能有所改善。

当前权益市场交投较为活跃，随着经济环境的持续改善，市场风险偏好有望进一步提升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估

值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2025 年 1 月 2 日起至 2025 年 3 月 20 日，本基金连续 50 个工作日基金资产净值低于五千万元。自 2025 年 3 月 21 日起至报告期末，本基金未再出现基金资产净值预警情形。

§ 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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对汇添富量化选股混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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、基金份额申购赎回价格的计算以及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 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，由汇添富基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇添富量化选股混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告

相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6. 4. 7. 1	9, 692, 314. 56	4, 902, 807. 34
结算备付金		3, 162, 221. 05	3, 435. 88
存出保证金		874, 575. 00	—
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	77, 159, 097. 33	45, 952, 356. 93
其中：股票投资		77, 159, 097. 33	45, 952, 356. 93
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	6. 4. 7. 3	—	—
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	—	—
债权投资	6. 4. 7. 5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	3, 662. 40
应收申购款		2, 009. 25	51, 072. 36
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 6	—	—
资产总计		90, 890, 217. 19	50, 913, 334. 91
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		—	199, 084. 25

应付赎回款		10,481.96	220,549.34
应付管理人报酬		73,340.13	45,750.97
应付托管费		9,167.53	7,625.18
应付销售服务费		30,317.07	2,065.46
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	6.4.7.7	32,654.48	85,000.31
负债合计		155,961.17	560,075.51
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	100,672,474.26	56,200,817.40
未分配利润	6.4.7.9	-9,938,218.24	-5,847,558.00
净资产合计		90,734,256.02	50,353,259.40
负债和净资产总计		90,890,217.19	50,913,334.91

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 100,672,474.26 份。本基金下属汇添富量化选股混合 A 基金份额净值 0.9077 元，基金份额总额 43,011,617.23 份；本基金下属汇添富量化选股混合 C 基金份额净值 0.8965 元，基金份额总额 57,660,857.03 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		1,261,671.56	-3,504,896.44
1. 利息收入		20,821.04	13,416.90
其中：存款利息收入	6.4.7.10	20,524.93	13,416.90
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		296.11	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,157,436.02	-4,721,014.57
其中：股票投资收益	6.4.7.11	954,638.24	-5,646,642.23
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-107,855.83	-
股利收益	6.4.7.17	1,310,653.61	925,627.66

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-1,030,085.53	984,302.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	113,500.03	218,399.01
减：二、营业总支出		616,540.23	459,476.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	407,268.02	317,995.09
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	59,368.03	52,999.14
3. 销售服务费		108,587.77	17,324.20
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	41,316.41	71,158.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		645,131.33	-3,964,373.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		645,131.33	-3,964,373.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		645,131.33	-3,964,373.33

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	56,200,817.40	-5,847,558.00	50,353,259.40
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	56,200,817.40	-5,847,558.00	50,353,259.40
三、本期增减变动额（减少以	44,471,656.86	-4,090,660.24	40,380,996.62

“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	645,131.33	645,131.33
(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)	44,471,656.86	-4,735,791.57	39,735,865.29
其中: 1. 基金申购款	106,362,711.47	-11,669,075.48	94,693,635.99
2. 基金赎回款	-61,891,054.61	6,933,283.91	-54,957,770.70
(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	100,672,474.26	-9,938,218.24	90,734,256.02
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	62,217,711.63	-4,745,020.44	57,472,691.19
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	62,217,711.63	-4,745,020.44	57,472,691.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	857,075.03	-4,498,474.91	-3,641,399.88
(一)、综合收益总额	-	-3,964,373.33	-3,964,373.33
(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)	857,075.03	-534,101.58	322,973.45
其中: 1. 基金申购款	46,584,156.63	-5,633,855.57	40,950,301.06
2. 基金赎回款	-45,727,081.60	5,099,753.99	-40,627,327.61
(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	63,074,786.66	-9,243,495.35	53,831,291.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富量化选股混合型证券投资基金（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[2023]782 号文《关于准予汇添富量化选股混合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 6 月 6 日生效。首次设立基金募集规模为 340,035,180.67 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_B30 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，基金托管人为中信证券股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

2. 增值税

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

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

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

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

的基金管理人为增值税纳税人；

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

5. 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从

公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	19,322.80
等于：本金	17,849.71
加：应计利息	1,473.09
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	9,672,991.76
等于：本金	9,672,835.59
加：应计利息	156.17
减：坏账准备	-
合计	9,692,314.56

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	76,625,645.57	-	77,159,097.33	533,451.76
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		76,625,645.57	-	77,159,097.33	533,451.76

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	5,696,760.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	5,696,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,696,760.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买)	合约市值	公允价值变动
----	----	--------	------	--------

		/卖)		
IF2509	IF2509	5	5,830,500.00	133,740.00
合计				133,740.00
减：可抵销期货暂收款				133,740.00
净额				-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	7,439.10

应付信息披露费	24,795.19
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	420.19
合计	32,654.48

