

# 汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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 .....	5
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 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
§ 4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	20
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 .....	20
§ 5 托管人报告 .....	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	20
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 .....	21
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 .....	21
§ 6 审计报告 .....	21
6.1 审计报告的基本信息 .....	21
6.2 审计报告的基本内容 .....	21
§ 7 年度财务报表 .....	23
7.1 资产负债表 .....	23
7.2 利润表 .....	24
7.3 净资产变动表 .....	26
7.4 报表附注 .....	27
§ 8 投资组合报告 .....	59
8.1 期末基金资产组合情况 .....	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	59
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 .....	60

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	85
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	86
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.....	87
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.....	87
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.....	87
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.....	87
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	87
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	87
8.12 投资组合报告附注.....	87
§ 9 基金份额持有人信息.....	88
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	88
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	89
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	90
9.4 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.....	90
9.5 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.....	90
§ 10 开放式基金份额变动.....	90
§ 11 重大事件揭示.....	90
11.1 基金份额持有人大会决议.....	90
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.....	91
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	91
11.4 基金投资策略的改变.....	91
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	91
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	91
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	93
11.8 其他重大事件.....	94
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	97
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.....	97
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	97
§ 13 备查文件目录.....	97
13.1 备查文件目录.....	97
13.2 存放地点.....	97
13.3 查阅方式.....	97

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证 1000ETF
场内简称	ZZ1000
基金主代码	560110
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 07 月 29 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	151,903,500.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 08 月 08 日

注：扩位证券简称：中证 1000ETF 汇添富。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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，追求尽可能贴近标的指数的表现。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 1000 指数收益率
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，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	滕菲菲
	联系电话	021-28932888	4006800000
	电子邮箱	service@99fund.com	tengfeifei@citicbank.com

客户服务电话	400-888-9918	95558
传真	021-28932998	010-85230024
注册地址	上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200010	100020
法定代表人	鲁伟铭	方合英

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	70,758,946.54	-9,414,958.67	-19,349,259.33
本期利润	67,713,385.20	29,551,678.25	-3,448,671.28
加权平均基金份额本期利润	0.2881	0.0765	-0.0075
本期加权平均净值利润率	30.07%	9.87%	-0.81%
本期基金份	28.78%	2.75%	-5.43%

额净值增长率			
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	18,546,553.27	-47,534,002.08	-74,629,909.63
期末可供分配基金份额利润	0.1221	-0.1514	-0.1520
期末基金资产净值	170,450,053.27	273,511,985.07	416,273,590.37
期末基金份额净值	1.1221	0.8713	0.8480
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	12.21%	-12.87%	-15.20%

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

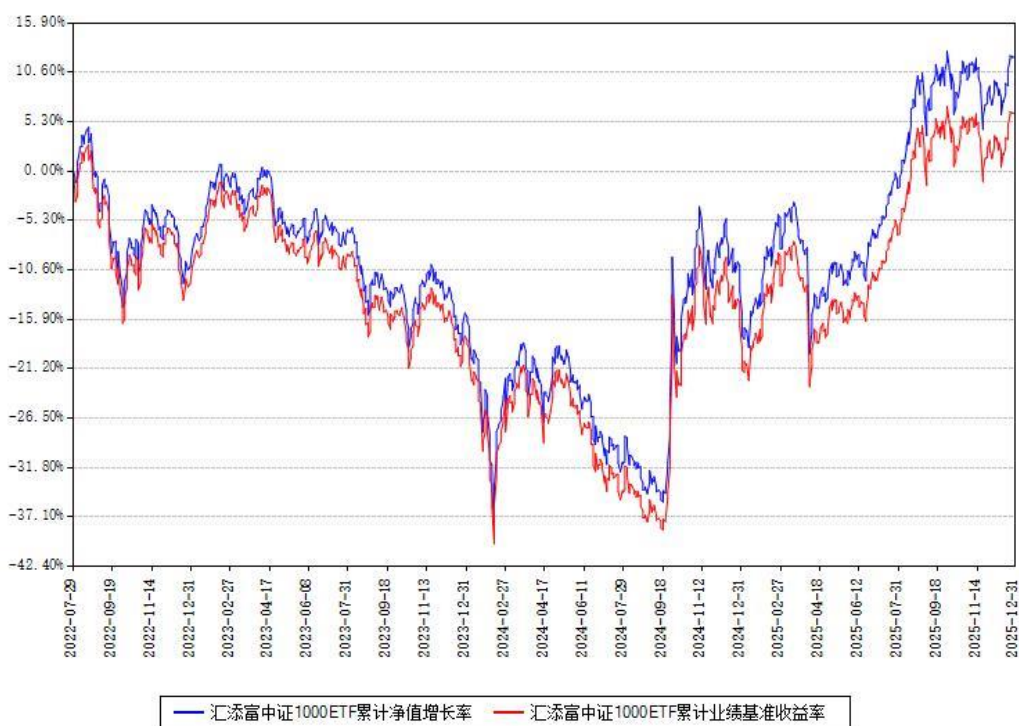
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.35%	1.12%	0.27%	1.13%	0.08%	-0.01%
过去六个月	20.04%	1.11%	19.49%	1.11%	0.55%	0.00%
过去一年	28.78%	1.39%	27.49%	1.39%	1.29%	0.00%

过去三年	25.14%	1.55%	20.91%	1.56%	4.23%	-0.01%
自基金合同生效起至今	12.21%	1.52%	6.22%	1.53%	5.99%	-0.01%

### 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1000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图

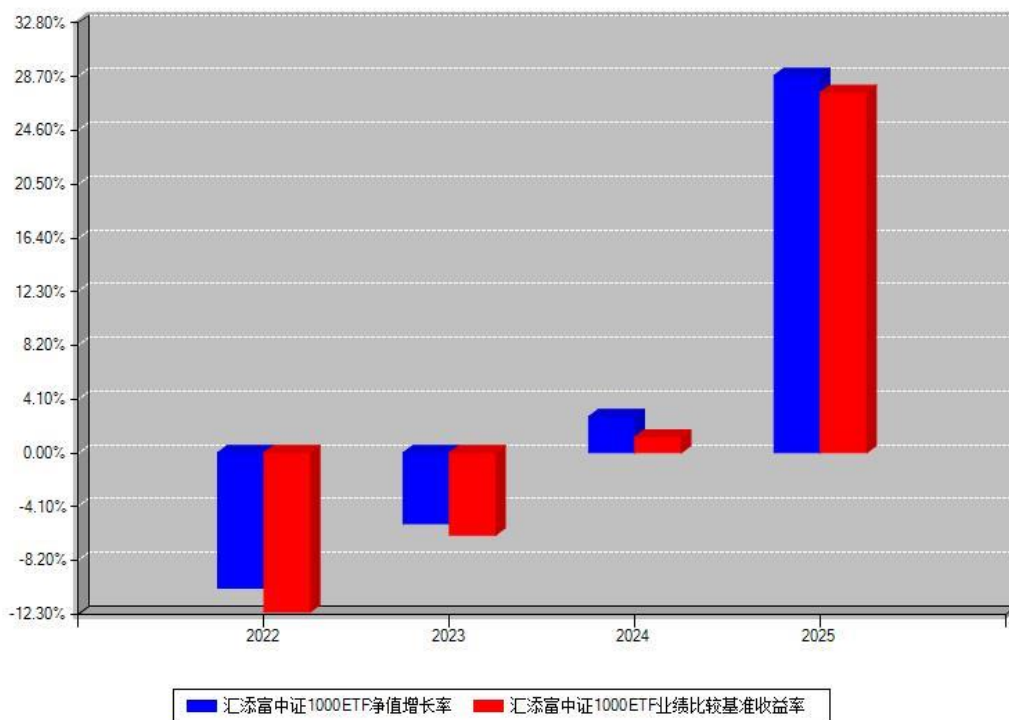


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2022年07月29日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

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

汇添富中证1000ETF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 2022 年 07 月 29 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

业务资格。

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

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

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

2025 年，汇添富基金持续坚持以客户为中心，以提升投资者长期回报为核心导向，持续完善投顾式服务体系，强化全流程投资陪伴与资产配置能力。公司互联网金融业务围绕数字化转型，依托大数据与 AI 等技术，持续优化平台功能与服务流程，提升客户触达效率与服务精准度。同时，汇添富基金持续深耕互联网平台合作，丰富投教内容与工具供给，通过线上线下融合、内容创新与场景化运营，打造更开放、协同的服务生态，更好满足客户多元化、个性化的投资需求，持续提升客户体验与满意度。

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

2025 年，汇添富渠道业务坚持“一切从长期出发、客户第一”原则，围绕提升“客户获得感”开展各项业务合作和产品布局。顺应行业净值化转型与居民稳健理财需求，以固收+产品为核心，深化银行渠道融合与科技赋能，实现高质量增长。将基金产品精准匹配银行

客户多元资产配置需求，助力客户优化风险收益结构。银行渠道深化国有行、股份行战略合作，围绕客户全生命周期理财需求，打造专属资产配置方案。全年线下投教活动 7786 场，覆盖超 50 万人次；线上升级 AI 工具与数字化内容矩阵，全流程赋能银行渠道，获合作伙伴高度认可。

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

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

2025 年，汇添富香港子公司持续深化与母公司的两地一体化运营及垂直化管理模式，核心业务实现跨越式增长，客户覆盖范围进一步拓宽，客群基础进一步夯实。在产品线维度，公司立足权益投资的核心专长，新增多个主动管理权益专户，同时固定收益与权益类资产规模同步攀升，核心产品竞争力持续凸显。至此，公司境外产品线已形成境外权益、固定收益、货币市场的多元布局，为投资者全球资产分散配置提供了坚实支撑。下一步香港子公司将继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通，进一步完善个性化客户服务体系，积极引导长期资金入市。

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

2026 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，

提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
孙浩	本基金的基金经理	2024 年 02 月 07 日	-	5	国籍：中国。学历：北京大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格, CFA。从业经历：2020 年 7 月起任汇添富基金管理股份有限公司数量分析师。2023 年 8 月 29 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联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至今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。2023 年 8 月 29 日至 2025 年 3 月 18 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。2023 年 8 月 29 日至今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。2023 年 9 月 28 日至

					<p>今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。2023 年 11 月 28 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联接基金的基金经理。2023 年 11 月 28 日至今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 12 月 12 日至今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。</p> <p>2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至今任汇添富中证红利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。</p> <p>2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 日至 2024</p>
--	--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>年 12 月 26 日任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 3 月 26 日至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证电信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。</p> <p>2024 年 4 月 19 日至今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。</p> <p>2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药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。</p> <p>2024 年 6 月 4 日至 2025 年 8 月 11 日任汇添富中证芯片产业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。</p> <p>2024 年 6 月 20 日至 2025 年 8 月 18 日任汇添富中证信息技术应用创新产业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。</p> <p>2024 年 7 月 9 日至今</p>
--	--	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2024 年 11 月 18 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 18 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 27 日至今任汇添富上证科创板芯片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 10 月 22 日至今任汇添富中证 500 交易型开放式指数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

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 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

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。

#### 4.3.3 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

2025 年全年 A 股表现亮眼，上证指数上涨 18.41%。行业层面来看，有色金属、通信、电子和国防军工涨幅居前，食品饮料、煤炭、房地产和交通运输表现相对靠后。风格上，小盘和成长风格占优，大盘和价值风格相对偏弱。

内部环境来看，2025 年 GDP 同比增长 5.0%，圆满完成全年经济增速目标，国民经济顶压前行、向新向优，高质量发展取得新成效。2025 年规模以上工业增加值同比增长 5.9%，装备制造业、高技术制造业增势突出，新质生产力带动作用持续增强。2025 年固定资产投资（不含农户）同比下降 3.8%，分类别看，制造业投资同比增长 0.6%，基础设施投资同比下降 2.2%，房地产开发投资同比下降 17.2%；全年投资整体承压，但高技术产业、新型基础设施投资保持较快增长，12 月房地产投资、销售降幅进一步收窄，在一揽子稳楼市政策支持下，市场筑底企稳迹象显现。2025 年社会消费品零售总额同比增长 3.7%，消费品以旧换新政策加力扩围、绿色智能消费成为主流、服务消费扩容提质，扩内需系列政策落地见效，消费对经济增长的贡献率达到 52%，持续发挥了经济发展主引擎的作用。

