

# 深证 300 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	19
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	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	23
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	23
§ 5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	23
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	24
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	24
§ 6 审计报告	24
6.1 审计报告的基本信息	24
6.2 审计报告的基本内容	24
§ 7 年度财务报表	26
7.1 资产负债表	26
7.2 利润表	27
7.3 净资产变动表	28
7.4 报表附注	30
§ 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.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
8.12 投资组合报告附注.....	69
§ 9 基金份额持有人信息.....	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	71
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.....	71
§ 10 开放式基金份额变动.....	72
§ 11 重大事件揭示.....	72
11.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
11.4 基金投资策略的改变.....	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11.8 其他重大事件.....	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
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.....	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§ 13 备查文件目录.....	82
13.1 备查文件目录.....	82
13.2 存放地点.....	82
13.3 查阅方式.....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富深证 300ETF
场内简称	深 300ETF 汇添富
基金主代码	159912
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 09 月 16 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	75,948,991.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 11 月 24 日

### 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最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，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动进行相应调整。当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	深证 300 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场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	中国工商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	(010) 66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-888-9918	95588	
传真	021-28932998	(010) 66105798	
注册地址	上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
邮政编码	200010	100140	
法定代表人	鲁伟铭	廖林	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	9,725,778.97	-361,780.79	-1,455,619.83
本期利润	37,646,004.02	11,467,886.57	-13,628,380.03
加权平均基 金份额本期 利润	0.4325	0.1386	-0.2209
本期加权平 均净值利润 率	27.89%	10.76%	-15.28%
本期基金份	31.16%	11.13%	-14.50%

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	64,998,398.60	40,844,656.79	19,383,123.85
期末可供分配基金份额利润	0.8558	0.4149	0.2732
期末基金资产净值	140,947,389.60	139,293,647.79	90,332,114.85
期末基金份额净值	1.8558	1.4149	1.2732
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	85.58%	41.49%	27.32%

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	-0.86%	1.35%	-0.96%	1.35%	0.10%	0.00%
过去六个月	30.41%	1.30%	29.91%	1.30%	0.50%	0.00%
过去一年	31.16%	1.31%	29.55%	1.31%	1.61%	0.00%

过去三年	24.62%	1.39%	20.44%	1.39%	4.18%	0.00%
过去五年	-6.67%	1.39%	-10.68%	1.39%	4.01%	0.00%
自基金合同生效起至今	85.58%	1.52%	67.41%	1.54%	18.17%	-0.02%

### 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

汇添富深证300ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

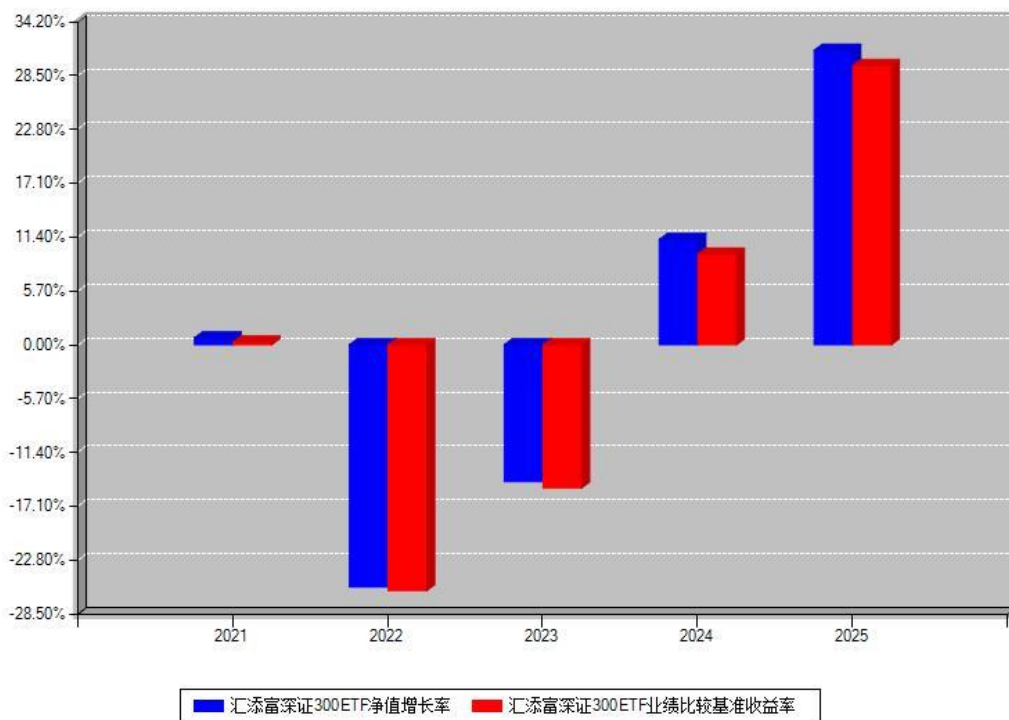


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2011年09月16日）起3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

