汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证 券投资基金 2025 年第 3 季度报告

2025年09月30日

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期: 2025年10月28日

§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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 07 月 01 日起至 2025 年 09 月 30 日止。

§2基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富中证沪港深 500ETF	
场内简称	HGS500	
基金主代码	517080	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2021年02月01日	
报告期末基金份额总额(份)	305, 166, 000. 00	
机次口标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪	
投资目标	误差的最小化。	
	本基金主要采用完全复制法, 即完全按照标	
	的指数的成份股组成及其权重构建基金股票	
	投资组合,并根据标的指数成份股及其权重	
	的变化进行相应调整。但在因特殊情况(如	
投资策略	流动性不足等)导致本基金无法有效复制和	
	跟踪标的指数时,基金管理人将运用其他合	
	理的投资方法构建本基金的实际投资组合,	
	追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力	
	争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,	

	/		
	年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制		
	规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度		
	和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采		
	取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的		
	进一步扩大。本基金的投资策略主要包括:		
	资产配置策略、债券投资策略、资产支持证		
	券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与		
	融资投资策略、参与转融通证券出借业务策		
	略、存托凭证的投资策略。		
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率		
	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收		
	益高于混合型基金、债券型基金与货币市场		
	基金。同时本基金为指数基金,主要采用完		
 风险收益特征	全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指		
八四以血村证	数相似的风险收益特征。		
	本基金将投资港股通标的股票,将面临港股		
	通机制下因投资环境、投资标的、市场制度		
	以及交易规则等差异带来的特有风险。		
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		

注: 扩位证券简称: 沪港深 500ETF 基金。

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2025年07月01日 - 2025年09月30日)
1. 本期已实现收益	13, 306, 483. 10
2. 本期利润	61, 813, 991. 84
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 1578
4. 期末基金资产净值	317, 892, 547. 26
5. 期末基金份额净值	1.0417

- 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, 计入费用后实际收益水平 要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差	1)-3	2-4
过去三 个月	17. 99%	0. 78%	17.64%	0. 79%	0.35%	-0.01%
过去六 个月	21.33%	1.18%	19. 25%	1. 20%	2. 08%	-0.02%
过去一	27. 16%	1. 22%	25. 22%	1. 24%	1. 94%	-0.02%
过去三	49. 20%	1.12%	39.61%	1.13%	9. 59%	-0.01%
自基金 合同生 效起至 今	4. 17%	1.14%	-5. 06%	1.17%	9. 23%	-0. 03%

3. 2. 2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



汇添富中证沪港深500ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2021年02月01日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§4管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

44 <i>t</i> 7	TIT 夕	任本基金的基金经理其		证券从业年限	7유 메
姓名	职务	任职日期	离任日期	(年)	说明
董瑾	本基金的基金经理	2021 年 02 月 01 日	_	16	国籍:中国。学历 方经济量 : 中国。学历 方经济格: 此旁

		金管理股份有限
		公司产品经理,
		2015年9月至
		2016年10月任
		万家基金管理有
		限公司量化投资
		部基金经理助
		理。2016年11
		月加入汇添富基
		金管理股份有限
		公司。2017年
		12月18日至
		2019年12月31
		日任汇添富沪深
		300 指数型发起
		式证券投资基金
		(LOF) 的基金
		经理助理。2017
		年 12 月 18 日至
		2019年12月31
		日任汇添富中证
		全指证券公司指
		数型发起式证券
		投资基金
		(LOF) 的基金
		经理助理。2017
		年 12 月 18 日至
		2019年12月31
		日任中证上海国
		企交易型开放式
		指数证券投资基
		金联接基金的基
		金经理助理。
		2019年12月4
		日至今任汇添富
		沪深 300 交易型
		开放式指数证券
		投资基金的基金
		经理。2019年
		12月31日至今
		任汇添富沪深
		300 指数型发起
		式证券投资基金
		(LOF)的基金
		经理。2019 年
		25年。2019年 12月31日至
		14月31日王