外部环境方面，2025 年全球经济温和复苏，主要经济体政策外溢效应趋于缓和。美联储 2025 年累计降息三次共 75 个基点，联邦基金利率回落至 3.50%~3.75% 区间，全球流动性环境改善，美元指数波动趋稳，人民币汇率保持基本稳定，国内货币政策外部约束减轻。中美经贸关系总体平稳，地缘政治扰动仍存，但不确定性较上年收敛，全球产业链、供应链调整更趋理性。

中证 1000ETF 汇添富及其联接基金跟踪中证 1000 指数。中证 1000 指数是中证系列宽基指数中的小盘风格代表，权重高度分散，与沪深 300、中证 500 等大中盘宽基之间有着差异化的行业分布特征。当前大中小盘宽基的产品生态逐步完善，中证 1000ETF 汇添富及其联接基金结合期货、期权等衍生品，能够让投资者构建丰富的策略组合。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

本基金本报告期基金份额净值增长率为 28.78%，同期业绩比较基准收益率为 27.49%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，外部需求波动、主要经济体货币政策分化仍是潜在扰动，但国内经济长期向好的基本面没有改变。2025 年 12 月中央政治局会议与中央经济工作会议确立“稳中求进、以进促稳、先立后破”总基调，更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策有望协同发力，扩大内需、化解风险、支持科技创新、壮大民营经济等政策将持续加力显效，政策向宏

观经济基本面的传导实效有望逐步显现，宏观经济中长期改善预期持续增强。2026 年 A 股在政策红利下有望维持较好的交投活跃度，随着宏观经济回升向好逐步验证，A 股有望步入盈利修复驱动行情，资本市场长期配置价值进一步凸显，高质量发展与新质生产力主线有望引领市场稳步向好。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

##### 1、持续提升合规管理

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

##### 2、完善投资合规风险控制工作

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

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

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

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

##### 3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报

告与监督；通过协助监管机构开展各项自查、核查工作，协调第三方独立机构开展审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过督促并跟踪检查风险隐患整改，持续优化公司内部控制管理，切实维护基金份额持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人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：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投

资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司在汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 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_B235 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证 1000 交易型开放式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。 我们认为，后附的汇添富中证 1000 交易型开放式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，公允反映了汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 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。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审

	<p>计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则,我们独立于汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金,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>汇添富中证 1000 交易型开放式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中证 1000 交易型开放式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> <p>治理层负责监督汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇添富中证 1000 交易型开放式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中证 1000 交易型开放式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：汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	5,786,136.86	3,343,430.40
结算备付金		5,989,732.57	5,254,927.23
存出保证金		1,518,546.89	1,271,771.90
交易性金融资产	7.4.7.2	158,514,263.87	263,909,748.62
其中：股票投资		158,488,638.38	263,909,748.62
基金投资		-	-
债券投资		25,625.49	-
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		1,917,864.33	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		173,726,544.52	273,779,878.15
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		3,061,615.98	679.40
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		22,640.33	36,745.06
应付托管费		7,546.74	12,248.36
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	7.4.7.7	184,688.20	218,220.26
负债合计		3,276,491.25	267,893.08
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	151,903,500.00	313,903,500.00
未分配利润	7.4.7.9	18,546,553.27	-40,391,514.93
净资产合计		170,450,053.27	273,511,985.07
负债和净资产总计		173,726,544.52	273,779,878.15

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1221 元，基金份额总额 151,903,500.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		<b>68,330,500.44</b>	<b>30,329,205.90</b>
1. 利息收入		82,540.92	377,978.65
其中：存款利息收入	7.4.7.10	82,540.92	88,981.89
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		-	288,996.76
2. 投资收益（损失以“-”填列）		71,030,150.27	-8,430,004.54
其中：股票投资收益	7.4.7.11	65,942,325.12	-13,644,227.40
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5.17	15,631.84
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	2,738,592.97	1,192,768.25
股利收益	7.4.7.17	2,349,227.01	4,005,822.77
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-3,045,561.34	38,966,636.92
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	263,370.59	-585,405.13
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>617,115.24</b>	<b>777,527.65</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	340,547.26	452,635.05
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	113,515.65	150,878.25
3. 销售服务费		-	-
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		10,185.69	5,496.07
8. 其他费用	7.4.7.21	152,866.64	168,518.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>67,713,385.20</b>	<b>29,551,678.25</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>67,713,385.20</b>	<b>29,551,678.25</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>67,713,385.20</b>	<b>29,551,678.25</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

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	313,903,500.00	-40,391,514.93	273,511,985.07
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	313,903,500.00	-40,391,514.93	273,511,985.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-162,000,000.00	58,938,068.20	-103,061,931.80
（一）、综合收益总额	-	67,713,385.20	67,713,385.20
（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）	-162,000,000.00	-8,775,317.00	-170,775,317.00
其中：1. 基金申购款	366,000,000.00	-16,247,971.62	349,752,028.38
2. 基金赎回款	-528,000,000.00	7,472,654.62	-520,527,345.38
（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	151,903,500.00	18,546,553.27	170,450,053.27
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	490,903,500.00	-74,629,909.63	416,273,590.37
加：会计政策变更	-	-	-

二、本期期初净资产	490,903,500.00	-74,629,909.63	416,273,590.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-177,000,000.00	34,238,394.70	-142,761,605.30
（一）、综合收益总额	-	29,551,678.25	29,551,678.25
（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）	-177,000,000.00	4,686,716.45	-172,313,283.55
其中：1. 基金申购款	918,000,000.00	-230,697,091.91	687,302,908.09
2. 基金赎回款	-1,095,000,000.00	235,383,808.36	-859,616,191.64
（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	313,903,500.00	-40,391,514.93	273,511,985.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金（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（2022）583 号文《关于准予汇添富中证 1000 交易型开放式指数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 2022 年 7 月 29 日生效。首次设立基金募集规模为 3,634,903,500.00 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（2022）验字第 60466941\_B45 号验资报告予以验证。本基金为交易

型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### （1）金融资产分类

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

###### （2）金融负债分类

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

负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成

为已发生信用减值的金融资产；

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原

则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

或基金赎回确认日确认。

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配采用现金分红；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

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

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

##### 2. 增值税

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

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

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

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

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

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

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

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4. 企业所得税

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

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

#### 5. 个人所得税

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

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

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	5,786,136.86	3,343,430.40
等于：本金	5,785,555.27	3,343,017.53
加：应计利息	581.59	412.87
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	5,786,136.86	3,343,430.40

#### 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	143,281,732.64	-	158,488,638.38	15,206,905.74	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	17,600.00	5.17	25,625.49	8,020.32
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	17,600.00	5.17	25,625.49	8,020.32
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	143,299,332.64	5.17	158,514,263.87	15,214,926.06	
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	244,610,261.22	-	263,909,748.62	19,299,487.40	
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	244,610,261.22	-	263,909,748.62	19,299,487.40	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	11,233,040.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	11,233,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,233,040.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
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	9,898,920.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-

（股指期货投资）	9,898,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,898,920.00	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2603	IM2603	8	11,902,400.00	669,360.00
合计				669,360.00
减：可抵销期货暂收款				669,360.00
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。

#### 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		-		-
应付证券出借违约金		-		-
应付交易费用		34,688.20		53,220.26
其中：交易所市场		34,688.20		53,220.26
银行间市场		-		-
应付利息		-		-
应付审计费		30,000.00		45,000.00
应付信息披露费		120,000.00		120,000.00
应付指数使用费		-		-
应付账户维护费		-		-
应付汇划费		-		-
应付上市费		-		-
应付持有人大会费-公证费		-		-
应付持有人大会费-律师费		-		-
应付或有管理费		-		-
申购款利息		-		-
应付登记结算费		-		-
应付 IOPV 计算与发布费		-		-
其他		-		-
合计		184,688.20		218,220.26

### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

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	313,903,500.00	313,903,500.00
本期申购	366,000,000.00	366,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-528,000,000.00	-528,000,000.00
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	151,903,500.00	151,903,500.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-47,534,002.08	7,142,487.15	-40,391,514.93
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-47,534,002.08	7,142,487.15	-40,391,514.93
本期利润	70,758,946.54	-3,045,561.34	67,713,385.20
本期基金份额交易产生的变动数	4,179,469.02	-12,954,786.02	-8,775,317.00
其中：基金申购款	-8,194,145.66	-8,053,825.96	-16,247,971.62
基金赎回款	12,373,614.68	-4,900,960.06	7,472,654.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,404,413.48	-8,857,860.21	18,546,553.27

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
活期存款利息收入	14,419.28	19,219.34
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	67,700.64	66,406.01
其他	421.00	3,356.54
合计	82,540.92	88,981.89

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 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12 月31日
股票投资收益— —买卖股票差价 收入	44,905,752.71	-7,061,133.68
股票投资收益—	21,036,572.41	-6,583,093.72

—赎回差价收入		
股票投资收益— —申购差价收入	-	-
股票投资收益— —证券出借差价 收入	-	-
合计	65,942,325.12	-13,644,227.40

#### 7.4.7.11.2 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	440,001,663.12	676,852,330.60
减：卖出股票成本总额	394,685,748.41	682,824,188.13
减：交易费用	410,162.00	1,089,276.15
买卖股票差价收入	44,905,752.71	-7,061,133.68

#### 7.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

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
赎回基金份额对价总额	520,527,345.38	859,616,191.64
减：现金支付赎回款总额	296,132,479.63	483,818,793.64
减：赎回股票成本总额	203,358,293.34	382,380,491.72
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	21,036,572.41	-6,583,093.72

#### 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	5.17	83.76

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	15,548.08
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	5.17	15,631.84

#### 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	-	143,642.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	128,000.00
减：应计利息总额	-	88.32
减：交易费用	-	5.75
买卖债券差价收入	-	15,548.08

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金无赎回差价收入。

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	2,738,592.97	1,192,768.25
外汇期货投资收益	-	-
外汇远期投资收益	-	-
国债期货投资收益	-	-

## 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,349,227.01	4,005,822.77
其中：证券出借权益补偿收入	-	155,797.61
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,349,227.01	4,005,822.77

## 7.4.7.18 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-4,084,561.34	39,239,756.92
——股票投资	-4,092,581.66	39,239,756.92
——债券投资	8,020.32	-
——资产支持证券 投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	1,039,000.00	-273,120.00
——权证投资	-	-
——期货投资	1,039,000.00	-273,120.00
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	-3,045,561.34	38,966,636.92

## 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	-	-
替代损益	263,370.59	-585,405.13
其他	-	-
合计	263,370.59	-585,405.13

#### 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 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	2,866.64	3,518.28
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	-	-
合计	152,866.64	168,518.28

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中信银行股份有限公司 (“中信银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东
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
汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

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	297,429,225.84	37.55	403,164,505.82	31.89

##### 7.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券成交 总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交 总额的比例 (%)
东方证券	-	-	143,642.15	100.00

#### 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	52,317.56	37.55	14,436.84	41.62
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	197,073.11	29.43	25,461.39	47.84

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	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管理费	340,547.26	452,635.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	94,158.62	76,909.50
应支付基金管理人的净管理费	246,388.64	375,725.55

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，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、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 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。

## 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	113,515.65	150,878.25

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，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、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 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。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易**

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

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**

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

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

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

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

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	1,267,500.00	0.83	1,242,000.00	0.40
汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	11,474,900.00	7.55	19,578,200.00	6.24

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 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
中信银行	5,786,136.86	14,419.28	3,343,430.40	19,219.34

