

汇添富中证新能源汽车产业指数量型发起式证券投资基金（LOF）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 | 汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF） |
| 基金主代码 | 501057 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年05月23日 |
| 报告期末基金份额总额(份) | 3,794,292,725.26 |
| 投资目标 | 本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对 |

| | | |
|--------------------|---|---------------------------|
| | 本基金跟踪标的指数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，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。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%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 中证新能源汽车产业指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5% | |
| 风险收益特征 | 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，具有与标的指数相似的风险收益特征。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) A | 汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) C |
| 下属分级基金场内简称 | 新能源车 | 新能车 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 501057 | 501058 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 2,184,842,304.53 | 1,609,450,420.73 |

注：汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A类份额扩位证券简称：新能源车 LOF；汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C类份额扩位证券简称：新能源车 LOFC。

§ 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) |
|--------|--------------------------------|
|--------|--------------------------------|

| | 汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) A | 汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) C |
|----------------|---------------------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -111,543,549.56 | -84,096,221.62 |
| 2.本期利润 | 1,939,860,589.97 | 1,403,820,119.64 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.7844 | 0.7622 |
| 4.期末基金资产净值 | 5,553,250,511.93 | 4,011,688,045.89 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.5417 | 2.4926 |

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

| 汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) 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 | 47.89% | 1.61% | 48.26% | 1.63% | -0.37% | -0.02% |
| 过去六个月 | 46.23% | 1.74% | 46.32% | 1.75% | -0.09% | -0.01% |
| 过去一年 | 52.19% | 2.01% | 52.52% | 2.03% | -0.33% | -0.02% |
| 过去三年 | 8.10% | 1.80% | 5.77% | 1.83% | 2.33% | -0.03% |
| 过去五年 | 76.29% | 2.06% | 72.73% | 2.07% | 3.56% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 154.17% | 1.95% | 92.37% | 1.99% | 61.80% | -0.04% |

| 汇添富中证新能源汽车产业指数(LOF) C | | | | | | |
|-----------------------|-------|------|-------|------|-----|-----|
| 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 | | |
|------------|---------|---------|--------|-----------|--------|--------|
| 过去三个月 | 47.81% | 1.61% | 48.26% | 1.63% | -0.45% | -0.02% |
| 过去六个月 | 46.05% | 1.74% | 46.32% | 1.75% | -0.27% | -0.01% |
| 过去一年 | 51.81% | 2.01% | 52.52% | 2.03% | -0.71% | -0.02% |
| 过去三年 | 7.30% | 1.80% | 5.77% | 1.83% | 1.53% | -0.03% |
| 过去五年 | 74.10% | 2.06% | 72.73% | 2.07% | 1.37% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 149.26% | 1.95% | 92.37% | 1.99% | 56.89% | -0.04% |

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

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）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（2018年05月23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

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 (年) | 说明 |
|-----|----------------------|-------------|------|---------------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 过蓓蓓 | 本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监 | 2018年05月23日 | - | 14 | 国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金管理从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2015年8月3日至今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。2015年8月3日至2023年4月13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。2015年8月3日至2023年4月6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。2015年8月3日至今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。2015年8月3日至今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。2015年8月18日至2023年8月29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。2015年8月18日至2023年5月22日任深证300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 汇添富中证生物 科技主题指类型 发起式证券投资基 金（LOF）的 基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2022 年 12 月 1 日任汇添富中证 中药指类型发起 式证券投资基金 (LOF) 的基金经 理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添 富中证新能源汽 车产业指类型发 起式证券投资基金 （LOF）的基 金经理。2018 年 10 月 23 日至 2023 年 5 月 22 日任中证银行交 易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2019 年 3 月 26 日至 今任汇添富中证 医药卫生交易型 开放式指数证券 投资基金联接基 金的基金经理。 2019 年 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证 银行交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金的 基金经理。2019 年 10 月 8 日至 今任中证 800 交 易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2021 年 2 月 1 日至今 任汇添富国证生 物医药交易型开 |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 放式指数证券投资基金的基金经理。2021年6月3日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年9月29日至2023年5月18日任汇添富中证800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2月28日至2022年10月31日任汇添富国证生物医药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8月15日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)的基金经理。2022年9月26日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基 金的基金经理。2022年10月20日至2024年4月8日任汇添富中证100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年12月2日至今任汇添富中证中药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3 月14日至今任 汇添富纳斯达克 生物科技交易型 开放式指数证券 投资基金发起式 联接基金 (QDII) 的基金 经理。2023年3 月30日至今任 汇添富纳斯达克 100交易型开放 式指数证券投资 基金(QDII)的 基金经理。2023 年8月2日至今 任汇添富纳斯达 克100交易型开 放式指数证券投资 基金发起式联 接基金(QDII) 的基金经理。 2023年8月23 日至今任汇添富 黄金及贵金属证 券投资基金 (LOF)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。