		2023年5月8
		日任汇添富中证
		全指证券公司指
		数型发起式证券
		投资基金
		(LOF) 的基金
		经理。2019年
		12月31日至
		2023年8月29
		日任中证上海国
		企交易型开放式
		指数证券投资基
		金联接基金的基
		金经理。2020
		年3月5日至
		2023年8月29
		日任汇添富中证
		国企一带一路交
		易型开放式指数
		证券投资基金联
		接基金的基金经
		理。2021年2
		月1日至今任汇
		添富中证沪港深
		500 交易型开放
		式指数证券投资
		基金的基金经
		理。2021年8
		月9日至今任汇
		添富中证光伏产
		业交易型开放式
		指数证券投资基
		金的基金经理。
		2021年8月11
		日至 2022 年 5
		月 23 日任汇添
		富中证电池主题
		指数型发起式证
		券投资基金的基
		金经理。2022
		年1月26日至
		2022年10月11
		日任汇添富中证
		沪港深 500 交易
		型开放式指数证
		券投资基金联接

基金95 理。2022年4日汇 河。2022年4日汇主题是交证产业的政策。 金月128日至中世级对投资理。 2022年4日汇约数证券经验。 2022年4日汇查。 2022年6日汇至为财政基金的基金6月128日产业的政策基金的基金6月128日产业的政策基金的基金的月138日产业的政策基金的基金的月138日产业。 2022年6月13日产业证实易型产股资。 2022年6月13日产业证实易型产股资。 1月中证实易型产业。 2022年6日产业证实易型产业。 2023年7月11月中证实易型产业。 2023年7月128日日产业证实易证券投资。 2022年6日产业证实易证券汇款或基金的基金2月汇率的工作。 2023年11月中证实别产业的工作。 2022年11月中证实别产业的支票。 2022年11月中证实别产业的支票。 2022年11月中证实别产业的支票。 2022年11日中证业工作的支票。 2023年11日中证业工作的支票。 2023年11日中证业工作的支票。 2023年11日中证业工作的支票。 2023年11日中证金别产业的支票。			
月3日至今他汇溶容与地主题交易型。2022年4月28日 中证电池放式指数证券投经理。2022年4月28日 中证全指形所数式 指数正券投资 电元 2022年4月28日 中证全部 型开放式基金的基金经理。2022年6月13日至 中证型 大致基金的基金经理。2022年6月13日至 今任汇一带工工 国企一一 市			基金的基金经
添宫 对于			理。2022年3
题交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2022 年 4 月 28 日至今任汇添富 中证金指照疗器 械交易型券投资基 金的基金经里。 2022 年 5 月 23 日至今任汇添商 中证电形放式基金发 起式新投资基。2022 年 6 月 13 亩 中证 国金型开放式基金的 基金经理。2022 年 7 月 13 日至 9 位至,2022 年 7 月 13 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添产所做式 基金经理。 2022年 12 月 12 日至今任汇添产解 大型,是一个任产等器 大型,是一个任产等是一个任产等。是一个任产等是一个任产等。是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个			月3日至今任汇
指数证券投资基金的基金经理。 2022年4月28日至今任汇添容器中证金看医开放式指数证券经理,2022年5月28日至全任工态变易型开放资基金的基金发程,2022年6月1%高中正式指数证券投资。2022年6月1%日中正、1月28日任河水型开发强工。2022年7月13日至2023年1月28日任河水型开发强工作。1月28日任河水型开发资基金的基金经理。2022年7月11日至2023年1月29日至全指型开发资基金的基金经理。2022年1月29日至全指型表现证式指数证据或证据或证据或证据或证据或证据或证据或证据或证据或证据或证据或证据或证据或证			添富中证电池主
金的基金经理。 2022年4月28 日至全有月28 日至全有任江深宫中证金物屋开放式指数证券投资理。 2022年5月23 日至中间放基金的基金经理。 2022年6月23 日至中间放摄数证券投资基金的基金经理。2022年6月13宫中证型开放资基金的基金经理。2022年6月13宫中证国鱼型对投资基金的基金经理。2022年7月13日至2023年11月28日任江环交别证券企务理办公式指数数基金经理。2022年12月29日至全年2月20日至年2月21日日至至1日2日至2日2日2日2日2日2日2日2日2日2日2日2日2日2日2			题交易型开放式
2022 年 4 月 28 日至今任汇添富 中证金额富 被交易型外式 指数的基金经理。 2022 年 5 月 23 日至证电池主题变 易型开放基金发 起式给数。 证券投接基。2022 年 6 月 13 富 中 证告一个。 一个。 一个。 一个。 一个。 一个。 一个。 一个。 一个。 一个。			指数证券投资基
日至今任汇添富中证会相更开放式基金的基金经理。2022年5月23日至今任池戏式指数证券公型车6月23日至中地戏式指数证券投接建。2022年6月13届中证对成式基金的基金的基金公司工作数量。2022年6月13届中政大路数证券公司工作。2023年116日年还交易型开放式基金的基金公司车116年还交所开放证基金的基金全月29日至证金易型开放或基金的基金。2022年12月29日至证金易型开放资本,2023年17日日日至公司工作,2023年17日日日至公司工作,2023年17日日日至公司工作,2023年17日日日正细公司工作,2023年17日日日至公司工作,2023年17日日日至公司工作,2023年17日日日至公司工作,2023年17日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日			金的基金经理。
中证全指医疗放式 指数证券投资理。 2022年5月23 日至今任汇率题交易型开放式者数证券投资理。 2022年6月13官中地放式者金仓的基金全户。 是全个任汇等型,2022年6月13富中政武者全个人在一个人工。 是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个			2022年4月28