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富量化选股混合 A		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,764,688.65	51,764,688.65
本期申购	28,052,067.56	28,052,067.56
本期赎回（以“-”号填列）	-36,805,138.98	-36,805,138.98
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	43,011,617.23	43,011,617.23
汇添富量化选股混合 C		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,436,128.75	4,436,128.75
本期申购	78,310,643.91	78,310,643.91
本期赎回（以“-”号填列）	-25,085,915.63	-25,085,915.63
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	57,660,857.03	57,660,857.03

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富量化选股混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,276,632.25	924,937.41	-5,351,694.84
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-6,276,632.25	924,937.41	-5,351,694.84
本期利润	1,495,624.23	-985,784.56	509,839.67
本期基金份额交易产生的变动数	991,374.42	-120,472.88	870,901.54
其中：基金申购款	-2,670,700.51	-406,047.84	-3,076,748.35
基金赎回款	3,662,074.93	285,574.96	3,947,649.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,789,633.60	-181,320.03	-3,970,953.63
汇添富量化选股混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-573,908.91	78,045.75	-495,863.16
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-573,908.91	78,045.75	-495,863.16
本期利润	179,592.63	-44,300.97	135,291.66
本期基金份额交易产生的变动数	-5,324,958.47	-281,734.64	-5,606,693.11
其中：基金申购款	-7,989,200.71	-603,126.42	-8,592,327.13
基金赎回款	2,664,242.24	321,391.78	2,985,634.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,719,274.75	-247,989.86	-5,967,264.61

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	8,664.58
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	4,384.26
结算备付金利息收入	7,476.00
其他	0.09
合计	20,524.93

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	160,650,625.13
减：卖出股票成本总额	159,432,663.32
减：交易费用	263,323.57
买卖股票差价收入	954,638.24

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-
外汇期货投资收益	-
股指期货投资收益	-107,855.83
外汇远期投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,310,653.61
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	1,310,653.61

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,163,825.53
——股票投资	-1,163,825.53
——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	133,740.00
——权证投资	-
——期货投资	133,740.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,030,085.53

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	113,500.03
替代损益	-
其他	-
合计	113,500.03

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	7,439.10
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	-
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	82.12
合计	41,316.41

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	407,268.02	317,995.09

其中：应支付销售机构的客户维护费	72,952.36	109,494.06
应支付基金管理人的净管理费	334,315.66	208,501.03

注：2025 年 4 月 14 日前，本基金管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并履行适当程序，决定自 2025 年 4 月 14 日起，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

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。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	59,368.03	52,999.14

注：2025 年 4 月 14 日前，本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并履行适当程序，决定自 2025 年 4 月 14 日起，本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富量化选股混合 A	汇添富量化选股混合 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	56.80	56.80
中信证券股份有限公司	-	77,695.45	77,695.45
合计	-	77,752.25	77,752.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富量化选股混合 A	汇添富量化选股混合 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	26.82	26.82
合计	-	26.82	26.82

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 0.6%。

计算方法如下：

$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

务的情况

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025	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
-------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

年 06 月 30 日			1 年		上		
资产							
货币 资金	9,692,314.56	-	-	-	-	-	9,692,314.56
结算 备付 金	3,162,221.05	-	-	-	-	-	3,162,221.05
存出 保证 金	-	-	-	-	-	874,575.00	874,575.00
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	77,159,097.33	77,159,097.33
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	-	-	-	-	-	2,009.25	2,009.25
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	12,854,535.61	-	-	-	-	78,035,681.58	90,890,217.19
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	-	-	-	-	-	10,481.96	10,481.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	73,340.13	73,340.13
应付托管费	-	-	-	-	-	9,167.53	9,167.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30,317.07	30,317.07
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	-	-	-	-	-	32,654.48	32,654.48
负债	-	-	-	-	-	155,961.17	155,961.17

总计							
利率 敏感 度缺 口	12,854,535.61	-	-	-	-	77,879,720.41	90,734,256.02
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	4,902,807.34	-	-	-	-	-	4,902,807.34
结算 备付 金	3,435.88	-	-	-	-	-	3,435.88
存出 保证 金	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	45,952,356.93	45,952,356.93
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	-	-	-	-	-	3,662.40	3,662.40
应收 申购 款	-	-	-	-	-	51,072.36	51,072.36
递延 所得 税资	-	-	-	-	-	-	-

产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,906,243.22	-	-	-	-	46,007,091.69	50,913,334.91
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	-	-	-	-	-	199,084.25	199,084.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	220,549.34	220,549.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	45,750.97	45,750.97
应付托管费	-	-	-	-	-	7,625.18	7,625.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,065.46	2,065.46
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	-	-	-	-	-	85,000.31	85,000.31
负债 总计	-	-	-	-	-	560,075.51	560,075.51
利率 敏感 度缺 口	4,906,243.22	-	-	-	-	45,447,016.18	50,353,259.40

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
	-	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付	-	-	-	-

金				
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	4,459,030.73	-	4,459,030.73
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	-	3,662.40	-	3,662.40
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	4,462,693.13	-	4,462,693.13
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,462,693.13	-	4,462,693.13

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	-	223,134.66
	港币相对人民币贬值 5%	-	-223,134.66

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	77,159,097.33	85.04	45,952,356.93	91.26
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	77,159,097.33	85.04	45,952,356.93	91.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证 800 指数上涨 5%	3,768,427.71	2,080,311.82
	中证 800 指数下跌 5%	-3,768,427.71	-2,080,311.82