### 3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富深证300ETF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 2011 年 09 月 16 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		
何丽竹	本基金的 基金经理	2025 年 05 月 16 日	-	5	<p>国籍：中国。学历：复旦大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。</p> <p>从业经历：2021 年 7 月起加入汇添富基金管理股份有限公司。</p> <p>2025 年 3 月 18 日至今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。2025 年 3 月 18 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 3 月 21 日至今任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月 21 日至今任汇添富中证机器人交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2025 年 4 月 30 日至今任汇添富中证 800 自由现</p>

					<p>金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 13 日至 2025 年 7 月 28 日任汇添富国证自由现金流指数型证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 16 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月 16 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 15 日至今任汇添富中证机器人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 7 月 17 日至今任汇添富国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月 29 日至今任汇添富国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>的基金经理。</p> <p>2025 年 8 月 5 日至今任汇添富中证 800 自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 8 月 18 日至今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。2025 年 8 月 18 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 8 月 18 日至今任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 25 日至今任汇添富上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月 29 日至今任汇添富中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
晏阳	本基金的基金经理	2023 年 05 月 22 日	2025 年 05 月 16 日	9	<p>国籍：中国。学历：哥伦比亚大学统计学硕士。从业资格：证券</p>

				<p>                     投资基金从业资格。从业经历：                      2016 年 9 月至 2021 年 8 月任中证指数有限公司研究员、高级研究员。2021 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。2022 年 7 月 13 日至今任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 27 日至今任汇添富北证 50 成份指数型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月 16 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月 14 日至今任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 4 月                 </p>
--	--	--	--	--

					<p>13 日至今任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 5 月 22 日至 2025 年 5 月 16 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 22 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 20 日至今任汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月 11 日至 2025 年 1 月 22 日任汇添富华证专精特新 100 指数型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 26 日至今任汇添富中证红利交易型</p>
--	--	--	--	--	--

				<p>开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 21 日至今任汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 11 月 28 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p> <p>2023 年 12 月 5 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的基金经理。</p> <p>2024 年 2 月 2 日至今任汇添富中证国新央企股东回报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 4 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 5 月 31 日至今任汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024</p>
--	--	--	--	--

				<p>年6月12日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2025年5月13日至2025年7月28日任汇添富国证自由现金流指数型证券投资基金的基金经理。2025年6月4日至今任汇添富中证油气资源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>2025年7月29日至今任汇添富国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025年8月5日至今任汇添富中证800自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2025年11月19日至今任汇添富恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年11月25日至今任汇添富标普港股通低波红利指数型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合;涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:

在研究分析环节,公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统,规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程,使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节,公司建立健全投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限,合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节,本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门,实行了集中交易制度

和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

### 4.3.3 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，国内资本市场稳中有升，市场信心持续修复。

从市场表现来看，A 股整体上涨，上证指数全年涨幅达 18.41%。风格方面，市场分化明显，成长风格大幅跑赢价值风格，有色、通信、电子等行业领涨市场，人工智能为代表的科技领域和有色为代表的周期板块表现突出，成为市场焦点。交易活跃度方面，市场全年成交活跃，年末两市成交一度接近每日四万亿元。整体说来，市场 2025 年先有一定下跌后强势回暖，走势稳健。

经济数据方面，中国经济景气水平总体回升。12 月制造业 PMI 指数为 50.1，时隔 8 个月重返扩张区间，这显示制造业产需两端均较上月有一定扩张。1-11 月工业增加值累计同比增长 6.0%，高技术制造业增幅居前。社会消费品零售总额 1-11 月累计同比增长 4.0%，但自 6 月以来增速下滑，整体消费动能仍有待提振。四季度，中美关税摩擦升级，但随后沟通谈判进展顺利。当前全球地缘冲突加剧，关税等摩擦可能成为未来一段时间的常态，但市场对关税冲击的敏感度已逐渐下降。

本基金跟踪深证 300 指数，指数选取了深交所市值较大的 300 只股票作为指数样本，以表征深市整体表现。报告期内，本基金按照被动投资的原则，采用完全复制法，实现了对深证 300 指数的良好跟踪。

### 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 31.16%，同期业绩比较基准收益率为 29.55%。

## 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，作为“十五五”开局之年，国内政策发力可期，中国经济新动能、新势

力有望保持强劲势头。从外部环境来看，2026 年仍有较多不确定性，地缘冲突频繁，国际竞争或将影响各产业领域。2026 年，国内经济聚焦高质量发展，新质生产力驱动产业跃升、激活内需仍是经济增长的关键。

#### 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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例依据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的。