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

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

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600058	五矿发展	2025 年 12 月 30 日	重大事件停牌	11.52	2026 年 01 月 15 日	12.67	7,900	67,382.02	91,008.00	
603508	思维	2025 年	重大	27.82	2026 年	27.83	3,500	101,683.25	97,370.00	

	列 控	12 月 29 日	事 项 停 牌		01 月 07 日					
--	--------	--------------------	------------------	--	--------------------	--	--	--	--	--

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 7.4.13.2 信用风险

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

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

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1- 5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币 资金	5,786,136.86	-	-	-	-	-	5,786,136.86
结算 备付 金	5,989,732.57	-	-	-	-	-	5,989,732.57
存出 保证 金	90,258.89	-	-	-	-	1,428,288.00	1,518,546.89
交易 性金 融资 产	-	25,625.49	-	-	-	158,488,638.38	158,514,263.87
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	1,917,864.33	1,917,864.33
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延	-	-	-	-	-	-	-

所得税资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,866,128.32	25,625.49	-	-	-	161,834,790.71	173,726,544.52
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	-	-	-	-	-	3,061,615.98	3,061,615.98
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	22,640.33	22,640.33
应付托管费	-	-	-	-	-	7,546.74	7,546.74
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	-	-	-	-	-	184,688.20	184,688.20
负债总计	-	-	-	-	-	3,276,491.25	3,276,491.25
利率敏感度缺口	11,866,128.32	25,625.49	-	-	-	158,558,299.46	170,450,053.27
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	3,343,430.40	-	-	-	-	-	3,343,430.40
结算备付金	5,254,927.23	-	-	-	-	-	5,254,927.23
存出保证金	128,258.30	-	-	-	-	1,143,513.60	1,271,771.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	263,909,748.62	263,909,748.62
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	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	8,726,615.93	-	-	-	-	265,053,262.22	273,779,878.15
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	-	-	-	-	-	679.40	679.40
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,745.06	36,745.06
应付托管	-	-	-	-	-	12,248.36	12,248.36

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	-	-	-	-	-	218,220.26	218,220.26
负债总计	-	-	-	-	-	267,893.08	267,893.08
利率敏感度缺口	8,726,615.93	-	-	-	-	264,785,369.14	273,511,985.07

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

动风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	158,488,638.38	92.98	263,909,748.62	96.49
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	25,625.49	0.02	-	-
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	158,514,263.87	93.00	263,909,748.62	96.49

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证 1000 指数 上涨 5%	8,494,244.03	13,572,931.94
	中证 1000 指数 下跌 5%	-8,494,244.03	-13,572,931.94

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	158,325,885.87	263,642,052.62
第二层次	188,378.00	267,696.00
第三层次	-	-
合计	158,514,263.87	263,909,748.62

##### 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

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

##### 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

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

#### 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	158,488,638.38	91.23
	其中：股票	158,488,638.38	91.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,625.49	0.01
	其中：债券	25,625.49	0.01
	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	11,775,869.43	6.78
8	其他各项资产	3,436,411.22	1.98
9	合计	173,726,544.52	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	785,776.60	0.46
B	采矿业	4,028,670.54	2.36
C	制造业	106,259,989.81	62.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,917,345.60	2.30
E	建筑业	1,843,041.20	1.08
F	批发和零售业	5,294,667.20	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	3,511,379.85	2.06
H	住宿和餐饮业	209,375.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,355,722.85	10.77

J	金融业	4,211,569.18	2.47
K	房地产业	1,991,824.00	1.17
L	租赁和商务服务业	2,590,430.76	1.52
M	科学研究和技术服务业	1,793,999.19	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	1,487,635.60	0.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	111,450.00	0.07
Q	卫生和社会工作	500,434.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	1,449,377.00	0.85
S	综合	145,950.00	0.09
	合计	158,488,638.38	92.98

### 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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

### 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	300475	香农芯创	6,200	894,908.00	0.53
2	688110	东芯股份	5,760	756,576.00	0.44
3	688498	源杰科技	1,142	733,152.58	0.43
4	603083	剑桥科技	5,200	698,776.00	0.41
5	002456	欧菲光	63,301	672,256.62	0.39
6	300548	长芯博创	4,400	624,800.00	0.37
7	603516	淳中科技	2,600	581,100.00	0.34
8	001309	德明利	2,500	579,725.00	0.34
9	600105	永鼎股份	22,000	552,200.00	0.32
10	300456	赛微电子	9,700	542,812.00	0.32
11	002497	雅化集团	21,700	537,075.00	0.32
12	688313	仕佳光子	6,013	533,834.14	0.31
13	000766	通化金马	18,200	500,318.00	0.29
14	300762	上海瀚讯	11,800	491,824.00	0.29

15	603119	浙江荣泰股份	4,100	474,247.00	0.28
16	688333	西安铂力特	4,023	448,604.73	0.26
17	688037	芯源微电子	3,018	448,203.18	0.26
18	601208	东材科技	15,400	417,186.00	0.24
19	600595	中孚实业	52,800	414,480.00	0.24
20	300620	光库科技	2,800	411,740.00	0.24
21	002405	四维图新	44,627	402,089.27	0.24
22	600577	精达股份	32,300	401,489.00	0.24
23	002222	福晶科技	7,020	395,506.80	0.23
24	688270	浙江臻镭科技股份有限公司	3,236	395,018.52	0.23
25	600100	同方股份	44,200	394,264.00	0.23
26	300568	星源材质	25,400	387,350.00	0.23
27	002245	蔚蓝锂芯	21,700	386,260.00	0.23
28	600331	宏达股份	29,800	381,142.00	0.22
29	002487	大金重工	7,200	373,896.00	0.22
30	603236	移远通信	3,908	372,862.28	0.22
31	002151	北斗星通	8,200	372,526.00	0.22
32	603308	应流股份	8,900	371,575.00	0.22
33	300666	江丰电子	4,012	369,104.00	0.22
34	300170	汉得信息	19,140	362,128.80	0.21
35	601777	千里科技	34,000	361,420.00	0.21
36	688200	华峰测控	1,899	361,189.80	0.21
37	300438	鹏辉能源	6,700	356,574.00	0.21
38	300049	福瑞医科	5,000	352,050.00	0.21
39	688343	云天励飞股份	4,624	351,793.92	0.21
40	002249	大洋电机	32,100	349,890.00	0.21
41	601677	明泰铝业	23,380	345,790.20	0.20
42	603005	晶方科技	12,300	340,218.00	0.20
43	300779	惠城环保	2,600	338,286.00	0.20
44	603667	五洲新春	4,800	335,904.00	0.20
45	300102	乾照光电	12,100	333,476.00	0.20
46	688005	容百科技	9,412	333,184.80	0.20
47	601606	长城军工	6,900	332,028.00	0.19
48	600151	航天机电	18,900	331,695.00	0.19
49	300409	道氏技术	14,700	330,603.00	0.19
50	601020	华钰矿业	12,300	330,378.00	0.19
51	688208	道通科技	8,936	328,844.80	0.19
52	300655	晶瑞电材	20,189	325,648.57	0.19

53	002139	拓邦股份	23,510	323,967.80	0.19
54	002171	楚江新材	24,400	323,544.00	0.19
55	300085	银之杰	8,000	320,720.00	0.19
56	300953	震裕科技	1,900	319,238.00	0.19
57	600201	生物股份	21,000	316,470.00	0.19
58	603306	华懋科技	5,000	315,050.00	0.18
59	002428	云南锗业	9,900	314,325.00	0.18
60	002176	江特电机	32,154	313,179.96	0.18
61	600388	龙净环保	19,200	313,152.00	0.18
62	300131	英唐智控	21,300	312,258.00	0.18
63	002389	航天彩虹	13,000	311,740.00	0.18
64	300468	四方精创	8,000	310,640.00	0.18
65	688048	长光华芯	2,470	309,614.50	0.18
66	002611	东方精工	16,100	309,442.00	0.18
67	600246	万通发展	25,000	307,500.00	0.18
68	688205	德科立光 电子	2,218	304,930.64	0.18
69	600330	天通股份	23,200	304,616.00	0.18
70	300459	汤姆猫	66,300	304,317.00	0.18
71	688536	思瑞浦股 份	1,902	304,091.76	0.18
72	002326	永太科技	12,200	304,024.00	0.18
73	000901	航天科技	10,600	301,782.00	0.18
74	300672	国科微	2,800	301,336.00	0.18
75	688123	聚辰半导 体	2,370	297,624.60	0.17
76	002149	西部材料	6,500	295,815.00	0.17
77	002617	露笑科技	36,300	294,030.00	0.17
78	300253	卫宁健康	33,300	293,706.00	0.17
79	300773	拉卡拉	10,300	293,344.00	0.17
80	000969	安泰科技	13,900	292,039.00	0.17
81	002400	省广集团	32,900	291,823.00	0.17
82	301550	斯菱智驱	2,100	291,270.00	0.17
83	603127	昭衍新药	8,300	290,583.00	0.17
84	600114	东睦股份	9,500	290,225.00	0.17
85	002048	宁波华翔	9,200	289,432.00	0.17
86	300045	华力创通	10,000	289,100.00	0.17
87	601519	大智慧	22,400	288,288.00	0.17
88	300083	创世纪	31,300	288,273.00	0.17
89	002104	恒宝股份	13,300	287,413.00	0.17
90	300088	长信科技	47,100	285,426.00	0.17
91	002484	江海股份	9,600	285,120.00	0.17
92	603063	禾望电气	8,600	284,402.00	0.17

93	688327	云从科技	19,691	282,959.67	0.17
94	601126	四方股份	9,400	282,752.00	0.17
95	605090	九丰能源	6,540	281,874.00	0.17
96	300182	捷成股份	50,300	277,656.00	0.16
97	600155	华创云信	41,700	276,054.00	0.16
98	000737	北方铜业	17,900	275,481.00	0.16
99	300738	奥飞数据	14,864	274,835.36	0.16
100	300035	中科电气	12,900	274,641.00	0.16
101	000917	电广传媒	26,638	273,838.64	0.16
102	300777	中简科技	6,700	273,360.00	0.16
103	000875	吉电股份	47,900	270,156.00	0.16
104	600728	佳都科技	40,000	267,200.00	0.16
105	002163	海南发展	11,200	267,008.00	0.16
106	002396	星网锐捷	8,800	266,640.00	0.16
107	603613	国联股份	9,500	266,000.00	0.16
108	002544	普天科技	7,700	265,573.00	0.16
109	600179	安通控股	47,788	263,789.76	0.15
110	600323	瀚蓝环境	9,200	263,120.00	0.15
111	300229	拓尔思	13,200	262,680.00	0.15
112	300007	汉威科技	4,900	262,640.00	0.15
113	300068	南都电源	16,900	262,626.00	0.15
114	600416	湘电股份	16,600	261,948.00	0.15
115	300236	上海新阳	4,100	261,416.00	0.15
116	688331	荣昌生物	3,358	261,218.82	0.15
117	001203	大中矿业	8,500	260,525.00	0.15
118	600338	西藏珠峰	17,200	258,688.00	0.15
119	002716	湖南白银	37,200	257,424.00	0.15
120	300296	利亚德	40,700	257,224.00	0.15
121	300674	宇信科技	10,600	257,156.00	0.15
122	002276	万马股份	15,200	257,032.00	0.15
123	601869	长飞光纤	2,200	255,992.00	0.15
124	688116	天奈科技	5,424	255,741.60	0.15
125	300638	广和通	8,620	255,496.80	0.15
126	002895	川恒股份	6,900	252,954.00	0.15
127	002270	华明装备	10,100	252,904.00	0.15
128	600113	浙江东日	4,000	252,680.00	0.15
129	300315	掌趣科技	50,900	251,446.00	0.15
130	301171	易点天下	6,200	251,100.00	0.15
131	600529	山东药玻	12,500	249,125.00	0.15
132	000636	风华高科	15,300	249,084.00	0.15
133	001301	尚太科技	2,900	248,849.00	0.15
134	688630	芯碁微装	1,846	248,342.38	0.15
135	000970	中科三环	18,300	248,148.00	0.15