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 06 月 30 日
第一层次	77,159,097.33

第二层次	-
第三层次	-
合计	77,159,097.33

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	77,159,097.33	84.89
	其中：股票	77,159,097.33	84.89
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	12,854,535.61	14.14
8	其他各项资产	876,584.25	0.96
9	合计	90,890,217.19	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	527,790.00	0.58
B	采矿业	2,939,203.00	3.24
C	制造业	39,542,547.13	43.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,209,228.00	2.43
E	建筑业	1,728,793.00	1.91
F	批发和零售业	1,337,642.00	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	2,625,289.00	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,403,251.20	3.75
J	金融业	19,372,414.00	21.35
K	房地产业	658,617.00	0.73
L	租赁和商务服务业	874,852.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	824,421.00	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	543,896.00	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	331,968.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	239,186.00	0.26
S	综合	-	-
	合计	77,159,097.33	85.04

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	2,200	3,100,944.00	3.42
2	300750	宁德时代	9,000	2,269,980.00	2.50
3	600036	招商银行	46,200	2,122,890.00	2.34
4	601318	中国平安	35,500	1,969,540.00	2.17
5	300059	东方财富	59,400	1,373,922.00	1.51
6	601166	兴业银行	55,900	1,304,706.00	1.44
7	600900	长江电力	40,200	1,211,628.00	1.34
8	000333	美的集团	16,000	1,155,200.00	1.27
9	601899	紫金矿业	53,700	1,047,150.00	1.15
10	002594	比亚迪	3,000	995,730.00	1.10
11	601688	华泰证券	51,400	915,434.00	1.01
12	601398	工商银行	104,500	793,155.00	0.87
13	603259	药明康德	11,300	785,915.00	0.87
14	600276	恒瑞医药	14,500	752,550.00	0.83
15	000858	五 粮 液	6,000	713,400.00	0.79
16	000725	京东方 A	163,900	653,961.00	0.72
17	601211	国泰海通	33,400	639,944.00	0.71
18	601229	上海银行	58,100	616,441.00	0.68
19	000651	格力电器	13,500	606,420.00	0.67
20	600999	招商证券	33,100	582,229.00	0.64
21	601728	中国电信	71,900	557,225.00	0.61
22	300124	汇川技术	8,600	555,302.00	0.61
23	601328	交通银行	66,900	535,200.00	0.59
24	600887	伊利股份	19,000	529,720.00	0.58
25	000001	平安银行	43,800	528,666.00	0.58
26	601288	农业银行	89,700	527,436.00	0.58
27	600031	三一重工	28,400	509,780.00	0.56
28	000063	中兴通讯	15,500	503,595.00	0.56
29	002475	立讯精密	14,400	499,536.00	0.55
30	002415	海康威视	17,900	496,367.00	0.55
31	601919	中远海控	32,900	494,816.00	0.55
32	600919	江苏银行	41,400	494,316.00	0.54
33	688981	中芯国际	5,603	494,016.51	0.54
34	601816	京沪高铁	85,600	492,200.00	0.54
35	601169	北京银行	69,000	471,270.00	0.52
36	600690	海尔智家	18,500	458,430.00	0.51
37	600000	浦发银行	31,300	434,444.00	0.48
38	002142	宁波银行	15,700	429,552.00	0.47

39	600809	山西汾酒	2,400	423,336.00	0.47
40	600050	中国联通	79,100	422,394.00	0.47
41	000100	TCL 科技	97,200	420,876.00	0.46
42	000338	潍柴动力	27,300	419,874.00	0.46
43	000568	泸州老窖	3,600	408,240.00	0.45
44	300760	迈瑞医疗	1,800	404,550.00	0.45
45	002027	分众传媒	53,800	392,740.00	0.43
46	601818	光大银行	93,700	388,855.00	0.43
47	601857	中国石油	43,100	368,505.00	0.41
48	603288	海天味业	9,329	362,991.39	0.40
49	688256	寒武纪科技	600	360,900.00	0.40
50	601088	中国神华	8,800	356,752.00	0.39
51	000425	徐工机械	45,600	354,312.00	0.39
52	002371	北方华创	800	353,768.00	0.39
53	688041	海光信息	2,500	353,225.00	0.39
54	600660	福耀玻璃	6,100	347,761.00	0.38
55	600905	三峡能源	80,400	342,504.00	0.38
56	600089	特变电工	28,700	342,391.00	0.38
57	600048	保利发展	41,900	339,390.00	0.37
58	601601	中国太保	9,000	337,590.00	0.37
59	688111	金山办公	1,200	336,060.00	0.37
60	300015	爱尔眼科	26,600	331,968.00	0.37
61	601658	邮储银行	60,600	331,482.00	0.37
62	601390	中国中铁	58,500	328,185.00	0.36
63	601600	中国铝业	46,100	324,544.00	0.36
64	300014	亿纬锂能	7,000	320,670.00	0.35
65	002352	顺丰控股	6,500	316,940.00	0.35
66	601668	中国建筑	54,100	312,157.00	0.34
67	002714	牧原股份	7,400	310,874.00	0.34
68	002179	中航光电	7,700	310,772.00	0.34
69	600016	民生银行	65,100	309,225.00	0.34
70	300308	中际旭创	2,100	306,306.00	0.34
71	600585	海螺水泥	14,200	304,874.00	0.34
72	000538	云南白药	5,400	301,266.00	0.33
73	600015	华夏银行	37,800	298,998.00	0.33
74	300502	新易盛	2,340	297,226.80	0.33
75	300408	三环集团	8,700	290,580.00	0.32
76	300433	蓝思科技	12,900	287,670.00	0.32
77	002230	科大讯飞	6,000	287,280.00	0.32
78	601916	浙商银行	84,600	286,794.00	0.32
79	601127	赛力斯	2,000	268,640.00	0.30
80	603501	豪威集团	2,100	268,065.00	0.30