被交易型开放式 指数证券全经理。 2022年 6 月 23 日至证电池式指数 证券投资基金发 起式或联接基金的基金发起式或要型开放或基金的基金经理。2022年 6 月 13 官 中证 国成企工作放了基金的基金经理。2022年 7 月 13 日至 2023年 11 月 28 日任汇深变所被中和交易型开放或基金的基金经理。 2022年 12 月 29 日至任汇库增、被交易型升投资基金的基金经理。 2022年 12 月 29 日至证金据的基金经理。 2022年 12 月 29 日至证金据更为资本。 2023年 1月 16 日至今任汇后产器,被交易建工的基金。 2023年 1月 16 日至今是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是			日至今任汇添富
指数证券投资基金的基金经理。 2022年5月23日至今任汇添富中证电池主题指数证券投资基金发易型外放基金发息式联接基金的基金经理。2022年6月13日至今任汇标带一放式基金的基本处理。2022年7月13日至2023年11月28日任汇环交所被中和交易型券投经理。2022年12月29日至今任汇标对数证券投经理。2022年12月29日至今任指账疗放式指数证必数证券投经理。2022年12月29日至今任指账疗放式指数证证公司。2023年1月16日至今任为证证金经的基金发的基金经的基金分的基金分的基金分的基金分别基础分别基础分别。2023年1月16日至今任介色金属产业主题交易型开放式指数证			中证全指医疗器
金的基金经理。 2022年5月23日至今任汇率官中证电池主通数 日至今任汇题数 证券投资基金的基金经理。2022年6月13日至 今任汇率常一成式。 一个任汇率常一成工作。 一个任汇率。2022年7月13日至 2023年11月28日任汇添京所放支基金的基金经理。2022年7月29日至今任汇海路数证券投资理。2022年12月添富中证全指医疗法,指数证式联接基金的基金经理。2023年1月16日至今任汇有高中证金量量,2023年1月16日至今任汇有色金属产业主题数证			械交易型开放式
2022年5月23日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式张接基金发起式张接基金002年6月13日至今任汇添富中证国金企一带改多型开放式基金的基金经理。2022年7月13日至2023年11月28日任汇添产所放式指数证券投资基金的基金经理。2022年12月29日至今任汇率的基金发起式联理。2022年12月29日至今任汇率持数证券投资基金的基金工式联接基金的基金全工产的基金发起式联接基金的基金全工产的基础,是2023年1月16日至今任汇添高中证细处的基础。2023年1月16日至今任汇添高中证细数证			指数证券投资基
日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金全型。2022年6月13日至一个任汇添富中游交易型开放式基金的基金型开放交易型开放资基金的基金型开放资格的基金型开放资格。2022年7月13日至2023年11月28日任汇添高所读时、出海环型型开放资基金的基金经过。2022年12月29日至今任汇库对对指数证券投资理。2022年12月29日至今任汇库,增数证券联接基金的基金发起式联理基金的基金发起式联理基金的基金发起式联基金的基金发展,2023年1月16日至今任汇高中证细户规模数证			金的基金经理。
中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式指数证券投资基金的基金经理。2022年6月13日至今任汇添富中证国金企一带或多型开设基金的基金经理。2022年7月13日至2023年11月28日任汇添富中证上海环交所放武指数延差金约理。2022年12月29日至今任汇添清器被交易型开放式指数证券投资基金的超速分别,并且是一个证券,是一个一个证券,是一个工人,是一个一个证券,是一个工人,是一个一个工人,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个			2022年5月23
中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式指数证券投资基金的基金经理。2022年6月13日至今任汇添富中证国金企一带或多型开设基金的基金经理。2022年7月13日至2023年11月28日任汇添富中证上海环交所放武指数延差金约理。2022年12月29日至今任汇添清器被交易型开放式指数证券投资基金的超速分别,并且是一个证券,是一个一个证券,是一个工人,是一个一个证券,是一个工人,是一个一个工人,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个			日至今任汇添富
证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022年6月13日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年7月13日至2023年11月28日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资理。2022年12月29日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			
起式联接基金的基金经理。2022年6月13日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年7月13日至2023年11月28日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资理。2022年12月29日至全任汇汇营事中证券型型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			易型开放式指数
基金经理。2022 年6月13日至 今任汇添富中证 国企一带一路交 易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2022 年7月13日至 2023年11月28 日任汇添富中证 上海环交所碳中和交易型开放式 指数证券投理。 2022年12月29日至今任汇添富 中证全指医疗器 械交易型开放式 指数证券投接基 金发起式联接基 金的基金经理。 2023年1月16 日至今任汇添富 中证细分有色金 属产业主题交易 型开放式指数证			证券投资基金发
年6月13日至 今任汇添富中证 国企一带一路交 易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2022年7月13日至 2023年11月28日任汇添富中证 上海环交所碳中 和交易型开放式 指数证券投资基金的基金经理。 2022年12月29日至今任汇添富 中证全指医疗器 械交易型开放式 指数证券投资基金的基金发起式联接基金的基金经理。 2023年1月16日至今任汇添富 中证细分有色金属产业主题交易 型开放式指数证			起式联接基金的