136	600259	中稀有有色	4,400	247,544.00	0.15
137	002506	协鑫集成	88,300	247,240.00	0.15
138	300065	海兰信	13,600	247,112.00	0.14
139	000686	东北证券	26,500	246,980.00	0.14
140	603881	数据港	8,084	245,996.12	0.14
141	002373	千方科技	20,900	245,993.00	0.14
142	002145	钛能化学	50,200	245,980.00	0.14
143	600761	安徽合力	11,709	244,601.01	0.14
144	300101	振芯科技	8,600	244,498.00	0.14
145	600759	洲际油气	78,200	243,984.00	0.14
146	300870	欧陆通	1,100	243,100.00	0.14
147	002317	众生药业	12,800	242,944.00	0.14
148	300593	新雷能	8,151	242,573.76	0.14
149	000811	冰轮环境	13,060	241,871.20	0.14
150	000603	盛达资源	7,800	241,488.00	0.14
151	600635	大众公用	36,500	238,710.00	0.14
152	600120	浙江东方	38,600	238,162.00	0.14
153	300199	翰宇药业	13,300	238,070.00	0.14
154	603300	海南华铁	30,220	237,227.00	0.14
155	300348	长亮科技	15,300	236,844.00	0.14
156	688382	益方生物科技	8,660	235,898.40	0.14
157	002747	埃斯顿	9,871	233,942.70	0.14
158	600877	电科芯片	13,300	233,415.00	0.14
159	300811	铂科新材	3,252	231,900.12	0.14
160	000422	湖北宜化	16,300	231,623.00	0.14
161	601636	旗滨集团	39,000	231,270.00	0.14
162	300827	上能电气	6,731	230,334.82	0.14
163	002268	电科网安	11,200	230,048.00	0.13
164	600859	王府井	14,800	229,844.00	0.13
165	600850	电科数字	7,690	227,931.60	0.13
166	600206	有研新材	11,200	227,696.00	0.13
167	002174	游族网络	18,600	227,664.00	0.13
168	300850	新强联	5,500	227,535.00	0.13
169	605111	新洁能	6,344	226,671.12	0.13
170	688484	南芯科技	5,559	226,028.94	0.13
171	002536	飞龙股份	7,600	225,720.00	0.13
172	600490	鹏欣资源	29,200	225,716.00	0.13
173	002681	奋达科技	33,900	225,435.00	0.13
174	300573	兴齐眼药	3,200	224,928.00	0.13
175	601375	中原证券	52,100	224,030.00	0.13
176	301377	鼎泰高科	1,600	222,560.00	0.13
177	688372	伟测科技	2,039	222,434.51	0.13

178	300077	国民技术	11,000	222,420.00	0.13
179	605376	博迁新材	3,400	222,360.00	0.13
180	603358	华达科技	4,400	222,200.00	0.13
181	000681	视觉中国	9,300	221,433.00	0.13
182	601975	招商南油	73,200	221,064.00	0.13
183	002046	国机精工	5,100	220,218.00	0.13
184	688088	虹软科技	4,447	220,126.50	0.13
185	600667	太极实业	27,600	219,972.00	0.13
186	600559	老白干酒	13,700	219,748.00	0.13
187	600619	海立股份	10,400	219,440.00	0.13
188	002036	联创电子	19,900	219,298.00	0.13
189	600986	浙文互联	28,000	218,960.00	0.13
190	300775	三角防务	7,200	218,880.00	0.13
191	688548	广钢气体 股份	15,040	218,681.60	0.13
192	002545	东方铁塔	11,800	217,710.00	0.13
193	002237	恒邦股份	16,200	217,404.00	0.13
194	300260	新莱应材	3,820	217,319.80	0.13
195	688141	杰华特微 电子	4,992	216,802.56	0.13
196	300184	力源信息	21,700	216,783.00	0.13
197	603009	北特科技	4,500	216,720.00	0.13
198	002020	京新药业	11,400	216,372.00	0.13
199	688567	孚能科技	13,815	216,204.75	0.13
200	603360	百傲化学	6,700	215,874.00	0.13
201	600641	先导基电	12,200	215,208.00	0.13
202	301511	德福科技	6,000	214,740.00	0.13
203	600456	宝钛股份	5,421	213,858.45	0.13
204	002518	科士达	4,400	213,488.00	0.13
205	300181	佐力药业	13,200	213,312.00	0.13
206	603305	旭升集团	13,092	211,828.56	0.12
207	000099	中信海直	10,200	211,650.00	0.12
208	002807	江阴银行	46,300	211,591.00	0.12
209	688698	伟创电气	2,139	211,504.32	0.12
210	300009	安科生物	22,000	210,540.00	0.12
211	688068	热景生物	1,299	210,438.00	0.12
212	601528	瑞丰银行	36,870	210,159.00	0.12
213	600258	首旅酒店	12,500	209,375.00	0.12
214	300133	华策影视	25,000	208,000.00	0.12
215	300607	拓斯达	6,300	207,522.00	0.12
216	301316	慧博云通	4,600	205,528.00	0.12
217	688766	普冉半导 体	1,615	205,444.15	0.12

218	600872	中炬高新	11,700	205,335.00	0.12
219	300130	新国都	7,400	205,202.00	0.12
220	300008	天海防务	26,000	205,140.00	0.12
221	688800	瑞可达连接系统	2,470	205,010.00	0.12
222	000762	西藏矿业	7,800	204,906.00	0.12
223	002779	中坚科技	1,800	204,408.00	0.12
224	300455	航天智装	6,800	204,272.00	0.12
225	600596	新安股份	17,800	204,166.00	0.12
226	300457	赢合科技	7,300	203,305.00	0.12
227	000680	山推股份	16,900	202,293.00	0.12
228	301205	联特科技	1,200	202,212.00	0.12
229	600186	莲花控股	33,800	202,124.00	0.12
230	002192	融捷股份	3,900	201,825.00	0.12
231	002212	天融信	22,200	201,354.00	0.12
232	002368	太极股份	8,200	200,818.00	0.12
233	002701	奥瑞金	33,700	200,515.00	0.12
234	300624	万兴科技	2,831	200,010.15	0.12
235	600366	宁波韵升	14,500	199,955.00	0.12
236	002324	普利特	12,500	199,875.00	0.12
237	688390	固德威电源	3,217	199,872.21	0.12
238	601778	晶科科技	53,700	199,764.00	0.12
239	688131	皓元医药	2,771	199,733.68	0.12
240	300098	高新兴	32,700	199,470.00	0.12
241	603997	继峰股份	14,350	199,465.00	0.12
242	002182	宝武镁业	13,020	199,206.00	0.12
243	300657	弘信电子	7,200	199,152.00	0.12
244	601137	博威合金	9,312	198,997.44	0.12
245	002354	天娱数科	31,200	198,744.00	0.12
246	000612	焦作万方	18,000	198,360.00	0.12
247	688652	京仪装备	2,017	198,291.27	0.12
248	600072	中船科技	17,000	197,540.00	0.12
249	002507	涪陵榨菜	15,300	197,523.00	0.12
250	600629	华建集团	9,100	197,470.00	0.12
251	600064	南京高科	22,700	197,036.00	0.12
252	002896	中大力德	2,200	196,592.00	0.12
253	600446	金证股份	12,300	195,816.00	0.11
254	000801	四川九洲	11,500	195,040.00	0.11
255	002698	博实股份	11,600	194,996.00	0.11
256	600933	爱柯迪	9,700	194,970.00	0.11
257	688503	聚和材料股份公司	3,194	194,834.00	0.11

258	603026	石大胜华	2,600	194,506.00	0.11
259	688158	优刻得科技	6,906	193,989.54	0.11
260	600320	振华重工	37,620	193,743.00	0.11
261	688409	富创精密	2,855	192,427.00	0.11
262	603323	苏农银行	37,950	191,647.50	0.11
263	603678	火炬电子	5,400	190,728.00	0.11
264	300398	飞凯材料	8,500	190,485.00	0.11
265	002075	沙钢股份	33,100	190,325.00	0.11
266	002815	崇达技术	13,800	188,508.00	0.11
267	301029	怡合达	7,100	188,292.00	0.11
268	600531	豫光金铅	16,000	188,000.00	0.11
269	002539	云图控股	15,900	187,938.00	0.11
270	002745	木林森	19,600	187,572.00	0.11
271	002251	步步高	35,300	187,443.00	0.11
272	000778	新兴铸管	44,800	187,264.00	0.11
273	603662	柯力传感	2,600	187,200.00	0.11
274	600459	贵研铂业	10,034	186,732.74	0.11
275	000688	国城矿业	6,700	186,260.00	0.11
276	000581	威孚高科	9,000	185,580.00	0.11
277	300378	鼎捷数智	4,100	185,566.00	0.11
278	300682	朗新集团	12,200	185,562.00	0.11
279	300618	寒锐钴业	4,100	185,361.00	0.11
280	600633	浙数文化	14,400	185,184.00	0.11
281	002123	梦网科技	15,200	184,832.00	0.11
282	000902	新洋丰	11,800	184,316.00	0.11
283	688403	汇成股份	11,245	184,193.10	0.11
284	600301	华锡有色	4,800	184,128.00	0.11
285	688063	派能科技	3,237	183,926.34	0.11
286	000555	神州信息	11,100	183,705.00	0.11
287	601187	厦门银行	25,000	183,500.00	0.11
288	600133	东湖高新	20,200	183,416.00	0.11
289	600428	中远海特	25,800	183,180.00	0.11
290	002015	协鑫能科	18,400	183,080.00	0.11
291	600835	上海机电	6,100	183,061.00	0.11
292	603690	至纯科技	5,820	183,039.00	0.11
293	300303	聚飞光电	26,700	182,628.00	0.11
294	600550	保变电气	17,300	182,515.00	0.11
295	300602	飞荣达	5,500	182,380.00	0.11
296	600057	厦门象屿	21,388	182,225.76	0.11
297	300113	顺网科技	9,000	182,160.00	0.11
298	000923	河钢资源	8,600	182,062.00	0.11
299	300660	江苏雷利	3,320	182,002.40	0.11

300	600867	通化东宝	22,200	181,374.00	0.11
301	600718	东软集团	18,000	181,260.00	0.11
302	002706	良信股份	16,800	181,104.00	0.11
303	002006	精工科技	7,800	180,648.00	0.11
304	000682	东方电子	15,200	180,272.00	0.11
305	688029	南微医学 科技	2,210	180,247.60	0.11
306	002654	万润科技	12,800	180,096.00	0.11
307	300693	盛弘股份	4,700	179,916.00	0.11
308	688400	凌云光技 术	4,243	179,818.34	0.11
309	002936	郑州银行	93,000	179,490.00	0.11
310	603871	嘉友国际	12,840	179,118.00	0.11
311	603456	九洲药业	10,000	179,000.00	0.11
312	002948	青岛银行	39,900	178,752.00	0.10
313	300276	三丰智能	18,400	178,480.00	0.10
314	002170	芭田股份	14,600	177,828.00	0.10
315	688279	峰昭科技	872	177,443.28	0.10
316	600552	凯盛科技	14,300	177,320.00	0.10
317	600645	中源协和	7,000	176,400.00	0.10
318	002097	山河智能	14,200	176,222.00	0.10
319	002416	爱施德	14,000	176,120.00	0.10
320	601609	金田股份	16,300	176,040.00	0.10
321	600285	羚锐制药	8,500	176,035.00	0.10
322	603588	高能环境	22,800	176,016.00	0.10
323	688050	爱博诺德 医疗	2,897	175,732.02	0.10
324	300034	钢研高纳	8,960	175,436.80	0.10
325	002987	京北方	8,139	175,232.67	0.10
326	300166	东方国信	17,100	174,762.00	0.10
327	600325	华发股份	41,400	174,708.00	0.10
328	600216	浙江医药	12,600	174,636.00	0.10
329	300747	锐科激光	6,460	174,613.80	0.10
330	001227	兰州银行	75,100	174,232.00	0.10
331	002063	远光软件	28,616	173,699.12	0.10
332	603809	豪能股份	12,100	173,635.00	0.10
333	600478	科力远	25,200	173,628.00	0.10
334	688660	电气风电	10,191	173,348.91	0.10
335	000758	中色股份	26,100	173,304.00	0.10
336	688559	海目星激 光	3,602	173,112.12	0.10
337	000035	中国天楹	31,330	172,941.60	0.10
338	688362	甬矽电子	5,324	172,550.84	0.10