81	600309	万华化学	4,800	260,448.00	0.29
82	000157	中联重科	34,700	250,881.00	0.28
83	601669	中国电建	51,300	249,831.00	0.28
84	600941	中国移动	2,200	247,610.00	0.27
85	603019	中科曙光	3,500	246,400.00	0.27
86	002032	苏泊尔	4,700	246,233.00	0.27
87	000807	云铝股份	15,400	246,092.00	0.27
88	002001	新和成	11,400	242,478.00	0.27
89	002736	国信证券	20,800	239,616.00	0.26
90	601901	方正证券	30,000	237,300.00	0.26
91	002236	大华股份	14,700	233,436.00	0.26
92	601766	中国中车	33,000	232,320.00	0.26
93	300274	阳光电源	3,400	230,418.00	0.25
94	601868	中国能建	101,600	226,568.00	0.25
95	601117	中国化学	29,500	226,265.00	0.25
96	603369	今世缘	5,800	225,794.00	0.25
97	000630	铜陵有色	66,200	221,108.00	0.24
98	600741	华域汽车	12,500	220,625.00	0.24
99	002601	龙佰集团	13,600	220,456.00	0.24
100	600219	南山铝业	57,400	219,842.00	0.24
101	601633	长城汽车	10,200	219,096.00	0.24
102	300498	温氏股份	12,700	216,916.00	0.24
103	601319	中国人保	24,800	216,008.00	0.24
104	600362	江西铜业	9,200	215,556.00	0.24
105	600482	中国动力	9,300	214,551.00	0.24
106	002493	荣盛石化	25,900	214,452.00	0.24
107	601012	隆基绿能	14,200	213,284.00	0.24
108	688008	澜起科技	2,601	213,282.00	0.24
109	000895	双汇发展	8,700	212,367.00	0.23
110	601877	正泰电器	9,200	208,564.00	0.23
111	600406	国电南瑞	9,200	206,172.00	0.23
112	002938	鹏鼎控股	6,400	204,992.00	0.23
113	000596	古井贡酒	1,500	199,725.00	0.22
114	601618	中国中冶	66,600	198,468.00	0.22
115	600845	宝信软件	8,300	196,046.00	0.22
116	605117	德业股份	3,680	193,788.80	0.21
117	600028	中国石化	34,300	193,452.00	0.21
118	601138	工业富联	9,000	192,420.00	0.21
119	603277	银都股份	11,890	190,240.00	0.21
120	600332	白云山	7,200	189,792.00	0.21
121	600061	国投资本	25,000	188,000.00	0.21
122	300628	亿联网络	5,400	187,704.00	0.21
123	601799	星宇股份	1,500	187,500.00	0.21

124	300999	金龙鱼	6,300	186,039.00	0.21
125	600261	阳光照明	55,800	183,024.00	0.20
126	300388	节能国祯	26,200	182,352.00	0.20
127	603986	兆易创新	1,400	177,142.00	0.20
128	601607	上海医药	9,900	177,012.00	0.20
129	601006	大秦铁路	26,400	174,240.00	0.19
130	600496	精工钢构	52,300	167,360.00	0.18
131	600828	茂业商业	42,600	164,436.00	0.18
132	601225	陕西煤业	8,500	163,540.00	0.18
133	601985	中国核电	17,500	163,100.00	0.18
134	603989	艾华集团	10,400	160,160.00	0.18
135	688082	盛美上海 半导体	1,400	159,516.00	0.18
136	601018	宁波港	43,100	157,746.00	0.17
137	605365	立达信	10,600	156,138.00	0.17
138	600926	杭州银行	9,100	153,062.00	0.17
139	600104	上汽集团	9,400	150,870.00	0.17
140	000869	张裕A	7,000	148,610.00	0.16
141	688012	中微半导 体设备	800	145,840.00	0.16
142	688526	武汉科前 生物	9,146	142,494.68	0.16
143	600150	中国船舶	4,200	136,668.00	0.15
144	688100	威胜信息	3,609	133,713.45	0.15
145	600862	中航高科	4,900	127,792.00	0.14
146	601628	中国人寿	3,100	127,689.00	0.14
147	601988	中国银行	22,500	126,450.00	0.14
148	601168	西部矿业	7,600	126,388.00	0.14
149	605499	东鹏饮料	400	125,620.00	0.14
150	603328	依顿电子	12,800	125,568.00	0.14
151	000960	锡业股份	8,200	125,460.00	0.14
152	300724	捷佳伟创	2,300	124,890.00	0.14
153	688563	航空材料 股份	2,200	124,586.00	0.14
154	000050	深天马A	14,600	124,392.00	0.14
155	600038	中直股份	3,200	124,192.00	0.14
156	002138	顺络电子	4,400	123,728.00	0.14
157	688127	蓝特光学	4,800	123,408.00	0.14
158	300777	中简科技	3,400	123,250.00	0.14
159	000902	新洋丰	8,900	123,087.00	0.14
160	688366	昊海生物 科技	2,400	122,976.00	0.14
161	300088	长信科技	20,600	122,776.00	0.14