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

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

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

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

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70015647_B18 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	深证 300 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	我们审计了深证 300 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，后附的深证 300 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，公允反映了深证 300 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，我们独立于深证 300 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。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负

	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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，管理层负责评估深证 300 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>治理层负责监督深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，就可能对深证 300 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</p>

	<p>而，未来的事项或情况可能导致深证 300 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：深证 300 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	908,165.60	478,854.14
结算备付金		-	4,240.82
存出保证金		690.73	2,953.50
交易性金融资产	7.4.7.2	140,276,020.23	138,980,306.90
其中：股票投资		140,276,020.23	138,964,027.19
基金投资		-	-
债券投资		-	16,279.71
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		-	92,442.50
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		141,184,876.56	139,558,797.86
<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		13,597.22	106.15
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		62,443.44	63,238.48
应付托管费		12,488.67	12,647.71
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	148,957.63	189,157.73
负债合计		237,486.96	265,150.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	75,948,991.00	98,448,991.00
未分配利润	7.4.7.9	64,998,398.60	40,844,656.79
净资产合计		140,947,389.60	139,293,647.79
负债和净资产总计		141,184,876.56	139,558,797.86

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8558 元，基金份额总额 75,948,991.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：深证 300 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>38,611,158.17</b>	<b>12,396,710.81</b>
1. 利息收入		2,224.36	1,765.71
其中：存款利息收入	7.4.7.10	2,224.36	1,765.71
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,745,403.96	635,429.70
其中：股票投资收益	7.4.7.11	8,110,382.22	-1,607,291.32
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	22,315.78	2.49
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	2,612,705.96	2,242,718.53
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	27,920,225.05	11,829,667.36
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	-56,695.20	-70,151.96
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>965,154.15</b>	<b>928,824.24</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	674,523.32	530,975.13
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	134,904.60	106,195.11
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		0.02	-
8. 其他费用	7.4.7.21	155,726.21	291,654.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>37,646,004.02</b>	<b>11,467,886.57</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>37,646,004.02</b>	<b>11,467,886.57</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>37,646,004.02</b>	<b>11,467,886.57</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：深证 300 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	98,448,991.00	40,844,656.79	139,293,647.79
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	98,448,991.00	40,844,656.79	139,293,647.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-22,500,000.00	24,153,741.81	1,653,741.81
（一）、综合收益总额	-	37,646,004.02	37,646,004.02
（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）	-22,500,000.00	-13,492,262.21	-35,992,262.21
其中：1. 基金申购款	42,500,000.00	22,525,036.77	65,025,036.77
2. 基金赎回款	-65,000,000.00	-36,017,298.98	-101,017,298.98
（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	75,948,991.00	64,998,398.60	140,947,389.60
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	70,948,991.00	19,383,123.85	90,332,114.85
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	70,948,991.00	19,383,123.85	90,332,114.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,500,000.00	21,461,532.94	48,961,532.94
（一）、综合收益总额	-	11,467,886.57	11,467,886.57
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	27,500,000.00	9,993,646.37	37,493,646.37

(净资产减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	57,500,000.00	22,880,219.01	80,380,219.01
2. 基金赎回款	-30,000,000.00	-12,886,572.64	-42,886,572.64
(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	98,448,991.00	40,844,656.79	139,293,647.79

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

深证 300 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〔2011〕886 号文《关于核准汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》准予注册，由汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2011 年 9 月 16 日生效。首次设立基金募集规模为 521,548,991.00 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（2011）验字第 60466941\_B08 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 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、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。

基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见招募说明书；

2、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，即基金收益分配基准日基金份额净值在扣减每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例依据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的；

4、本基金收益分配采取现金分红方式；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 1. 印花税

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

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

### 2. 增值税

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

不征收增值税；

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

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

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

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

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

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4. 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》

的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 5. 个人所得税

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

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

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	908,165.60	478,854.14
等于：本金	908,070.14	478,805.91
加：应计利息	95.46	48.23
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-

加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	908,165.60	478,854.14

### 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	111,620,006.50	-	140,276,020.23	28,656,013.73	
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	111,620,006.50	-	140,276,020.23	28,656,013.73	
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	138,231,615.73	-	138,964,027.19	732,411.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	12,900.00	2.49	16,279.71	3,377.22
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	12,900.00	2.49	16,279.71	3,377.22
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	138,244,515.73	2.49	138,980,306.90	735,788.68	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 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	1,957.63	2,657.73
其中：交易所市场	1,957.63	2,657.73
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	27,000.00	31,500.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	-	35,000.00
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	148,957.63	189,157.73

#### 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	98,448,991.00	98,448,991.00
本期申购	42,500,000.00	42,500,000.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-65,000,000.00	-65,000,000.00
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	75,948,991.00	75,948,991.00