339	688789	杭州宏华数码科技	2,112	172,275.84	0.10
340	301078	孩子王	16,600	172,142.00	0.10
341	000690	宝新能源	41,000	171,790.00	0.10
342	002947	恒铭达	3,300	171,666.00	0.10
343	600908	无锡银行	28,900	171,377.00	0.10
344	000403	派林生物	12,500	171,125.00	0.10
345	002675	东诚药业	12,400	170,376.00	0.10
346	600480	凌云股份	13,840	170,093.60	0.10
347	688062	迈威生物	4,412	169,729.64	0.10
348	300725	药石科技	4,400	169,664.00	0.10
349	000543	皖能电力	21,300	169,335.00	0.10
350	002364	中恒电气	6,400	169,216.00	0.10
351	300036	超图软件	9,300	168,888.00	0.10
352	300772	运达股份	8,860	168,871.60	0.10
353	301510	固高科技	4,500	168,525.00	0.10
354	600210	紫江企业	22,900	168,315.00	0.10
355	600869	远东股份	20,900	168,245.00	0.10
356	000420	吉林化纤	37,100	168,063.00	0.10
357	000829	天音控股	15,400	168,014.00	0.10
358	002839	张家港行	36,700	167,719.00	0.10
359	301050	雷电微力	3,207	167,405.40	0.10
360	300352	北信源	27,300	167,349.00	0.10
361	300357	我武生物	5,900	167,265.00	0.10
362	688147	微导纳米科技	2,662	167,146.98	0.10
363	300185	通裕重工	58,600	166,424.00	0.10
364	002091	江苏国泰	18,400	166,152.00	0.10
365	600389	江山股份	6,545	165,457.60	0.10
366	600771	广誉远	9,200	165,416.00	0.10
367	601678	滨化股份	38,900	164,936.00	0.10
368	000676	智度股份	19,100	164,833.00	0.10
369	002315	焦点科技	3,600	164,736.00	0.10
370	688433	华曙高科	2,487	164,564.79	0.10
371	600750	江中药业	7,100	164,507.00	0.10
372	688516	奥特维科技	3,627	164,158.02	0.10
373	300224	正海磁材	10,600	163,876.00	0.10
374	002019	亿帆医药	13,700	163,852.00	0.10
375	688779	五矿新能	21,876	163,851.24	0.10
376	603267	鸿远电子	3,000	163,290.00	0.10
377	300761	立华股份	7,860	163,095.00	0.10
378	002183	怡亚通	34,200	162,792.00	0.10

379	600452	涪陵电力	17,356	162,625.72	0.10
380	600961	株冶集团	10,100	162,610.00	0.10
381	300446	航天智造	6,400	162,176.00	0.10
382	000685	中山公用	13,900	161,935.00	0.10
383	002378	章源钨业	11,400	161,652.00	0.09
384	300415	伊之密	6,200	161,572.00	0.09
385	603619	中曼石油	7,000	161,350.00	0.09
386	301217	铜冠铜箔	4,700	161,116.00	0.09
387	001287	中电港	7,100	160,886.00	0.09
388	300180	华峰超纤	23,200	160,776.00	0.09
389	002537	海联金汇	17,700	160,362.00	0.09
390	002928	华夏航空	14,500	160,225.00	0.09
391	600063	皖维高新	27,200	160,208.00	0.09
392	688502	茂莱光学	400	159,620.00	0.09
393	600993	马应龙	5,700	159,600.00	0.09
394	603876	鼎胜新材	10,600	159,106.00	0.09
395	300663	科蓝软件	9,000	158,760.00	0.09
396	300726	宏达电子	3,109	158,279.19	0.09
397	300576	容大感光	4,100	158,055.00	0.09
398	002338	奥普光电	2,700	157,653.00	0.09
399	002643	万润股份	10,500	157,395.00	0.09
400	600267	海正药业	15,900	157,251.00	0.09
401	605020	永和股份	5,840	157,037.60	0.09
402	300910	瑞丰新材	2,770	156,643.50	0.09
403	002073	软控股份	19,200	156,480.00	0.09
404	600273	嘉化能源	17,900	156,446.00	0.09
405	301293	三博脑科	2,650	156,297.00	0.09
406	603337	杰克科技	3,600	155,988.00	0.09
407	600864	哈投股份	23,500	155,805.00	0.09
408	002468	申通快递	11,600	155,672.00	0.09
409	300776	帝尔激光	2,500	155,350.00	0.09
410	603612	索通发展	6,600	155,100.00	0.09
411	688321	微芯生物	5,301	154,895.22	0.09
412	601963	重庆银行	14,300	154,869.00	0.09
413	300493	润欣科技	7,700	154,693.00	0.09
414	300319	麦捷科技	13,200	154,308.00	0.09
415	603887	城地香江	11,400	154,128.00	0.09
416	600821	金开新能	30,200	154,020.00	0.09
417	688543	国科军工	2,479	153,871.53	0.09
418	002320	海峡股份	12,600	153,342.00	0.09
419	000061	农产品	14,900	153,321.00	0.09
420	600507	方大特钢	26,000	153,140.00	0.09
421	601860	紫金银行	55,400	152,904.00	0.09

422	688612	威迈斯	4,625	152,486.25	0.09
423	600399	抚顺特钢	26,100	152,424.00	0.09
424	600621	华鑫股份	10,000	152,400.00	0.09
425	002011	盾安环境	12,000	152,160.00	0.09
426	688519	南亚新材料	1,879	151,935.94	0.09
427	002100	天康生物	20,600	151,822.00	0.09
428	002023	海特高新	11,200	151,648.00	0.09
429	002010	传化智联	26,100	151,641.00	0.09
430	600022	山东钢铁	100,400	151,604.00	0.09
431	600353	旭光电子	9,400	151,528.00	0.09
432	688262	苏州国芯科技	4,977	151,051.95	0.09
433	301345	涛涛车业	600	150,792.00	0.09
434	000837	秦川机床	11,700	150,696.00	0.09
435	300047	天源迪科	12,000	150,600.00	0.09
436	002239	奥特佳	50,300	149,894.00	0.09
437	002906	华阳集团	4,900	149,842.00	0.09
438	002572	索菲亚	11,000	149,710.00	0.09
439	600572	康恩贝	33,500	149,410.00	0.09
440	002891	中宠股份	2,880	149,068.80	0.09
441	300244	迪安诊断	9,400	148,990.00	0.09
442	601222	林洋能源	27,200	148,784.00	0.09
443	600509	天富能源	18,000	148,680.00	0.09
444	603505	金石资源	7,953	148,562.04	0.09
445	301526	国际复材	21,200	148,400.00	0.09
446	300595	欧普康视	10,100	148,369.00	0.09
447	600776	东方通信	8,977	148,120.50	0.09
448	300598	诚迈科技	3,220	148,023.40	0.09
449	002292	奥飞娱乐	16,700	147,795.00	0.09
450	000620	盈新发展	55,100	147,668.00	0.09
451	002345	潮宏基	11,800	147,500.00	0.09
452	301219	腾远钴业	2,160	147,484.80	0.09
453	002979	雷赛智能	3,500	147,245.00	0.09
454	002017	东信和平	6,600	147,180.00	0.09
455	000628	高新发展	3,300	147,147.00	0.09
456	300087	荃银高科	12,520	146,233.60	0.09
457	000833	粤桂股份	7,500	145,950.00	0.09
458	002226	江南化工	25,100	145,831.00	0.09
459	600185	珠免集团	21,400	145,734.00	0.09
460	600056	中国医药	14,100	145,653.00	0.09
461	301291	明阳电气	3,500	145,635.00	0.09
462	002649	博彦科技	11,000	145,090.00	0.09

463	300079	数码视讯	26,900	144,991.00	0.09
464	600409	三友化工	23,400	144,846.00	0.08
465	300327	中颖电子	5,150	144,354.50	0.08
466	300337	银邦股份	9,300	144,243.00	0.08
467	002221	东华能源	17,800	144,180.00	0.08
468	600315	上海家化	6,400	144,128.00	0.08
469	000935	四川双马	5,800	144,072.00	0.08
470	600556	天下秀	23,700	143,859.00	0.08
471	300075	数字政通	9,360	143,582.40	0.08
472	688127	蓝特光学	3,724	143,336.76	0.08
473	300031	宝通科技	6,300	143,199.00	0.08
474	300855	图南股份	4,433	143,185.90	0.08
475	002004	华邦健康	29,900	142,922.00	0.08
476	301035	润丰股份	2,100	142,821.00	0.08
477	002965	祥鑫科技	3,500	142,380.00	0.08
478	002233	塔牌集团	15,800	142,358.00	0.08
479	601311	骆驼股份	15,500	142,135.00	0.08
480	000860	顺鑫农业	9,700	142,105.00	0.08
481	600996	贵广网络	14,150	142,066.00	0.08
482	002003	伟星股份	13,400	142,040.00	0.08
483	600686	金龙汽车	8,000	141,920.00	0.08
484	000712	锦龙股份	11,800	141,836.00	0.08
485	300363	博腾股份	6,100	141,764.00	0.08
486	300188	国投智能	9,700	141,717.00	0.08
487	300525	博思软件	10,034	141,479.40	0.08
488	603663	三祥新材	4,000	141,400.00	0.08
489	002215	诺普信	13,300	140,847.00	0.08
490	603220	中贝通信	6,610	140,793.00	0.08
491	688798	艾为电子	1,833	139,509.63	0.08
492	300026	红日药业	39,600	139,392.00	0.08
493	688206	概伦电子	4,001	139,354.83	0.08
494	600782	新钢股份	35,900	139,292.00	0.08
495	002847	盐津铺子	2,039	139,284.09	0.08
496	301263	泰恩康	4,800	139,152.00	0.08
497	600783	鲁信创投	5,600	138,488.00	0.08
498	002204	大连重工	18,100	138,465.00	0.08
499	600787	中储股份	24,600	138,252.00	0.08
500	688717	艾罗能源	2,242	138,107.20	0.08
501	300925	法本信息	6,500	138,060.00	0.08
502	601718	际华集团	41,200	138,020.00	0.08
503	002690	美亚光电	6,700	137,819.00	0.08
504	600651	飞乐音响	18,900	137,781.00	0.08
505	301155	海力风电	1,700	137,581.00	0.08