162	600885	宏发股份	5,500	122,705.00	0.14
163	600335	国机汽车	19,000	122,550.00	0.14
164	300319	麦捷科技	11,400	122,436.00	0.13
165	603233	大参林	7,500	122,250.00	0.13
166	300017	网宿科技	11,400	122,208.00	0.13
167	688819	天能电池 集团股份	4,400	122,144.00	0.13
168	002745	木林森	15,500	122,140.00	0.13
169	600888	新疆众和	17,900	122,078.00	0.13
170	002516	旷达科技	23,700	122,055.00	0.13
171	001311	多利科技	5,900	121,953.00	0.13
172	601311	骆驼股份	13,500	121,905.00	0.13
173	603730	岱美股份	21,420	121,879.80	0.13
174	603368	柳药集团	7,200	121,752.00	0.13
175	600508	上海能源	10,400	121,680.00	0.13
176	688029	南微医学 科技	1,800	121,590.00	0.13
177	688432	有研硅	11,000	121,440.00	0.13
177	688739	成大生物	4,600	121,440.00	0.13
179	601958	金钼股份	11,100	121,434.00	0.13
180	600380	健康元	11,000	121,330.00	0.13
181	600998	九州通	23,600	121,304.00	0.13
182	300360	炬华科技	7,700	121,275.00	0.13
183	600132	重庆啤酒	2,200	121,220.00	0.13
184	688188	上海柏楚 电子科技	920	121,127.20	0.13
185	002390	信邦制药	34,800	121,104.00	0.13
186	300226	上海钢联	5,300	121,052.00	0.13
187	688281	华秦科技 实业	2,000	121,020.00	0.13
188	600169	太原重工	50,000	121,000.00	0.13
189	600582	天地科技	20,200	120,998.00	0.13
190	600728	佳都科技	22,200	120,990.00	0.13
191	688128	中国电器 研究院	4,938	120,981.00	0.13
192	600873	梅花生物	11,300	120,797.00	0.13
193	000009	中国宝安	13,600	120,768.00	0.13
194	002266	浙富控股	39,200	120,736.00	0.13
195	601200	上海环境	15,200	120,688.00	0.13
196	300595	欧普康视	7,900	120,633.00	0.13
197	600299	安迪苏	12,500	120,625.00	0.13
198	600662	外服控股	23,600	120,596.00	0.13
198	603609	禾丰股份	14,600	120,596.00	0.13

200	601677	明泰铝业	9,700	120,474.00	0.13
201	600780	通宝能源	20,300	120,379.00	0.13
202	603877	太平鸟	8,300	120,350.00	0.13
203	000623	吉林敖东	7,100	120,345.00	0.13
204	000683	博源化工	25,100	120,229.00	0.13
205	688232	国泰新点软件	4,000	120,160.00	0.13
206	600075	新疆天业	28,400	120,132.00	0.13
207	600710	苏美达	12,500	120,125.00	0.13
208	601827	三峰环境	14,300	120,120.00	0.13
209	600572	康恩贝	27,400	120,012.00	0.13
210	600874	创业环保	20,100	119,997.00	0.13
211	000498	山东路桥	20,400	119,952.00	0.13
211	000563	陕国投A	33,600	119,952.00	0.13
213	603816	顾家家居	4,700	119,944.00	0.13
214	600717	天津港	26,300	119,928.00	0.13
215	002939	长城证券	14,300	119,834.00	0.13
216	601598	中国外运	24,300	119,799.00	0.13
217	688475	萤石网络	3,800	119,776.00	0.13
218	601696	中银证券	11,200	119,728.00	0.13
219	600757	长江传媒	12,900	119,712.00	0.13
220	688516	奥特维科技	3,600	119,664.00	0.13
221	600704	物产中大	22,700	119,629.00	0.13
222	600111	北方稀土	4,800	119,520.00	0.13
223	601811	新华文轩	8,200	119,474.00	0.13
224	603919	金徽酒	6,600	119,460.00	0.13
225	600007	中国国贸	5,800	119,364.00	0.13
226	600487	亨通光电	7,800	119,340.00	0.13
226	600517	国网英大	23,400	119,340.00	0.13
228	002091	江苏国泰	16,400	119,228.00	0.13
229	601326	秦港股份	36,900	119,187.00	0.13
230	000728	国元证券	15,100	119,139.00	0.13
231	600033	福建高速	33,600	118,944.00	0.13
232	600269	赣粤高速	23,500	118,910.00	0.13
233	600020	中原高速	24,800	118,544.00	0.13
234	300919	中伟股份	3,600	118,368.00	0.13
234	600675	中华企业	41,100	118,368.00	0.13
236	601997	贵阳银行	18,900	117,936.00	0.13
237	000783	长江证券	17,000	117,810.00	0.13
238	600909	华安证券	20,200	117,766.00	0.13
239	600938	中国海油	4,500	117,495.00	0.13
240	002936	郑州银行	57,000	117,420.00	0.13