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	86,630,022.37	-45,785,365.58	40,844,656.79
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	86,630,022.37	-45,785,365.58	40,844,656.79
本期利润	9,725,778.97	27,920,225.05	37,646,004.02
本期基金份额交易产生的变动数	-20,376,908.79	6,884,646.58	-13,492,262.21
其中：基金申购款	38,238,507.74	-15,713,470.97	22,525,036.77
基金赎回款	-58,615,416.53	22,598,117.55	-36,017,298.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,978,892.55	-10,980,493.95	64,998,398.60

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,185.97	1,621.50
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	32.22	133.75
其他	6.17	10.46
合计	2,224.36	1,765.71

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	-285,512.66	-2,272,770.72
股票投资收益——赎回差价收入	8,395,894.88	665,479.40
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	8,110,382.22	-1,607,291.32

#### 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 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
卖出股票成交总额	11,391,406.48	9,075,132.95
减：卖出股票成本总额	11,664,803.41	11,333,949.29
减：交易费用	12,115.73	13,954.38
买卖股票差价收入	-285,512.66	-2,272,770.72

#### 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 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
赎回基金份额对价总额	101,017,298.98	42,886,572.64
减：现金支付赎回款总额	-322,369.02	-479,837.36
减：赎回股票成本总额	92,943,773.12	42,700,930.60
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	8,395,894.88	665,479.40

### 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	14.35	2.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	22,301.43	-
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	22,315.78	2.49

#### 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	116,223.15	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	93,900.00	-
减：应计利息总额	17.06	-
减：交易费用	4.66	-
买卖债券差价收入	22,301.43	-

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具其他投资收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 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	2,612,705.96	2,242,718.53
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,612,705.96	2,242,718.53

#### 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	27,920,225.05	11,829,667.36
——股票投资	27,923,602.27	11,826,290.14
——债券投资	-3,377.22	3,377.22
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品 公允价值变动产生的 预估增值税	-	-
合计	27,920,225.05	11,829,667.36

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月 31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-56,695.20	-70,151.96
其他	-	-

合计	-56,695.20	-70,151.96
----	------------	------------

#### 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	27,000.00	31,500.00
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	170.00	154.00
指数使用费	8,556.21	140,000.00
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	155,726.21	291,654.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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
汇添富深证 300 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	16,342,810.38	61.09	22,765,000.95	100.00

###### 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	98,841.46	85.04	-	-

###### 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	2,874.39	61.09	126.67	6.47
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	7,956.95	100.00	2,657.73	100.00

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。截至 2024 年 6 月 30 日止，该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	674,523.32	530,975.13
其中：应支付销售机构的客户维护费	71,581.11	20,902.17
应支付基金管理人的净管理费	602,942.21	510,072.96

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年01月01日至2025年12月31日	2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	134,904.60	106,195.11

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限

费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

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 (%)
汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	50,185,842.00	66.08	52,707,942.00	53.54

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
工商银行	908,165.60	2,185.97	478,854.14	1,621.50

##### 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：本基金本报告期末未进行利润分配。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
002049	紫光国微	2025 年 12 月 30 日	重大事件停牌	78.81	2026 年 01 月 15 日	86.69	7,085	501,425.03	558,368.85	

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 7.4.13.2 信用风险

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

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

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动

性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年12 月31 日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	908,165.60	-	-	-	-	-	908,165.60
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	690.73	-	-	-	-	-	690.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	140,276,020.23	140,276,020.23
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	908,856.33	-	-	-	-	140,276,020.23	141,184,876.56
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	-	-	-	-	-	13,597.22	13,597.22
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报	-	-	-	-	-	62,443.44	62,443.44

酬							
应付 托管 费	-	-	-	-	-	12,488.67	12,488.67
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	-	-	-	-	-	148,957.63	148,957.63
负债 总计	-	-	-	-	-	237,486.96	237,486.96
利率 敏感 度缺 口	908,856.33	-	-	-	-	140,038,533.27	140,947,389.60
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	478,854.14	-	-	-	-	-	478,854.14
结算 备付 金	4,240.82	-	-	-	-	-	4,240.82
存出 保证 金	2,953.50	-	-	-	-	-	2,953.50
交易	-	-	16,279.71	-	-	138,964,027.19	138,980,306.90

性金融资产							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	92,442.50	92,442.50
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	486,048.46	-	16,279.71	-	-	139,056,469.69	139,558,797.86
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	-	-	-	-	-	106.15	106.15

清算款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	63,238.48	63,238.48
应付托管费	-	-	-	-	-	12,647.71	12,647.71
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	-	-	-	-	-	189,157.73	189,157.73
负债总计	-	-	-	-	-	265,150.07	265,150.07
利率敏感度缺口	486,048.46	-	16,279.71	-	-	138,791,319.62	139,293,647.79