506	603583	捷昌驱动	3,600	137,052.00	0.08
507	688596	正帆科技	4,323	136,736.49	0.08
508	688523	航天环宇科技	2,443	136,710.28	0.08
509	601069	西部黄金	5,100	136,068.00	0.08
510	603108	润达医疗	9,100	136,045.00	0.08
511	600827	百联股份	15,100	135,749.00	0.08
512	688083	中望软件	1,992	135,675.12	0.08
513	000089	深圳机场	19,400	135,606.00	0.08
514	002043	兔宝宝	9,400	135,454.00	0.08
515	600328	中盐化工	16,430	135,383.20	0.08
516	688591	泰凌微	3,173	135,042.88	0.08
517	688306	均普智能制造	11,614	134,722.40	0.08
518	688326	经纬恒润	1,145	134,537.50	0.08
519	600461	洪城环境	14,500	134,415.00	0.08
520	002332	仙琚制药	14,900	134,249.00	0.08
521	601969	海南矿业	11,300	134,244.00	0.08
522	688016	心脉医疗	1,460	133,823.60	0.08
523	600773	西藏城投	10,800	133,812.00	0.08
524	600037	歌华有线	18,300	133,590.00	0.08
525	603283	赛腾股份	3,080	133,425.60	0.08
526	002099	海翔药业	21,300	132,912.00	0.08
527	002597	金禾实业	6,400	132,864.00	0.08
528	002488	金固股份	15,100	132,729.00	0.08
529	000156	华数传媒	17,500	132,475.00	0.08
530	002550	千红制药	16,800	132,048.00	0.08
531	600587	新华医疗	9,160	131,904.00	0.08
532	300821	东岳硅材	11,300	131,758.00	0.08
533	605507	国邦医药	5,300	131,440.00	0.08
534	000503	国新健康	14,800	131,424.00	0.08
535	002408	齐翔腾达	26,900	131,272.00	0.08
536	603556	海兴电力	3,600	131,040.00	0.08
537	601890	亚星锚链	12,700	130,683.00	0.08
538	600866	星湖科技	18,800	130,660.00	0.08
539	688006	浙江杭可科技	4,458	130,574.82	0.08
540	301626	苏州天脉	700	130,410.00	0.08
541	688696	极米科技	1,168	130,208.64	0.08
542	300841	康华生物	1,800	130,068.00	0.08
543	603169	兰石重装	12,200	130,052.00	0.08
544	002941	新疆交建	8,200	129,970.00	0.08
545	600129	太极集团	7,200	129,960.00	0.08

546	600888	新疆众和	15,859	129,885.21	0.08
547	000727	冠捷科技	51,100	129,794.00	0.08
548	600916	中国黄金	15,900	129,585.00	0.08
549	601369	陕鼓动力	12,900	129,129.00	0.08
550	301095	广立微	1,800	129,078.00	0.08
551	301392	汇成真空	1,000	129,040.00	0.08
552	600475	华光环能	7,100	129,007.00	0.08
553	300294	博雅生物	5,700	128,820.00	0.08
554	300634	彩讯股份	5,100	128,673.00	0.08
555	000795	英洛华	12,900	128,613.00	0.08
556	603218	日月股份	9,700	128,525.00	0.08
557	603039	泛微网络	2,400	128,496.00	0.08
558	603393	新天然气	4,800	127,632.00	0.07
559	002541	鸿路钢构	7,760	127,574.40	0.07
560	688097	博众精工 科技	3,377	127,481.75	0.07
561	688439	振华风光	1,971	127,326.60	0.07
562	603883	老百姓	8,600	127,280.00	0.07
563	600420	国药现代	12,600	127,260.00	0.07
564	000810	创维数字	10,800	127,224.00	0.07
565	301018	申菱环境	2,000	127,040.00	0.07
566	600211	西藏药业	2,970	126,373.50	0.07
567	600422	昆药集团	10,060	126,353.60	0.07
568	301031	中熔电气	1,124	126,101.56	0.07
569	000065	北方国际	10,100	125,846.00	0.07
570	600158	中体产业	14,400	125,712.00	0.07
571	301039	中集车辆	13,700	125,355.00	0.07
572	002096	易普力	9,400	125,208.00	0.07
573	688332	中科蓝讯	950	124,744.50	0.07
574	605123	派克新材	1,200	124,680.00	0.07
575	300687	赛意信息	5,400	124,038.00	0.07
576	300580	贝斯特	4,700	123,563.00	0.07
577	603027	千禾味业	12,558	123,445.14	0.07
578	688289	圣湘生物	6,528	123,444.48	0.07
579	600654	中安科	32,700	123,279.00	0.07
580	301061	匠心家居	1,300	123,240.00	0.07
581	002557	洽洽食品	5,700	123,234.00	0.07
582	600055	万东医疗	7,900	123,082.00	0.07
583	600717	天津港	27,400	122,478.00	0.07
584	688153	唯捷创芯	3,245	122,141.80	0.07
585	601619	嘉泽新能	27,500	122,100.00	0.07
586	600789	鲁抗医药	13,500	122,040.00	0.07
587	000589	贵州轮胎	23,500	121,730.00	0.07

588	603256	宏和科技	3,300	121,473.00	0.07
589	300428	立中集团	5,200	121,420.00	0.07
590	300323	华灿光电	15,200	121,296.00	0.07
591	603171	税友股份	2,200	121,286.00	0.07
592	002967	广电计量	5,500	121,055.00	0.07
593	600882	妙可蓝多	4,801	120,697.14	0.07
594	300226	上海钢联	4,800	120,576.00	0.07
595	600373	中文传媒	12,900	120,486.00	0.07
596	002045	国光电器	8,500	120,445.00	0.07
597	600361	创新新材	28,400	120,416.00	0.07
598	300685	艾德生物	5,880	120,304.80	0.07
599	000880	潍柴重机	4,400	120,208.00	0.07
600	688146	中船派瑞 特气	2,971	120,028.40	0.07
601	300678	中科信息	3,900	119,964.00	0.07
602	688700	东威科技	3,400	119,952.00	0.07
603	300416	苏试试验	6,700	119,528.00	0.07
604	000650	仁和药业	21,100	119,215.00	0.07
605	600266	城建发展	23,500	119,145.00	0.07
606	000927	中国铁物	45,500	118,755.00	0.07
607	000791	甘肃能源	18,400	118,680.00	0.07
608	300613	富瀚微	2,576	118,650.56	0.07
609	000672	上峰水泥	9,120	118,468.80	0.07
610	688300	联瑞新材	1,908	118,467.72	0.07
611	600116	三峡水利	18,100	118,374.00	0.07
612	300360	炬华科技	6,800	118,252.00	0.07
613	300443	金雷股份	4,200	118,146.00	0.07
614	603599	广信股份	10,280	118,014.40	0.07
615	000049	德赛电池	4,380	117,734.40	0.07
616	002258	利尔化学	9,020	117,711.00	0.07
617	002985	北摩高科	3,700	117,401.00	0.07
618	688139	海尔生物	3,679	116,918.62	0.07
619	600458	时代新材	8,800	116,776.00	0.07
620	002531	天顺风能	17,000	116,620.00	0.07
621	300470	中密控股	3,100	116,560.00	0.07
622	002079	苏州固锝	12,200	116,510.00	0.07
623	002434	万里扬	12,200	116,266.00	0.07
624	603698	航天工程	3,000	116,250.00	0.07
625	600094	大名城	27,900	116,064.00	0.07
626	000600	建投能源	13,600	116,008.00	0.07
627	600252	中恒集团	42,300	115,902.00	0.07
628	300232	洲明科技	16,300	115,567.00	0.07
629	301127	武汉天源	7,600	115,444.00	0.07

630	301571	国科天成	2,000	115,360.00	0.07
631	688165	埃夫特智能	4,852	115,283.52	0.07
632	301589	诺瓦星云	700	115,185.00	0.07
633	600269	赣粤高速	22,100	114,699.00	0.07
634	601702	华峰铝业	5,600	114,632.00	0.07
635	603496	恒为科技	4,200	114,576.00	0.07
636	688690	纳微科技	4,435	114,467.35	0.07
637	002243	力合科创	11,500	114,425.00	0.07
638	000012	南玻A	25,800	114,294.00	0.07
639	300027	华谊兄弟	52,600	114,142.00	0.07
640	301487	盟固利	5,200	114,036.00	0.07
641	002897	意华股份	2,100	113,547.00	0.07
642	300284	苏交科	14,400	113,472.00	0.07
643	002421	达实智能	39,800	113,430.00	0.07
644	002254	泰和新材	11,300	113,226.00	0.07
645	002859	洁美科技	4,100	113,160.00	0.07
646	300171	东富龙	7,200	113,040.00	0.07
647	603100	川仪股份	4,910	112,930.00	0.07
648	300451	创业慧康	23,300	112,772.00	0.07
649	688091	上海谊众药业	2,398	112,706.00	0.07
650	688352	颀中科技	8,919	112,468.59	0.07
651	300723	一品红	3,350	112,392.50	0.07
652	002626	金达威	5,700	112,347.00	0.07
653	688658	悦康药业	4,967	112,303.87	0.07
654	000029	深深房A	5,100	112,302.00	0.07
655	002892	科力尔	8,340	111,922.80	0.07
656	600744	华银电力	19,000	111,720.00	0.07
657	603279	景津装备	6,620	111,679.40	0.07
658	300492	华图山鼎	1,500	111,450.00	0.07
659	000966	长源电力	26,100	111,447.00	0.07
660	600125	铁龙物流	17,300	111,412.00	0.07
661	688003	天准科技	1,891	111,379.90	0.07
662	688007	光峰科技	5,997	111,364.29	0.07
663	600059	古越龙山	12,000	111,120.00	0.07
664	600751	海航科技	29,000	111,070.00	0.07
665	603533	掌阅科技	5,000	110,600.00	0.06
666	002993	奥海科技	2,530	110,586.30	0.06
667	600682	南京新百	12,600	110,124.00	0.06
668	688776	国光电气	1,085	109,302.90	0.06
669	002093	国脉科技	9,500	109,250.00	0.06
670	002127	南极电商	32,400	109,188.00	0.06

671	600006	东风股份	15,200	109,136.00	0.06
672	300401	花园生物	7,200	108,864.00	0.06
673	002219	新里程	51,100	108,843.00	0.06
674	002588	史丹利	10,900	108,782.00	0.06
675	600623	华谊集团	14,100	108,711.00	0.06
676	000990	诚志股份	13,700	108,504.00	0.06
677	300298	三诺生物	6,320	108,135.20	0.06
678	600729	重庆百货	4,152	107,952.00	0.06
679	688639	华恒生物	3,304	107,644.32	0.06
680	002534	西子洁能	6,400	107,328.00	0.06
681	300770	新媒股份	2,530	107,297.30	0.06
682	000928	中钢国际	16,200	107,082.00	0.06
683	600710	苏美达	9,900	107,019.00	0.06
684	600033	福建高速	25,900	106,967.00	0.06
685	002881	美格智能	2,400	106,944.00	0.06
686	601908	京运通	27,300	106,743.00	0.06
687	300633	开立医疗	4,031	106,499.02	0.06
688	688408	中信博新 能源	2,520	106,117.20	0.06
689	002668	TCL 智家	10,200	105,876.00	0.06
690	301091	深城交	3,950	105,623.00	0.06
691	600502	安徽建工	22,500	105,525.00	0.06
692	600649	城投控股	23,700	105,465.00	0.06
693	688106	金宏气体	5,382	105,433.38	0.06
694	600586	金晶科技	18,721	105,399.23	0.06
695	300257	开山股份	7,500	105,375.00	0.06
696	301071	力量钻石	2,940	105,369.60	0.06
697	600597	光明乳业	13,000	105,170.00	0.06
698	300482	万孚生物	5,300	104,675.00	0.06
699	600017	日照港	34,800	104,400.00	0.06
700	300783	三只松鼠	4,500	104,175.00	0.06
701	002458	益生股份	12,400	103,912.00	0.06
702	301600	慧翰股份	800	103,848.00	0.06
703	002761	浙江建投	12,100	103,697.00	0.06
704	002511	中顺洁柔	12,100	103,576.00	0.06
705	603197	保隆科技	2,800	103,572.00	0.06
706	002929	润建股份	2,600	103,506.00	0.06
707	002081	金螳螂	30,000	102,600.00	0.06
708	601200	上海环境	12,740	102,557.00	0.06
709	603118	共进股份	8,900	102,350.00	0.06
710	002960	青鸟消防	9,734	102,304.34	0.06
711	600612	老凤祥	2,300	102,281.00	0.06
712	688549	中巨芯科	11,215	102,280.80	0.06