241	600908	无锡银行	18,500	116,735.00	0.13
242	600928	西安银行	29,700	116,424.00	0.13
243	600497	驰宏锌锗	22,000	116,380.00	0.13
244	601009	南京银行	10,000	116,200.00	0.13
245	002705	新宝股份	7,900	116,130.00	0.13
246	688271	联影医疗	900	114,966.00	0.13
247	000625	长安汽车	8,800	112,288.00	0.12
248	601878	浙商证券	10,100	110,191.00	0.12
249	000792	盐湖股份	6,200	105,896.00	0.12
250	600760	中航沈飞	1,800	105,516.00	0.12
251	601939	建设银行	10,700	101,008.00	0.11
252	600436	片仔癀	500	100,005.00	0.11
253	601888	中国中免	1,600	97,552.00	0.11
254	002270	华明装备	5,700	95,418.00	0.11
255	600019	宝钢股份	14,200	93,578.00	0.10
256	600018	上港集团	16,000	91,360.00	0.10
257	002050	三花智控	3,400	89,692.00	0.10
258	601825	沪农商行	9,100	88,270.00	0.10
259	600547	山东黄金	2,700	86,211.00	0.10
260	603993	洛阳钼业	10,100	85,042.00	0.09
261	300033	同花顺	300	81,903.00	0.09
262	002241	歌尔股份	3,400	79,288.00	0.09
263	002463	沪电股份	1,850	78,773.00	0.09
264	600637	东方明珠	9,900	73,953.00	0.08
265	600755	厦门国贸	12,000	72,600.00	0.08
266	600415	小商品城	3,400	70,312.00	0.08
267	601989	中国重工	14,800	68,672.00	0.08
268	000977	浪潮信息	1,300	66,144.00	0.07
269	002267	陕天然气	8,700	65,859.00	0.07
270	000776	广发证券	3,600	60,516.00	0.07
271	601838	成都银行	3,000	60,300.00	0.07
272	002311	海大集团	1,000	58,590.00	0.06
273	600893	航发动力	1,500	57,810.00	0.06
274	601665	齐鲁银行	8,900	56,248.00	0.06
275	603799	华友钴业	1,500	55,530.00	0.06
276	600188	兖矿能源	4,400	53,548.00	0.06
277	000938	紫光股份	2,100	50,379.00	0.06
278	600570	恒生电子	1,500	50,310.00	0.06
279	600584	长电科技	1,400	47,166.00	0.05
280	601336	新华保险	800	46,800.00	0.05
281	600096	云天化	2,100	46,137.00	0.05
282	002028	思源电气	600	43,746.00	0.05
283	000002	万科A	6,800	43,656.00	0.05

284	601077	渝农商行	6,000	42,840.00	0.05
285	000166	申万宏源	8,200	41,164.00	0.05
286	600438	通威股份	2,000	33,500.00	0.04
287	002049	紫光国微	500	32,930.00	0.04
288	600563	法拉电子	300	32,727.00	0.04
289	688036	传音控股	400	31,880.00	0.04
290	600489	中金黄金	2,100	30,723.00	0.03
291	600795	国电电力	6,300	30,492.00	0.03
292	600010	包钢股份	17,000	30,430.00	0.03
293	601377	兴业证券	4,900	30,331.00	0.03
294	601100	恒立液压	400	28,800.00	0.03
295	002422	科伦药业	800	28,736.00	0.03
296	600160	巨化股份	1,000	28,680.00	0.03
297	600009	上海机场	900	28,593.00	0.03
298	601689	拓普集团	600	28,350.00	0.03
299	601995	中金公司	800	28,288.00	0.03
300	000963	华东医药	700	28,252.00	0.03
301	000768	中航西飞	1,000	27,340.00	0.03
302	002460	赣锋锂业	800	27,016.00	0.03
303	600745	闻泰科技	800	26,824.00	0.03
304	600886	国投电力	1,800	26,532.00	0.03
305	601186	中国铁建	3,300	26,433.00	0.03
306	002252	上海莱士	3,800	26,106.00	0.03
307	002555	三七互娱	1,500	25,935.00	0.03
308	600989	宝丰能源	1,600	25,824.00	0.03
309	002304	洋河股份	400	25,820.00	0.03
310	601881	中国银河	1,500	25,725.00	0.03
311	300394	天孚通信	320	25,548.80	0.03
312	601360	三六零	2,500	25,500.00	0.03
313	601788	光大证券	1,400	25,172.00	0.03
314	600115	中国东航	6,200	24,986.00	0.03
315	601058	赛轮轮胎	1,900	24,928.00	0.03
316	000975	山金国际	1,300	24,622.00	0.03
317	600183	生益科技	800	24,120.00	0.03
318	600426	华鲁恒升	1,100	23,837.00	0.03
319	001979	招商蛇口	2,700	23,679.00	0.03
320	601800	中国交建	2,600	23,114.00	0.03
321	600029	南方航空	3,900	23,010.00	0.03
322	600011	华能国际	3,200	22,848.00	0.03
323	600346	恒力石化	1,600	22,816.00	0.03
324	600196	复星医药	900	22,581.00	0.02
325	688126	上海硅产业集团	1,200	22,464.00	0.02