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	140,276,020.23	99.52	138,964,027.19	99.76
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	16,279.71	0.01
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	140,276,020.23	99.52	138,980,306.90	99.78

#### 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
	深证 300 指数上涨 5%	7,024,038.22	6,947,505.19
	深证 300 指数下跌 5%	-7,024,038.22	-6,947,505.19

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	139,717,651.38	138,500,083.04
第二层次	558,368.85	480,223.86
第三层次	-	-
合计	140,276,020.23	138,980,306.90

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

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	140,276,020.23	99.36
	其中：股票	140,276,020.23	99.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	908,165.60	0.64
8	其他各项资产	690.73	0.00
9	合计	141,184,876.56	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	2,642,366.98	1.87
B	采矿业	1,956,007.42	1.39
C	制造业	109,877,266.67	77.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,002,764.98	0.71
E	建筑业	119,970.00	0.09
F	批发和零售业	768,627.85	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,386,011.84	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,312,644.98	5.19
J	金融业	10,809,923.67	7.67

K	房地产业	865,814.02	0.61
L	租赁和商务服务业	1,213,762.56	0.86
M	科学研究和技术服务业	945,068.50	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	112,320.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	684,488.04	0.49
R	文化、体育和娱乐业	578,982.72	0.41
S	综合	-	-
	合计	140,276,020.23	99.52

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	300750	宁德时代	27,728	10,183,385.28	7.22
2	300308	中际旭创	9,252	5,643,720.00	4.00
3	300502	新易盛	9,640	4,153,683.20	2.95
4	000333	美的集团	52,284	4,085,994.60	2.90
5	300059	东方财富	139,084	3,223,967.12	2.29
6	002475	立讯精密	50,588	2,868,845.48	2.04
7	300274	阳光电源	16,060	2,746,902.40	1.95
8	002594	比亚迪	27,479	2,685,247.88	1.91
9	000858	五粮液	19,468	2,062,439.92	1.46
10	002371	北方华创	4,135	1,898,295.80	1.35
11	300476	胜宏科技	6,600	1,898,028.00	1.35
12	000651	格力电器	46,348	1,864,116.56	1.32
13	300124	汇川技术	21,252	1,600,913.16	1.14
14	000725	京东方A	356,708	1,501,740.68	1.07
15	002714	牧原股份	27,089	1,370,161.62	0.97
16	000063	中兴通讯	34,283	1,297,268.72	0.92

17	002050	三花智控	22,956	1,269,696.36	0.90
18	300760	迈瑞医疗	6,600	1,256,970.00	0.89
19	002415	海康威视	39,811	1,187,960.24	0.84
20	002384	东山精密	13,550	1,147,007.50	0.81
21	000425	徐工机械	94,698	1,096,602.84	0.78
22	002463	沪电股份	14,630	1,069,014.10	0.76
23	002230	科大讯飞	20,885	1,050,306.65	0.75
24	000001	平安银行	91,121	1,039,690.61	0.74
25	002142	宁波银行	36,870	1,035,678.30	0.73
26	300498	温氏股份	59,897	1,011,061.36	0.72
27	002352	顺丰控股	25,800	988,656.00	0.70
28	000792	盐湖股份	34,900	982,784.00	0.70
29	300394	天孚通信	4,760	966,422.80	0.69
30	002028	思源电气	6,100	942,999.00	0.67
31	000338	潍柴动力	54,824	942,972.80	0.67
32	300014	亿纬锂能	14,318	941,551.68	0.67
33	000568	泸州老窖	8,022	932,316.84	0.66
34	000100	TCL 科技	195,477	887,465.58	0.63
35	002625	光启技术	17,100	833,796.00	0.59
36	002027	分众传媒	108,688	801,030.56	0.57
37	002241	歌尔股份	26,690	766,803.70	0.54
38	002460	赣锋锂业	12,120	762,226.80	0.54
39	000807	云铝股份	22,500	738,900.00	0.52
40	000977	浪潮信息	11,011	733,332.60	0.52
41	000988	华工科技	9,046	717,619.18	0.51
42	300033	同花顺	2,132	686,887.76	0.49
43	000776	广发证券	30,292	667,029.84	0.47
44	002709	天赐材料	14,160	656,032.80	0.47
45	000408	藏格矿业	7,700	649,880.00	0.46
46	300433	蓝思科技	21,019	636,245.13	0.45
47	300408	三环集团	13,600	622,200.00	0.44
48	002916	深南电路	2,672	620,678.88	0.44
49	002466	天齐锂业	11,000	609,180.00	0.43
50	300450	先导智能	11,806	590,063.88	0.42
51	002558	巨人网络	13,200	571,428.00	0.41
52	002202	金风科技	27,576	562,550.40	0.40
53	002049	紫光国微	7,085	558,368.85	0.40
54	000625	长安汽车	46,775	554,751.50	0.39
55	002738	中矿资源	6,820	535,711.00	0.38
56	002600	领益智造	33,800	525,252.00	0.37
57	300803	指南针	3,995	522,825.65	0.37
58	002532	天山铝业	32,200	520,996.00	0.37
59	300015	爱尔眼科	46,890	514,852.20	0.37