		技			
713	600757	长江传媒	11,500	102,120.00	0.06
714	603328	依顿电子	9,300	101,928.00	0.06
715	300463	迈克生物	9,100	101,829.00	0.06
716	603713	密尔克卫	1,817	101,334.09	0.06
717	002125	湘潭电化	7,100	100,536.00	0.06
718	002194	武汉凡谷	7,700	100,485.00	0.06
719	002061	浙江交科	25,240	100,455.20	0.06
720	000930	中粮科技	17,400	100,398.00	0.06
721	002351	漫步者	8,320	100,339.20	0.06
722	301297	富乐德	2,800	100,240.00	0.06
723	002038	双鹭药业	13,600	100,232.00	0.06
724	002158	汉钟精机	4,000	100,120.00	0.06
725	002110	三钢闽光	22,800	100,092.00	0.06
726	688032	禾迈股份	993	100,084.47	0.06
727	002925	盈趣科技	5,900	99,946.00	0.06
728	002867	周大生	8,200	99,876.00	0.06
729	603227	雪峰科技	12,000	99,840.00	0.06
730	603477	巨星农牧	5,800	99,818.00	0.06
731	600575	淮河能源	29,300	99,620.00	0.06
732	300119	瑞普生物	5,300	99,481.00	0.06
733	600012	皖通高速	6,700	99,294.00	0.06
734	600305	恒顺醋业	12,500	99,000.00	0.06
735	600248	陕建股份	28,000	98,840.00	0.06
736	600664	哈药股份	28,600	98,670.00	0.06
737	000848	承德露露	11,600	98,600.00	0.06
738	688150	莱特光电 股份	3,645	98,524.35	0.06
739	603888	新华网	5,060	98,315.80	0.06
740	002913	奥士康	2,300	98,302.00	0.06
741	002077	大港股份	6,600	98,142.00	0.06
742	600123	兰花科创	16,550	97,810.50	0.06
743	688739	成大生物	3,789	97,604.64	0.06
744	603508	思维列控	3,500	97,370.00	0.06
745	000767	晋控电力	34,600	96,880.00	0.06
746	002777	久远银海	5,400	96,876.00	0.06
747	300913	兆龙互连	1,840	96,839.20	0.06
748	000059	华锦股份	18,100	96,835.00	0.06
749	603733	仙鹤股份	4,000	96,680.00	0.06
750	688380	中微半导	3,005	96,610.75	0.06
751	600075	新疆天业	19,400	96,030.00	0.06
752	688522	纳睿雷达 科技	2,400	95,832.00	0.06

753	002498	汉缆股份	25,000	95,750.00	0.06
754	002832	比音勒芬	6,400	95,744.00	0.06
755	000950	重药控股	16,400	95,448.00	0.06
756	600292	远达环保	7,300	95,265.00	0.06
757	600395	盘江股份	20,400	95,064.00	0.06
758	605599	菜百股份	5,800	94,946.00	0.06
759	601952	苏垦农发	10,400	94,848.00	0.06
760	603297	永新光学	900	94,770.00	0.06
761	601595	上海电影	3,300	94,479.00	0.06
762	601326	秦港股份	26,900	93,881.00	0.06
763	000552	甘肃能化	40,400	93,324.00	0.05
764	600675	中华企业	34,300	92,953.00	0.05
765	600963	岳阳林纸	19,900	92,933.00	0.05
766	000913	钱江摩托	6,000	92,520.00	0.05
767	688515	裕太微电子	900	92,295.00	0.05
768	600928	西安银行	24,900	92,130.00	0.05
769	300151	昌红科技	6,100	91,988.00	0.05
770	300809	华辰装备	2,400	91,368.00	0.05
771	688190	云路先进材料股份	938	91,361.20	0.05
772	688575	亚辉龙生物	6,416	91,107.20	0.05
773	000813	德展健康	23,700	91,008.00	0.05
773	600058	五矿发展	7,900	91,008.00	0.05
775	600740	山西焦化	24,200	90,992.00	0.05
776	002516	旷达科技	13,800	90,942.00	0.05
777	002605	姚记科技	3,900	90,870.00	0.05
778	002946	新乳业	4,900	90,797.00	0.05
779	600557	康缘药业	6,400	90,304.00	0.05
780	603099	长白山	2,000	90,300.00	0.05
781	603128	华贸物流	14,800	90,280.00	0.05
782	603915	国茂股份	4,900	90,209.00	0.05
783	600812	华北制药	16,300	90,139.00	0.05
784	300134	大富科技	7,200	90,000.00	0.05
785	600167	联美控股	12,800	89,984.00	0.05
786	601900	南方传媒	6,700	89,847.00	0.05
787	688631	莱斯信息	1,309	89,116.72	0.05
788	603638	艾迪精密	4,700	88,971.00	0.05
789	300768	迪普科技	4,800	88,944.00	0.05
789	600217	中再资环	21,800	88,944.00	0.05
791	000028	国药一致	3,620	88,907.20	0.05
792	002705	新宝股份	6,200	88,412.00	0.05

793	300641	正丹股份	5,000	88,250.00	0.05
794	688686	奥普特科技	710	88,132.30	0.05
795	000048	京基智农	5,000	88,000.00	0.05
796	688432	有研硅	7,028	87,217.48	0.05
797	601163	三角轮胎	6,100	87,169.00	0.05
798	688107	安路科技	3,192	86,758.56	0.05
799	002755	奥赛康	5,300	86,549.00	0.05
800	001337	四川黄金	3,100	86,366.00	0.05
801	301267	华夏眼科	4,800	86,304.00	0.05
802	000756	新华制药	5,600	86,296.00	0.05
803	002727	一心堂	6,700	86,162.00	0.05
804	002635	安洁科技	6,200	85,932.00	0.05
805	002978	安宁股份	2,600	85,930.00	0.05
806	601500	通用股份	17,800	85,796.00	0.05
807	300579	数字认证	2,550	85,705.50	0.05
808	300080	易成新能	17,600	85,536.00	0.05
809	001914	招商积余	8,000	85,440.00	0.05
810	300705	九典制药	5,700	85,386.00	0.05
811	301087	可孚医疗	1,890	84,426.30	0.05
812	002051	中工国际	9,300	84,351.00	0.05
813	002612	朗姿股份	4,100	83,804.00	0.05
814	301238	瑞泰新材	4,100	83,640.00	0.05
815	600975	新五丰	14,200	83,638.00	0.05
816	600643	爱建集团	15,100	83,503.00	0.05
817	603383	顶点软件	2,300	83,053.00	0.05
818	601096	宏盛华源 铁塔集团	20,000	83,000.00	0.05
819	603033	三维股份	7,674	82,955.94	0.05
820	000828	东莞控股	7,700	82,852.00	0.05
821	603202	天有为	900	82,629.00	0.05
822	002563	森马服饰	15,200	82,384.00	0.05
823	000557	西部创业	16,500	82,170.00	0.05
824	301175	中科环保	13,800	81,558.00	0.05
825	300820	英杰电气	1,700	81,515.00	0.05
826	002399	海普瑞	6,900	81,351.00	0.05
827	002737	葵花药业	5,500	81,235.00	0.05
828	300341	麦克奥迪	4,900	80,066.00	0.05
829	688584	上海合晶 硅材料	3,616	79,335.04	0.05
830	603056	德邦股份	5,800	79,286.00	0.05
831	688443	智翔金泰	2,903	79,077.72	0.05
832	600861	北京人力	4,300	78,862.00	0.05

833	300926	博俊科技	2,400	78,672.00	0.05
834	301522	上大股份	2,000	78,340.00	0.05
835	002489	浙江永强	20,400	78,132.00	0.05
836	600163	中闽能源	14,400	78,048.00	0.05
837	601101	昊华能源	10,900	78,044.00	0.05
838	603229	奥翔药业	7,828	77,653.76	0.05
839	002101	广东鸿图	6,300	77,616.00	0.05
840	603919	金徽酒	3,800	77,596.00	0.05
841	605333	沪光股份	2,600	77,558.00	0.05
842	601033	永兴股份	5,100	77,163.00	0.05
843	688586	江航飞机 装备	5,883	76,714.32	0.05
844	301363	美好医疗	3,180	76,479.00	0.04
845	603317	天味食品	6,100	76,372.00	0.04
846	603025	大豪科技	4,240	76,150.40	0.04
847	002697	红旗连锁	12,800	76,032.00	0.04
848	002060	广东建工	21,100	75,960.00	0.04
849	002901	大博医疗	1,600	75,792.00	0.04
850	002216	三全食品	6,700	75,643.00	0.04
851	300861	美畅股份	5,060	75,545.80	0.04
852	600640	国脉文化	6,000	75,360.00	0.04
853	301000	肇民科技	1,900	74,803.00	0.04
854	603043	广州酒家	4,240	74,751.20	0.04
855	600335	国机汽车	11,400	74,214.00	0.04
856	601107	四川成渝	12,200	74,176.00	0.04
857	600894	广日股份	8,000	74,000.00	0.04
858	601801	皖新传媒	11,200	73,696.00	0.04
859	688552	航天南湖	2,025	73,548.00	0.04
860	600197	伊力特	5,300	73,352.00	0.04
861	002068	黑猫股份	8,300	73,206.00	0.04
862	300127	银河磁体	2,400	72,792.00	0.04
863	000550	江铃汽车	3,898	72,502.80	0.04
864	600020	中原高速	17,000	72,420.00	0.04
865	002882	金龙羽	2,400	72,384.00	0.04
866	003012	东鹏控股	11,000	72,050.00	0.04
867	001339	智微智能	1,400	71,554.00	0.04
868	603013	亚普股份	2,900	71,543.00	0.04
869	000498	山东路桥	11,800	71,154.00	0.04
870	600971	恒源煤电	11,400	71,136.00	0.04
871	000597	东北制药	13,600	70,992.00	0.04
872	000567	海德股份	11,054	70,966.68	0.04
873	688182	灿勤科技	2,402	70,907.04	0.04
874	603730	岱美股份	8,088	70,850.88	0.04

875	002390	信邦制药	22,000	70,840.00	0.04
876	688185	康希诺生物	1,122	70,517.70	0.04
877	002791	坚朗五金	3,300	69,993.00	0.04
878	600223	福瑞达	9,500	69,920.00	0.04
879	003006	百亚股份	3,200	69,888.00	0.04
880	603530	神马电力	1,700	69,836.00	0.04
881	601949	中国出版	10,800	69,660.00	0.04
882	600929	雪天盐业	12,300	69,495.00	0.04
883	301551	无线传媒	2,200	69,410.00	0.04
884	600810	神马股份	7,700	69,223.00	0.04
885	301015	百洋医药	2,900	68,440.00	0.04
886	600997	开滦股份	11,900	68,425.00	0.04
887	000719	中原传媒	5,800	68,208.00	0.04
888	002651	利君股份	5,800	67,802.00	0.04
889	301325	曼恩斯特	1,340	67,737.00	0.04
890	301109	军信股份	4,460	66,900.00	0.04
891	603355	莱克电气	2,100	66,633.00	0.04
892	605555	德昌股份	3,630	66,429.00	0.04
893	688209	英集芯科技	3,326	66,320.44	0.04
894	603093	南华期货	3,400	66,266.00	0.04
895	688252	天德钰科技	3,107	65,775.19	0.04
896	600639	浦东金桥	6,400	65,728.00	0.04
897	688128	中国电器研究院	2,229	64,819.32	0.04
898	601089	福元医药	2,700	64,800.00	0.04
899	600662	外服控股	12,900	64,758.00	0.04
900	301606	绿联科技	1,100	64,614.00	0.04
901	603567	珍宝岛	7,200	64,296.00	0.04
902	300183	东软载波	4,300	63,769.00	0.04
903	600508	上海能源	5,400	63,558.00	0.04
904	301153	中科江南	2,560	63,283.20	0.04
905	002267	陕天然气	8,400	63,252.00	0.04
906	603866	桃李面包	12,000	63,120.00	0.04
907	002041	登海种业	6,600	62,964.00	0.04
908	603826	坤彩科技	3,700	62,900.00	0.04
909	301047	义翘神州	930	62,868.00	0.04
910	688351	微创电生理股份	2,710	62,736.50	0.04
911	603162	海通发展	5,200	62,608.00	0.04
912	300917	特发服务	1,600	62,560.00	0.04