4.1.1 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 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

2025年三季度，宏观经济延续恢复、稳中有进，结构分化较为明显。出口和工业生产保

持强劲，但内需持续偏弱。工业生产中的装备制造业和高技术制造业增势良好，成为拉动经济增长的重要力量。社零增速放缓至 3.3%，房地产投资下滑、基建投资动力不足均对经济产生拖累。核心 CPI 环比持平、改善有限，非食品项回升托底 CPI，主要受益于反内卷措施和消费补贴政策对冲了价格和收入低迷对消费能力的影响。但过于依赖政策表明 CPI 下滑的压力仍然没有得到明显缓解，仍需观察需求改善的效果。整个经济体显现出新经济维持高景气、传统经济持续调整、内需依旧不足的结构分化特征。

在国内市场，当前行情的主要驱动力依然是流动性。货币政策层面，央行强调“宏观审慎”，并未提及降准降息，维护了金融稳定和债券市场的波动性，但对提振内需效果不足。需求不足的背景下，M1-M2 增速差走阔，反映出“活钱”增多、流动性充裕，加大了资金向资本市场流动的动力，推动了市场成交额的持续放大，两融余额维持在高位。换句话说，资本市场正在经历“流动性驱动”的阶段，但尚未全面进入“盈利驱动”的阶段，未来能否完成这一接棒，仍需观察社融与企业盈利的变化。

市场整体风格向景气成长板块集中，小微盘不再持续占优，而科技和周期的双轮驱动越发清晰，大消费板块却因为缺乏基本面和事件驱动而表现平淡。一级行业方面，信息、通信、材料涨幅居前，消费、公用事业、能源涨幅居后，金融行业表现垫底。同样的情景也发生在发达市场，MSCI 一级行业中的通信服务、工业、信息技术等板块也是涨幅居前，而能源、公用事业、地产等顺周期行业则相对落后。这表明，全球先进制造业率先进入修复预期，科技板块成为带动行情的核心力量，这与全球降息预期的升温密切相关，市场对风险资产的偏好明显提升。

中证新能源汽车产业指数三季度上涨 51.28%，以锂电设备、电池材料为代表的产业链中游表现格外亮眼。电池环节龙头地位稳固，技术迭代加速。固态电池由多条技术路线缩圈为两条主要技术路线齐头并进，使得固态电池产业化进程提速。固态电池产业化的前期，设备投资是第一步，主流电池厂建设兆瓦时级别中试线。设备公司从 6 月起陆续交付固态电池相关设备，订单快速增长，同比约 70%至 80%，反映电池领域新一轮扩产周期全面开启。需求端，除了动力电池之外，储能电池出货量也增长显著。受大美法案影响，美国储能项目抢装明显；欧洲、中东/澳洲新兴市场需求翻倍；国内新型储能专项行动方案发布，强调完善市场机制和商业模式，为行业提供政策托底和增长指引。上游端，碳酸锂价格三季度涨幅 15.94%，从 58000 元涨至 7-8 万元，多个锂矿停产待审，稳定了产业链价格预期，体现出“反内卷”的政策效果。中证新能源汽车产业指数市盈率 38.71 倍，位于过去十年 60%分位数之上，产业链盈利修复刚刚开始，估值相对合理。