今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年7月13日至2023年11月28日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年12月29日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			基金经理。2022
国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年7月13日至2023年11月28日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年12月29日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			年 6 月 13 日至
易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2022 年7月13日至 2023年11月28日任汇添富中证 上海环交所碳中和交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2022年12月29日至今任汇添富 中证全指医疗器 械交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2023年1月16日至今任汇添富 中证细分有色金 属产业主题交易 型开放式指数证			今任汇添富中证
证券投资基金的基金经理。2022年7月13日至2023年11月28日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年12月29日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			国企一带一路交
基金经理。2022 年7月13日至 2023年11月28 日任汇添富中证 上海环交所碳中 和交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2022年12月29 日至今任汇添富 中证全指医疗器 械交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基 金的基金经理。 2023年1月16 日至今任汇添富 中证细分有色金 属产业主题交易 型开放式指数证			易型开放式指数
年7月13日至2023年11月28日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年12月29日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			证券投资基金的
2023年11月28 日任汇添富中证 上海环交所碳中和交易型开放式 指数证券投资基金的基金经理。 2022年12月29 日至今任汇添富 中证全指医疗器械交易型开放式 指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 2023年1月16 日至今任汇添富 中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			基金经理。2022
日任汇添富中证 上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2022年12月29日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			年7月13日至
上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年12月29日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			2023年11月28
和交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2022 年 12 月 29 日至今任汇添富 中证全指医疗器 械交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基 金的基金经理。 2023 年 1 月 16 日至今任汇添富 中证细分有色金 属产业主题交易 型开放式指数证			日任汇添富中证
指数证券投资基金的基金经理。 2022年12月29日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			上海环交所碳中
金的基金经理。 2022年12月29日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			和交易型开放式
2022年12月29 日至今任汇添富 中证全指医疗器 械交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基 金的基金经理。 2023年1月16 日至今任汇添富 中证细分有色金 属产业主题交易 型开放式指数证			指数证券投资基
日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			金的基金经理。
中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			2022年12月29
械交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基 金的基金经理。 2023年1月16 日至今任汇添富 中证细分有色金 属产业主题交易 型开放式指数证			日至今任汇添富
指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 2023年1月16 日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			中证全指医疗器
金发起式联接基金的基金经理。 2023年1月16 日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			械交易型开放式
金的基金经理。 2023年1月16 日至今任汇添富 中证细分有色金 属产业主题交易 型开放式指数证			指数证券投资基
2023 年 1 月 16 日至今任汇添富 中证细分有色金 属产业主题交易 型开放式指数证			金发起式联接基
日至今任汇添富 中证细分有色金 属产业主题交易 型开放式指数证			金的基金经理。
中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证			
属产业主题交易 型开放式指数证			日至今任汇添富
型开放式指数证			中证细分有色金
			属产业主题交易
<u> </u>			型开放式指数证
			券投资基金的基