913	600403	大有能源	8,900	62,122.00	0.04
914	688348	昱能科技	1,224	61,677.36	0.04
915	301207	华兰疫苗	3,300	61,479.00	0.04
916	603299	苏盐井神	5,900	61,478.00	0.04
917	300702	天宇股份	2,600	61,360.00	0.04
918	603072	天和磁材科技	1,500	61,035.00	0.04
919	603327	福蓉科技	5,617	61,000.62	0.04
920	002242	九阳股份	5,800	60,552.00	0.04
921	001236	弘业期货	5,700	60,420.00	0.04
922	002053	云南能投	5,200	59,904.00	0.04
923	688232	国泰新点软件	2,409	59,791.38	0.04
924	688276	长春百克生物科技	3,141	59,239.26	0.03
925	301327	华宝新能	1,020	58,823.40	0.03
926	002840	华统股份	6,100	58,682.00	0.03
927	002543	万和电气	5,700	58,197.00	0.03
928	601038	一拖股份	4,100	58,097.00	0.03
929	301678	新恒汇	900	57,798.00	0.03
930	002302	西部建设	9,400	57,528.00	0.03
931	300406	九强生物	4,400	57,508.00	0.03
932	688177	百奥泰生物	2,466	57,063.24	0.03
933	688337	普源精电	1,535	56,626.15	0.03
934	601882	海天精工	2,900	56,434.00	0.03
935	600657	信达地产	16,300	56,235.00	0.03
936	600903	贵州燃气	8,500	56,185.00	0.03
937	605116	奥锐特	2,200	55,110.00	0.03
938	301268	铭利达	3,000	54,690.00	0.03
939	601083	锦江航运	4,900	54,684.00	0.03
940	000899	赣能股份	5,500	54,450.00	0.03
941	301376	致欧科技	3,000	54,210.00	0.03
942	000030	富奥股份	9,400	53,956.00	0.03
943	603193	润本生物技术股份	2,200	53,306.00	0.03
944	688001	苏州华兴源创科技	1,765	53,267.70	0.03
945	301565	中仑新材	2,200	53,108.00	0.03
946	603983	丸美生物	1,600	53,040.00	0.03
947	000058	深赛格	5,600	52,640.00	0.03
948	601858	中国科传	2,900	52,635.00	0.03
949	605009	豪悦护理	1,680	51,912.00	0.03

950	301631	壹连科技	500	51,775.00	0.03
951	301215	中汽股份	7,400	50,690.00	0.03
952	600726	华电能源	21,000	50,190.00	0.03
953	600618	氯碱化工	4,200	49,896.00	0.03
954	002287	奇正藏药	2,100	49,686.00	0.03
955	000885	城发环境	3,600	49,392.00	0.03
956	301556	托普云农	500	49,020.00	0.03
957	301500	飞南资源	3,120	48,952.80	0.03
958	301592	六九一二	400	48,880.00	0.03
959	601003	柳钢股份	9,700	48,791.00	0.03
960	300856	科思股份	3,580	48,258.40	0.03
961	603055	台华新材	5,100	48,144.00	0.03
962	301458	钧崴电子	1,500	48,135.00	0.03
963	301339	通行宝	3,280	47,691.20	0.03
964	000761	本钢板材	14,000	46,900.00	0.03
965	002275	桂林三金	3,300	46,530.00	0.03
966	601022	宁波远洋	5,000	45,850.00	0.03
967	301004	嘉益股份	880	45,804.00	0.03
968	600746	江苏索普	6,600	45,408.00	0.03
969	301381	赛维时代	2,200	45,298.00	0.03
970	301622	英思特	700	45,080.00	0.03
971	002911	佛燃能源	3,649	44,225.88	0.03
972	603395	中盐红四方	1,500	43,845.00	0.03
973	000019	深粮控股	6,300	43,785.00	0.03
974	001356	富岭股份	3,200	41,344.00	0.02
975	301508	中机认检	1,300	40,638.00	0.02
976	300755	华致酒行	2,300	40,526.00	0.02
977	001308	康冠科技	1,900	39,634.00	0.02
978	603194	中力股份	1,000	39,310.00	0.02
979	603693	江苏新能	3,300	39,138.00	0.02
980	605296	神农集团	1,300	38,116.00	0.02
981	003039	顺控发展	2,300	36,639.00	0.02
982	301371	敷尔佳	1,530	36,245.70	0.02
983	603219	富佳股份	2,100	35,364.00	0.02
984	603057	上海紫燕食品	1,600	32,544.00	0.02
985	605099	共创草坪	900	32,121.00	0.02
986	301275	汉朔科技	600	32,052.00	0.02
987	601068	中铝国际	6,000	31,740.00	0.02
988	603014	威高血净	800	31,704.00	0.02
989	605011	杭州热电	1,500	30,660.00	0.02
990	605118	力鼎光电	1,000	30,110.00	0.02

991	605198	安德利	800	30,096.00	0.02
992	601811	新华文轩	2,200	29,524.00	0.02
993	688726	拉普拉斯	730	26,280.00	0.02
994	301602	超研股份	1,100	23,694.00	0.01
995	603103	横店影视	1,400	23,212.00	0.01
996	301177	迪阿股份	800	23,096.00	0.01
997	301658	首航新能	800	22,848.00	0.01
998	301262	海看股份	900	22,401.00	0.01
999	603262	技源集团	700	19,943.00	0.01
1000	301665	泰禾股份	700	19,768.00	0.01

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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	300779	惠城环保	2,673,742.00	0.98
2	300972	万辰集团	2,080,122.20	0.76
3	002456	欧菲光	1,943,618.00	0.71
4	300757	罗博特科	1,876,175.00	0.69
5	300953	震裕科技	1,570,114.40	0.57
6	001309	德明利	1,556,613.00	0.57
7	300570	太辰光	1,537,737.00	0.56
8	002402	和而泰	1,458,329.00	0.53
9	002847	盐津铺子	1,374,902.20	0.50
10	300672	国科微	1,370,961.00	0.50
11	300620	光库科技	1,359,759.00	0.50
12	300841	康华生物	1,281,509.00	0.47
13	300666	江丰电子	1,231,801.19	0.45
14	301095	广立微	1,231,247.00	0.45
15	003021	兆威机电	1,229,533.00	0.45
16	301035	润丰股份	1,203,852.00	0.44
17	002222	福晶科技	1,180,993.42	0.43
18	300548	长芯博创	1,173,878.00	0.43
19	300624	万兴科技	1,158,706.00	0.42
20	300085	银之杰	1,156,275.00	0.42

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	300779	惠城环保	3,214,514.00	1.18
2	002456	欧菲光	2,894,856.00	1.06
3	002402	和而泰	2,823,793.00	1.03
4	300757	罗博特科	2,503,340.00	0.92
5	300570	太辰光	2,320,636.00	0.85
6	002126	银轮股份	2,280,494.99	0.83
7	300296	利亚德	2,098,261.00	0.77
8	300972	万辰集团	2,023,949.00	0.74
9	688235	百济神州	1,802,740.65	0.66
10	001309	德明利	1,762,016.00	0.64
11	002851	麦格米特	1,732,997.00	0.63
12	300458	全志科技	1,709,013.40	0.62
13	300857	协创数据	1,701,087.00	0.62
14	300672	国科微	1,686,246.00	0.62
15	002405	四维图新	1,644,519.50	0.60
16	003021	兆威机电	1,601,523.00	0.59
17	300085	银之杰	1,599,194.00	0.58
18	002130	沃尔核材	1,566,786.00	0.57
19	688608	恒玄科技	1,554,412.42	0.57
20	002222	福晶科技	1,551,513.00	0.57

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	352,066,567.85
卖出股票收入（成交）总额	440,001,663.12

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	25,625.49	0.02
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	25,625.49	0.02

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127111	金威转债	176	25,625.49	0.02

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行投资，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

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

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,518,546.89
2	应收清算款	1,917,864.33
3	应收股利	-
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	3,436,411.22

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## § 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

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	中信银行股份有限公司-汇添富中证 1000 交易型开放式指数证

)						券投资基金联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%) )	持有份额	占总 份额 比例 (%) )	持有份额	占总 份额 比例 (%) )
3,884	39,110.0 7	51,770,600. 00	34.0 8	100,132,900. 00	65.9 2	11,474,900. 00	7.55

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例 （%）
1	邱莉莎	8,354,600.00	5.50
2	王一静	7,071,000.00	4.65
3	中信证券股份有限公司—汇添富多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	5,288,600.00	3.48
4	国泰海通证券股份有限公司	4,914,600.00	3.24
5	广发证券股份有限公司	4,144,100.00	2.73
6	招商证券股份有限公司	4,072,109.00	2.68
7	国信证券股份有限公司	3,712,850.00	2.44
8	上海柏泰华盈私募基金管理有限公司—柏泰华盈常青藤套利 2 号私募证券投资基金	3,208,900.00	2.11
9	UBS AG	2,865,100.00	1.89
10	泰康资管—招商银行—泰康资产管理有限责任公司可转债资产管理产品	2,365,600.00	1.56
11	中信银行股份有限公司—汇添富中证	11,474,900.00	7.55

	1000 交易型开放式 指数证券投资基金 联接基金		
--	---------------------------------	--	--

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.5 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

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

基金合同生效日（2022 年 07 月 29 日）基金份额总额	3,634,903,500.00
本报告期期初基金份额总额	313,903,500.00
本报告期基金总申购份额	366,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	528,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	151,903,500.00

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。

## § 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。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司发生以下重大人事变更：

2025 年 4 月，经国家金融监督管理总局核准，芦苇先生正式就任中信银行行长。

2025 年 12 月，芦苇先生因工作调整，辞去本行执行董事、行长、董事会风险管理委员会主席及委员、董事会战略与可持续发展委员会委员职务。同日，本行董事会审议通过由方合英先生代为履行行长职责。上述事项对中信银行公募基金业务无影响。

## 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。

本报告期内，中信银行股份有限公司托管业务未涉及基金托管业务的诉讼。

## 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（2022 年 07 月 29 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 30,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作、其他问题（基金销售等）
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》

	《公开募集证券投资基金运作管理办法》 《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题及整改要求，通过完善制度、优化管理等完成相关问题整改并已通过监管检查验收。公司将从严加强内控及各业务管理，持续提升管理质效。
其他	无

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

### 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，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

### 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 (%)	
中信证券	4	493,906,306.13	62.36	86,885.35	62.36	
东方证券	2	297,429,225.84	37.55	52,317.56	37.55	
招商证券	2	732,699.00	0.09	128.67	0.09	
国泰海通	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
银河证券	2	-	-	-	-	

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

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰	-	-	-	-	-	-	-	-

海通								
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 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:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加渤海证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,深交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2025年01月09日
2	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
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	2025年03月31日

		国证监会基金电子披露网站	
4	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
5	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
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报, 上交所, 深交所	2025 年 04 月 30 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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券为申购赎回代理券商的公告	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 06 月 23 日
9	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
10	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	上交所, 中证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 07 月 01 日
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,	2025 年 07 月 29 日

		上证报	
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西部证券为申购赎回代理券商的公告	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 08 月 06 日
17	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
18	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
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西南证券为申购赎回代理券商的公告	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 09 月 10 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加民生证券为申购赎回代理券商的公告	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 09 月 23 日
21	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
22	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	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 11 月 17 日
23	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, 上交所	2025 年 11 月 20 日
24	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, 上交所	2025 年 11 月 20 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
26	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分上交所基金变更扩位证券简称的公告	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 12 月 29 日
27	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 12 月 30 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中证 1000 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 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 1000 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 1000 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。

### 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](http://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