60	000426	兴业银锡	14,400	512,640.00	0.36
61	000630	铜陵有色	81,535	490,025.35	0.35
62	000938	紫光股份	19,558	481,126.80	0.34
63	000166	申万宏源	90,206	475,385.62	0.34
64	300115	长盈精密	10,200	474,300.00	0.34
65	002156	通富微电	12,500	471,250.00	0.33
66	300604	长川科技	4,600	466,026.00	0.33
67	002311	海大集团	8,394	464,859.72	0.33
68	000933	神火股份	16,800	461,496.00	0.33
69	002074	国轩高科	11,687	457,078.57	0.32
70	000157	中联重科	52,643	454,309.09	0.32
71	000538	云南白药	8,001	454,136.76	0.32
72	002353	杰瑞股份	6,411	454,091.13	0.32
73	300395	菲利华	4,500	451,350.00	0.32
74	000975	山金国际	18,400	447,672.00	0.32
75	300255	常山药业	7,200	447,120.00	0.32
76	002179	中航光电	12,426	440,377.44	0.31
77	002340	格林美	52,003	434,745.08	0.31
78	002001	新和成	16,724	421,277.56	0.30
79	301308	江波龙	1,700	416,228.00	0.30
80	002517	恺英网络	19,000	415,530.00	0.29
81	300339	润和软件	8,200	405,900.00	0.29
82	002851	麦格米特	4,500	405,315.00	0.29
83	300857	协创数据	2,400	404,832.00	0.29
84	002195	岩山科技	56,300	399,167.00	0.28
85	002304	洋河股份	6,483	393,777.42	0.28
86	300223	北京君正	3,700	392,348.00	0.28
87	300442	润泽科技	7,400	390,720.00	0.28
88	002236	大华股份	20,545	389,122.30	0.28
89	002736	国信证券	29,475	386,712.00	0.27
90	300418	昆仑万维	9,200	383,640.00	0.27
91	300207	欣旺达	14,600	381,790.00	0.27
92	002261	拓维信息	11,400	377,340.00	0.27
93	002920	德赛西威	3,100	372,930.00	0.26
94	002595	豪迈科技	4,400	371,844.00	0.26
95	002555	三七互娱	15,700	370,520.00	0.26
96	002422	科伦药业	12,416	364,409.60	0.26
97	002281	光迅科技	5,200	363,740.00	0.26
98	002938	鹏鼎控股	7,100	359,118.00	0.25
99	002812	恩捷股份	6,330	358,531.20	0.25
100	002008	大族激光	8,640	355,881.60	0.25
101	000768	中航西飞	13,920	353,289.60	0.25
102	002131	利欧股份	62,100	350,244.00	0.25

103	002472	双环传动	7,300	346,093.00	0.25
104	002436	兴森科技	16,300	345,071.00	0.24
105	002966	苏州银行	41,520	344,200.80	0.24
106	000831	中国稀土	7,400	343,656.00	0.24
107	002456	欧菲光	31,900	338,778.00	0.24
108	000002	万 科 A	72,298	336,185.70	0.24
109	002493	荣盛石化	28,450	333,149.50	0.24
110	002648	卫星化学	18,700	330,616.00	0.23
111	002252	上海莱士	51,913	329,128.42	0.23
112	002273	水晶光电	13,000	326,560.00	0.23
113	002601	龙佰集团	16,600	325,028.00	0.23
114	000963	华东医药	8,173	322,424.85	0.23
115	300347	泰格医药	5,650	320,355.00	0.23
116	300751	迈为股份	1,544	318,048.56	0.23
117	002465	海格通信	20,030	315,472.50	0.22
118	001979	招商蛇口	36,471	315,109.44	0.22
119	301236	软通动力	6,600	313,038.00	0.22
120	000066	中国长城	21,536	310,333.76	0.22
121	300782	卓胜微	3,778	307,831.44	0.22
122	002185	华天科技	27,977	306,907.69	0.22
123	000661	长春高新	3,290	304,489.50	0.22
124	000878	云南铜业	14,823	304,019.73	0.22
125	000895	双汇发展	11,418	302,234.46	0.21
126	002850	科达利	1,900	299,934.00	0.21
127	300661	圣邦股份	4,332	297,348.48	0.21
128	002128	电投能源	10,600	295,846.00	0.21
129	000021	深科技	11,500	290,720.00	0.21
130	000960	锡业股份	10,425	290,649.00	0.21
131	002130	沃尔核材	11,000	289,520.00	0.21
132	300759	康龙化成	10,150	288,564.50	0.20
133	300454	深信服	2,500	287,900.00	0.20
134	000893	亚钾国际	6,000	287,820.00	0.20
135	002797	第一创业	41,720	286,616.40	0.20
136	301358	湖南裕能	4,400	284,504.00	0.20
137	003816	中国广核	75,200	282,752.00	0.20
138	300054	鼎龙股份	7,500	282,000.00	0.20
139	002271	东方雨虹	20,470	278,187.30	0.20
140	300724	捷佳伟创	2,900	277,240.00	0.20
141	000657	中钨高新	9,900	274,329.00	0.19
142	002080	中材科技	7,500	272,550.00	0.19
143	002129	TCL 中环	31,711	271,763.27	0.19
144	000617	中油资本	28,200	270,720.00	0.19
145	000301	东方盛虹	24,800	270,072.00	0.19