		金经理。2023
		年 2 月 27 日至
		今任汇添富中证
		全指证券公司交
		易型开放式指数
		证券投资基金的
		基金经理。2023
		年4月6日至今
		任中证能源交易
		型开放式指数证
		差力 版式 情
		金经理。2023
		·
		年4月13日至
		2025年3月21
		日任汇添富中证
		环境治理指数型
		证券投资基金
		(LOF)的基金经
		理。2023年4
		月 13 日至 2024
		年 6 月 11 日任
		汇添富中证港股
		通高股息投资指
		数发起式证券投
		资基金(LOF)
		的基金经理。
		2023年5月9
		日至今任汇添富
		中证全指证券公
		司交易型开放式
		指数证券投资基
		金联接基金
		(LOF) 的基金
		经理。2023年8
		月 23 日至 2024
		年 10 月 26 日任
		汇添富中证沪港
		深消费龙头指数
		型发起式证券投
		资基金的基金经
		理。2023年9
		•
		月13日至2025
		年3月21日任
		汇添富中证
		2000 交易型开
		放式指数证券投

		资基金的基金经
		理。2024年4
		月 24 日至 2025
		年8月18日任
		汇添富中证港股
		通高股息投资交
		易型开放式指数
		证券投资基金的
		基金经理。2024
		年 6 月 12 日至
		2025年8月18
		日任汇添富中证
		港股通高股息投
		资交易型开放式
		指数证券投资基
		金联接基金
		(LOF) 的基金
		经理。2025年3
		月 21 日至今任
		汇添富中证细分
		有色金属产业主
		题交易型开放式
		指数证券投资基
		金发起式联接基
		金的基金经理。
		2025年5月22
		日至今任汇添富
		中证港股通汽车
		产业主题交易型
		开放式指数证券
		投资基金的基金
		经理。2025年7
		月2日至今任汇
		添富沪深 300 交
		易型开放式指数
		证券投资基金发
		起式联接基金的
		基金经理。

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。

本基金的基金经理董瑾女士因休产假,于 2025 年 9 月 29 日起超过 30 日无法正常履行职务。 依据法律法规及公司制度规定,本公司研究决定,董瑾女士休假期间,本基金由晏阳先生代 为履行基金经理职责。(详情请见基金管理人 2025 年 9 月 26 日发布的《汇添富基金管理股 份有限公司关于代为履行基金经理职责的公告》)。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期內遵守《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 公平交易专项说明

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:

- 一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程,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。
- 二、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中的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。
- 三、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。

四、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%的次数为 0。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

国家统计局数据显示,随着宏观政策持续发力,国民经济运行总体平稳,高质量发展扎实推进。政策方面,中央政治局会议强调要保持政策连续性稳定性,增强灵活性预见性,着力稳就业、稳企业、稳市场、稳预期。宏观政策要持续发力、适时加力,落实落细更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策。

三季度,权益市场整体表现良好,市场情绪明显回暖。风格上来看,大中小盘表现较为均衡;成长风格表现突出,优于价值、红利。行业主题方面,科技、新能源、有色等行业板块表现居前,而银行、综合金融等行业略有调整。

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

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为17.99%。同期业绩比较基准收益率为17.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	296, 186, 589. 15	91.51

	其中: 股票	296, 186, 589. 15	91. 51
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	20, 695, 661. 88	6. 39
8	其他资产	6, 798, 007. 28	2. 10
9	合计	323, 680, 258. 31	100.00

注:本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 143,197,420.90 元,占期末净值比例为 45.05%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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, 423, 308. 00	0.45
В	采矿业	7, 881, 865. 05	2. 48
С	制造业	88, 629, 745. 63	27. 88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4, 134, 531. 00	1.30
Е	建筑业	2, 221, 661. 40	0.70
F	批发和零售业	363, 637. 45	0. 11
G	交通运输、仓储和邮政业	4, 168, 520. 00	1. 31
Н	住宿和餐饮业	_	_
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	7, 855, 320. 66	2. 47
J	金融业	31, 949, 522. 66	10.05