326	600674	川投能源	1,400	22,456.00	0.02
327	002466	天齐锂业	700	22,428.00	0.02
328	600066	宇通客车	900	22,374.00	0.02
329	301236	软通动力	400	21,856.00	0.02
330	300782	卓胜微	300	21,411.00	0.02
331	000408	藏格矿业	500	21,335.00	0.02
332	300347	泰格医药	400	21,328.00	0.02
333	601111	中国国航	2,700	21,303.00	0.02
334	600023	浙能电力	4,000	21,200.00	0.02
335	300661	圣邦股份	290	21,103.30	0.02
336	002648	卫星化学	1,200	20,796.00	0.02
337	003816	中国广核	5,700	20,748.00	0.02
338	600372	中航机载	1,700	20,502.00	0.02
339	002920	德赛西威	200	20,426.00	0.02
340	002271	东方雨虹	1,900	20,387.00	0.02
341	300418	昆仑万维	600	20,178.00	0.02
342	600588	用友网络	1,500	20,055.00	0.02
343	600460	士兰微	800	19,856.00	0.02
344	000661	长春高新	200	19,836.00	0.02
345	300442	润泽科技	400	19,812.00	0.02
346	002074	国轩高科	600	19,476.00	0.02
347	600176	中国巨石	1,700	19,380.00	0.02
348	000786	北新建材	700	18,536.00	0.02
349	002129	TCL 中环	2,400	18,432.00	0.02
350	603392	万泰生物	300	18,300.00	0.02
351	600085	同仁堂	500	18,030.00	0.02
352	001965	招商公路	1,500	18,000.00	0.02
353	600039	四川路桥	1,800	17,820.00	0.02
354	302132	中航成飞	200	17,588.00	0.02
355	300896	爱美客	100	17,481.00	0.02
356	600161	天坛生物	900	17,271.00	0.02
357	002916	深南电路	160	17,249.60	0.02
358	002600	领益智造	2,000	17,180.00	0.02
359	300759	康龙化成	700	17,178.00	0.02
360	300832	新产业	300	17,016.00	0.02
361	601021	春秋航空	300	16,695.00	0.02
362	002709	天赐材料	900	16,308.00	0.02
363	603296	华勤技术	200	16,136.00	0.02
364	002180	纳思达	700	16,058.00	0.02
365	000876	新希望	1,700	15,946.00	0.02
366	000301	东方盛虹	1,900	15,827.00	0.02
367	300122	智飞生物	800	15,672.00	0.02
368	601872	招商轮船	2,500	15,650.00	0.02

369	688223	晶科能源	3,000	15,570.00	0.02
370	600233	圆通速递	1,200	15,468.00	0.02
371	600875	东方电气	900	15,066.00	0.02
372	002459	晶澳科技	1,500	14,970.00	0.02
373	002812	恩捷股份	500	14,645.00	0.02
374	688599	天合光能	1,000	14,530.00	0.02
375	688396	华润微电子	306	14,430.96	0.02
376	600027	华电国际	2,600	14,222.00	0.02
376	601898	中煤能源	1,300	14,222.00	0.02
378	600515	海南机场	4,000	14,160.00	0.02
379	000999	华润三九	450	14,076.00	0.02
380	600600	青岛啤酒	200	13,892.00	0.02
381	300316	晶盛机电	500	13,575.00	0.01
382	000983	山西焦煤	2,100	13,440.00	0.01
383	600803	新奥股份	700	13,230.00	0.01
384	000617	中油资本	1,800	13,140.00	0.01
385	600918	中泰证券	2,000	12,860.00	0.01
386	600025	华能水电	1,300	12,415.00	0.01
387	301269	华大九天	100	12,388.00	0.01
388	601698	中国卫通	600	12,282.00	0.01
389	601238	广汽集团	1,600	11,984.00	0.01
390	601059	信达证券	700	11,970.00	0.01
391	002063	远光软件	2,000	11,900.00	0.01
392	300413	芒果超媒	500	10,910.00	0.01
393	600026	中远海能	1,000	10,330.00	0.01
394	601699	潞安环能	900	9,495.00	0.01
395	603260	合盛硅业	200	9,480.00	0.01
396	688009	中国通号	1,786	9,180.04	0.01
397	688472	阿特斯阳光电力	1,000	9,150.00	0.01
398	603806	福斯特	700	9,072.00	0.01
399	688187	时代电气	200	8,530.00	0.01
400	688303	大全能源	400	8,528.00	0.01
401	601236	红塔证券	1,000	8,470.00	0.01
402	000708	中信特钢	700	8,232.00	0.01
403	601136	首创证券	400	7,952.00	0.01
404	601865	福莱特	500	7,605.00	0.01
405	603195	公牛集团	140	6,755.00	0.01
406	603833	欧派家居	100	5,645.00	0.01
407	601808	中海油服	400	5,504.00	0.01
408	300979	华利集团	100	5,257.00	0.01
409	000800	一汽解放	700	4,802.00	0.01