146	300037	新宙邦	5,140	269,336.00	0.19
147	300458	全志科技	6,400	268,992.00	0.19
148	002078	太阳纸业	17,000	267,750.00	0.19
149	300866	安克创新	2,340	267,672.60	0.19
150	000783	长江证券	32,799	267,311.85	0.19
151	002138	顺络电子	7,500	266,475.00	0.19
152	300474	景嘉微	3,700	265,919.00	0.19
153	000786	北新建材	10,538	263,133.86	0.19
154	002157	正邦科技	80,600	261,144.00	0.19
155	300496	中科创达	3,800	256,500.00	0.18
156	002444	巨星科技	7,500	255,150.00	0.18
157	002414	高德红外	17,345	254,451.15	0.18
158	300073	当升科技	4,400	254,320.00	0.18
159	002294	信立泰	5,102	252,804.10	0.18
160	300748	金力永磁	7,372	251,458.92	0.18
161	300251	光线传媒	15,306	250,712.28	0.18
162	300285	国瓷材料	9,000	246,690.00	0.18
163	002223	鱼跃医疗	6,426	245,537.46	0.17
164	000034	神州数码	6,300	245,133.00	0.17
165	300316	晶盛机电	6,600	242,550.00	0.17
166	002624	完美世界	14,600	239,294.00	0.17
167	000728	国元证券	28,648	239,210.80	0.17
168	002155	湖南黄金	11,300	238,317.00	0.17
169	302132	中航成飞	3,000	237,000.00	0.17
170	301269	华大九天	2,200	233,926.00	0.17
171	300024	机器人	12,800	232,832.00	0.17
172	300017	网宿科技	22,700	232,675.00	0.17
173	000423	东阿阿胶	4,700	230,676.00	0.16
174	300122	智飞生物	12,200	230,214.00	0.16
175	002683	广东宏大	4,800	229,440.00	0.16
176	002085	万丰奥威	14,300	228,943.00	0.16
177	300699	光威复材	5,720	225,711.20	0.16
178	000733	振华科技	4,300	225,363.00	0.16
179	002459	晶澳科技	19,424	222,404.80	0.16
180	002409	雅克科技	3,000	222,300.00	0.16
181	000997	新大陆	7,800	220,896.00	0.16
182	300896	爱美客	1,540	218,248.80	0.15
183	002405	四维图新	23,791	214,356.91	0.15
184	002180	纳思达	10,500	212,310.00	0.15
185	000703	恒逸石化	19,710	212,276.70	0.15
186	300373	扬杰科技	3,100	210,800.00	0.15
187	002065	东华软件	22,960	210,084.00	0.15
188	000876	新希望	22,706	209,349.32	0.15