作为被动投资的指数基金，本基金在投资运作上严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A类份额净值增长率为47.89%，同期业绩比较基准收益率为48.26%。本报告期汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C类份额净值增长率为47.81%，同期业绩比较基准收益率为48.26%。

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 | 9,068,729,931.09 | 93.71 |
| | 其中：股票 | 9,068,729,931.09 | 93.71 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 201,065,534.25 | 2.08 |
| | 其中：债券 | 201,065,534.25 | 2.08 |
| | 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 | 309,207,515.41 | 3.20 |
| 8 | 其他资产 | 97,972,828.29 | 1.01 |
| 9 | 合计 | 9,676,975,809.04 | 100.00 |

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 | - | - |
| B | 采矿业 | 50,626,142.42 | 0.53 |
| C | 制造业 | 8,931,244,979.15 | 93.37 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| 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 | 86,858,809.52 | 0.91 |
| 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 | 9,068,729,931.09 | 94.81 |

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

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 | 300750 | 宁德时代 | 2,410,481 | 969,013,362.00 | 10.13 |
| 2 | 300124 | 汇川技术 | 9,234,712 | 774,053,559.84 | 8.09 |
| 3 | 300014 | 亿纬锂能 | 6,098,213 | 554,937,383.00 | 5.80 |
| 4 | 002594 | 比亚迪 | 4,950,344 | 540,627,068.24 | 5.65 |
| 5 | 002050 | 三花智控 | 11,130,603 | 539,055,103.29 | 5.64 |
| 6 | 603799 | 华友钴业 | 6,576,536 | 433,393,722.40 | 4.53 |
| 7 | 300450 | 先导智能 | 5,301,215 | 329,841,597.30 | 3.45 |
| 8 | 000625 | 长安汽车 | 24,628,509 | 301,206,665.07 | 3.15 |
| 9 | 002460 | 赣锋锂业 | 4,912,034 | 299,044,629.92 | 3.13 |
| 10 | 002709 | 天赐材料 | 6,473,451 | 247,091,624.67 | 2.58 |

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

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 201,065,534.25 | 2.10 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 地方政府债 | - | - |
| 10 | 其他 | - | - |
| 11 | 合计 | 201,065,534.25 | 2.10 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019773 | 25国债08 | 900,000 | 90,570,895.89 | 0.95 |
| 2 | 019785 | 25国债13 | 600,000 | 60,118,668.49 | 0.63 |
| 3 | 019766 | 25国债01 | 300,000 | 30,231,936.99 | 0.32 |
| 4 | 019758 | 24国债21 | 100,000 | 10,124,254.80 | 0.11 |
| 5 | 102310 | 国债2513 | 100,000 | 10,019,778.08 | 0.10 |

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

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 | 367,431.37 |
| 2 | 应收证券清算款 | 69,657,667.50 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | 27,947,729.42 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 97,972,828.29 |

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

| 项目 | 汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) A | 汇添富中证新能源汽车产业指数 (LOF) C |
|----------------|---------------------------|---------------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,659,128,449.91 | 1,998,879,156.54 |
| 本报告期基金总申购份额 | 152,415,837.87 | 301,864,406.11 |
| 减: 本报告期基金总赎回份额 | 626,701,983.25 | 691,293,141.92 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 2,184,842,304.53 | 1,609,450,420.73 |

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末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末运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

注: 本基金成立后有 10,003,600.36 份为发起份额, 发起份额承诺的持有期限为 2018 年 05 月 23 日起 3 年。截至本报告期期末, 最低持有期限届满, 发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证新能源汽车产业指数组型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证新能源汽车产业指数组型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证新能源汽车产业指数组型发起式证券投资基金（LOF）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新能源汽车产业指数组型发起式证券投资基金（LOF）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。

10.2 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

10.3 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