K	房地产业	923, 008. 00	0. 29
L	租赁和商务服务业	1, 122, 742. 00	0. 35
M	科学研究和技术服务业	1, 991, 813. 30	0. 63
N	水利、环境和公共设施管理业	_	_
0	居民服务、修理和其他服务业	_	_
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	323, 493. 10	0. 10
R	文化、体育和娱乐业	_	-
S	综合	_	-
	合计	152, 989, 168. 25	48. 13

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值 (人民币)	占基金资产净值比例 (%)
10 能源	4, 192, 679. 88	1.32
15 原材料	1, 552, 339. 89	0.49
20 工业	4, 988, 203. 19	1.57
25 可选消费	34, 108, 680. 84	10.73
30 日常消费	3, 556, 047. 07	1.12
35 医疗保健	5, 773, 037. 31	1.82
40 金融	40, 369, 017. 54	12.70
45 信息技术	10, 873, 606. 41	3.42
50 电信服务	30, 207, 219. 65	9.50
55 公用事业	3, 207, 676. 71	1.01

60 房地产	4, 368, 912. 41	1. 37
合计	143, 197, 420. 90	45.05

注: (1) 以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

- (2) 由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。
- 5.3 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
- 5.3.1报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	00700	腾讯控 股	40,000	24, 212, 229. 60	7. 62
2	09988	阿里巴 巴-W	120, 400	19, 456, 334. 18	6. 12
3	00005	汇丰控 股	109, 600	10, 946, 849. 32	3. 44
4	300750	宁德时代	15, 340	6, 166, 680. 00	1.94
5	601318	中国平安	61,000	3, 361, 710.00	1.06
5	02318	中国平安	47, 500	2, 300, 595. 48	0.72
6	01810	小米集 团-W	114,000	5, 620, 304. 88	1.77
7	00939	建设银行	760, 000	5, 190, 108. 70	1.63
7	601939	建设银行	48, 300	415, 863. 00	0. 13

8	01299	友邦保	66, 000	4, 498, 161. 16	1.41
o .	01233	险	00,000	1, 130, 101. 10	1. 11
9	01398	工商银	549,000	2, 877, 037. 35	0.91
9	01398	行	549,000	2, 611, 031. 33	0.91
9	601398	工商银	107 700	1 442 910 00	0.45
9	001390	行	197, 700	1, 443, 210. 00	0.45
10	600036	招商银	70, 800	2,861,028.00	0.90
10	600036	行	70,800	2, 801, 028. 00	0.90
10	02069	招商银	27 500	1 174 000 00	0.27
10	03968	行	27, 500	1, 174, 000. 98	0. 37

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告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。

- 5.5 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债券投资明细注:本基金本报告期末未持有债券。
- 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7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。

- 5.8 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权证投资明细注:本基金本报告期末未持有权证投资。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值变动	风险说明
----	----	-----	----------	--------	------

		(买/		(元)	
		卖)			
IF2512	IF2512	11.00	15, 249, 960. 00	2, 874, 341. 25	
	2, 874, 341. 25				
	股指期货投资本期收益(元) 1,063,636.6				
	2, 363, 561. 25				

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以降低交易成本,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5. 11. 1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、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。

5. 11. 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1, 837, 570. 84
2	应收证券清算款	4, 680, 077. 05
3	应收股利	280, 359. 39
4	应收利息	_
5	应收申购款	_
6	其他应收款	_

7	待摊费用	-
8	其他	_
9	合计	6, 798, 007. 28

5.11.4 报告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。

- 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
- 5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§6开放式基金份额变动

单位: 份

本报告期期初基金份额总额	433, 166, 000. 00
本报告期基金总申购份额	_
减:本报告期基金总赎回份额	128, 000, 000. 00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	305, 166, 000. 00

注: 总申购份额含红利再投、转换入份额, 总赎回份额含转换出份额。

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

- 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
- 注: 本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。
- 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
- 注: 本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8影响投资者决策的其他重要信息

- 8.1 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
- 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 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

9.3 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10月28日