410	600377	宁沪高速	300	4,602.00	0.01
411	001391	国货航	600	4,038.00	0.00
412	001289	龙源电力	100	1,618.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,362,162.00	8.66
2	600036	招商银行	3,219,462.00	6.39
3	300750	宁德时代	3,168,531.00	6.29
4	601318	中国平安	2,364,548.00	4.70
5	300059	东方财富	1,855,322.00	3.68
6	600900	长江电力	1,831,670.00	3.64
7	601166	兴业银行	1,583,374.00	3.14
8	000858	五粮液	1,487,733.00	2.95
9	601899	紫金矿业	1,446,189.00	2.87
10	002594	比亚迪	1,413,870.00	2.81
11	601398	工商银行	1,392,380.00	2.77
12	000333	美的集团	1,332,352.00	2.65
13	002475	立讯精密	1,207,878.00	2.40
14	601688	华泰证券	1,201,185.00	2.39
15	601088	中国神华	1,182,155.00	2.35
16	600999	招商证券	1,167,364.00	2.32
17	600000	浦发银行	1,160,484.00	2.30
18	000651	格力电器	1,027,911.00	2.04
19	002352	顺丰控股	1,020,263.00	2.03
20	603259	药明康德	1,002,622.00	1.99

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,062,511.00	4.10
2	600036	招商银行	1,935,552.00	3.84
3	300750	宁德时代	1,613,754.00	3.20
4	601318	中国平安	1,548,814.00	3.08

5	600000	浦发银行	1,209,865.00	2.40
6	601288	农业银行	961,626.00	1.91
6	01288	农业银行	164,686.84	0.33
7	600900	长江电力	1,053,200.00	2.09
8	300498	温氏股份	1,045,608.00	2.08
9	601398	工商银行	857,533.00	1.70
9	01398	工商银行	153,477.86	0.30
10	601088	中国神华	832,282.00	1.65
10	01088	中国神华	161,425.72	0.32
11	601899	紫金矿业	954,400.00	1.90
12	002475	立讯精密	920,821.00	1.83
13	601857	中国石油	696,053.00	1.38
13	00857	中国石油股份	169,895.30	0.34
14	601868	中国能建	844,086.00	1.68
15	000858	五 粮 液	833,694.00	1.66
16	300059	东方财富	833,028.00	1.65
17	000333	美的集团	820,322.00	1.63
18	002352	顺丰控股	817,933.00	1.62
19	601728	中国电信	628,452.00	1.25
19	00728	中国电信	159,739.22	0.32
20	600008	首创环保	781,075.00	1.55

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	191,801,861.61
卖出股票收入（成交）总额	160,650,625.13

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,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。

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。、

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	874,575.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,009.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	876,584.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级 别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	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 量化 选股 混合 A	938	45,854.60	174,710.09	0.41	42,836,907.14	99.59
汇添富 量化 选股 混合 C	272	211,988.44	53,989,650.17	93.63	3,671,206.86	6.37
合计	1,210	83,200.39	54,164,360.26	53.80	46,508,114.00	46.20

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 （%）
基金管理人所有	汇添富量化选股	9,394.72	0.02

从业人员持有本基金	混合 A		
	汇添富量化选股混合 C	206.45	0.00
	合计	9,601.17	0.01

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富量化选股混合 A	0
	汇添富量化选股混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富量化选股混合 A	0
	汇添富量化选股混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富量化选股混合 A	汇添富量化选股混合 C
基金合同生效日（2023 年 06 月 06 日）基金份额总额	255,059,835.31	84,975,345.36
本报告期期初基金份额总额	51,764,688.65	4,436,128.75
本报告期基金总申购份额	28,052,067.56	78,310,643.91
减：本报告期基金总赎回份额	36,805,138.98	25,085,915.63
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	43,011,617.23	57,660,857.03

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内无其他涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
长江证券	4	352,452,486.74	100.00	157,441.64	100.00	

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

合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
长江证券	-	-	3,000,000.00	100.00	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第四季度报告	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站,	2025 年 01 月 22 日

		上证报	
2	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
3	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
4	汇添富量化选股混合型证券投资基金托管协议	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 12 日
5	汇添富量化选股混合型证券投资基金基金合同	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 12 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于调低汇添富量化选股混合型证券投资基金管理费、托管费率并修改基金合同及托管协议的公告	证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 12 日
7	汇添富量化选股混合型证券投资基金更新招募说明书（2025 年 4 月 14 日更新）	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 14 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 22 日
9	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 16 日
10	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, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 20 日
11	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, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 20 日
12	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行（中国）有限公司合作关系的公告	上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2025 年 3 月 26 日至 2025 年 4 月 13 日, 2025 年 5 月 7 日至 2025 年 6 月 30 日	-	29,735,226.68	-	29,735,226.68	29.54
	2	2025 年 3 月 27 日至 2025 年 3 月 30 日, 2025 年 5 月 16 日至 2025 年 6 月 30 日	-	27,228,539.33	4,500,000.00	22,728,539.33	22.58
产品特有风险							
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。 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。 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。 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。

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富量化选股混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富量化选股混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富量化选股混合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、报告期内汇添富量化选股混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2025 年 08 月 29 日