189	002673	西部证券	26,402	208,311.78	0.15
190	300832	新产业	3,700	208,125.00	0.15
191	000932	华菱钢铁	36,980	207,827.60	0.15
192	000683	博源化工	27,900	207,576.00	0.15
193	300919	中伟股份	4,460	206,631.80	0.15
194	002821	凯莱英	2,220	206,304.60	0.15
195	300012	华测检测	15,100	204,605.00	0.15
196	002756	永兴材料	3,770	204,522.50	0.15
197	001965	招商公路	20,100	202,608.00	0.14
198	300003	乐普医疗	12,806	202,462.86	0.14
199	000887	中鼎股份	8,700	201,927.00	0.14
200	002064	华峰化学	18,300	201,300.00	0.14
201	300972	万辰集团	1,000	201,070.00	0.14
202	000596	古井贡酒	1,500	198,900.00	0.14
203	300001	特锐德	7,700	197,736.00	0.14
204	000999	华润三九	6,859	195,207.14	0.14
205	000528	柳工	16,200	192,294.00	0.14
206	002152	广电运通	13,860	191,406.60	0.14
207	300383	光环新网	15,300	191,403.00	0.14
208	002318	久立特材	6,600	191,070.00	0.14
209	000750	国海证券	44,849	190,159.76	0.13
210	300142	沃森生物	17,400	189,834.00	0.13
211	000623	吉林敖东	9,661	188,679.33	0.13
212	002203	海亮股份	14,800	187,368.00	0.13
213	002410	广联达	14,894	187,366.52	0.13
214	002739	万达电影	16,500	186,780.00	0.13
215	300628	亿联网络	5,060	180,389.00	0.13
216	000400	许继电气	7,000	179,970.00	0.13
217	000830	鲁西化工	10,800	178,956.00	0.13
218	000009	中国宝安	17,832	175,645.20	0.12
219	002056	横店东磁	9,000	175,500.00	0.12
220	300999	金龙鱼	6,100	175,314.00	0.12
221	000983	山西焦煤	27,101	173,988.42	0.12
222	002429	兆驰股份	23,200	172,144.00	0.12
223	300763	锦浪科技	2,400	171,384.00	0.12
224	002044	美年健康	32,128	169,635.84	0.12
225	001696	宗申动力	7,800	169,182.00	0.12
226	000519	中兵红箭	9,100	165,711.00	0.12
227	002007	华兰生物	10,877	164,569.01	0.12
228	300487	蓝晓科技	2,650	163,637.50	0.12
229	300413	芒果超媒	6,660	162,637.20	0.12
230	002841	视源股份	4,100	162,483.00	0.12
231	000738	航发控制	7,448	158,716.88	0.11

232	002025	航天电器	3,000	150,390.00	0.11
233	000708	中信特钢	9,100	148,967.00	0.11
234	000155	川能动力	12,500	145,625.00	0.10
235	002926	华西证券	15,600	144,768.00	0.10
236	000729	燕京啤酒	12,876	144,597.48	0.10
237	000723	美锦能源	30,700	144,290.00	0.10
238	300765	新诺威	4,000	144,280.00	0.10
239	002939	长城证券	14,100	143,820.00	0.10
240	002653	海思科	2,800	143,696.00	0.10
241	000629	钒钛股份	46,300	143,530.00	0.10
242	002603	以岭药业	8,380	143,046.60	0.10
243	300144	宋城演艺	17,276	141,490.44	0.10
244	000050	深天马 A	15,503	139,992.09	0.10
245	002262	恩华药业	5,800	139,954.00	0.10
246	002430	杭氧股份	4,500	134,415.00	0.10
247	000513	丽珠集团	3,843	132,429.78	0.09
248	300676	华大基因	2,900	131,544.00	0.09
249	002984	森麒麟	6,200	131,254.00	0.09
250	300146	汤臣倍健	10,588	127,161.88	0.09
251	002312	川发龙蟒	11,600	126,788.00	0.09
252	300558	贝达药业	2,700	126,063.00	0.09
253	002500	山西证券	20,984	125,694.16	0.09
254	002568	百润股份	5,624	122,659.44	0.09
255	003031	中瓷电子	1,640	119,982.40	0.09
256	000032	深桑达 A	6,200	119,970.00	0.09
257	002244	滨江集团	11,800	118,590.00	0.08
258	000987	越秀资本	14,243	115,938.02	0.08
259	002831	裕同科技	4,060	115,750.60	0.08
260	301536	星宸科技	1,900	113,829.00	0.08
261	000825	太钢不锈	23,265	113,765.85	0.08
262	002266	浙富控股	27,000	112,320.00	0.08
262	002423	中粮资本	9,600	112,320.00	0.08
264	000958	电投产融	16,900	109,343.00	0.08
265	002299	圣农发展	6,499	107,493.46	0.08
266	002773	康弘药业	3,500	104,895.00	0.07
267	002439	启明星辰	7,420	104,770.40	0.07
268	000921	海信家电	4,200	104,202.00	0.07
269	000598	兴蓉环境	14,200	101,814.00	0.07
270	002670	国盛证券	6,000	101,040.00	0.07
271	300979	华利集团	2,000	100,420.00	0.07
272	000069	华侨城 A	38,681	95,928.88	0.07
273	301165	锐捷网络	1,060	94,128.00	0.07
274	000709	河钢股份	40,700	94,017.00	0.07

275	002120	韵达股份	13,866	93,456.84	0.07
276	002153	石基信息	8,610	93,246.30	0.07
277	000027	深圳能源	13,363	87,126.76	0.06
278	000883	湖北能源	18,543	84,185.22	0.06
279	301200	大族数控	700	83,139.00	0.06
280	000800	一汽解放	12,000	81,360.00	0.06
281	000877	天山股份	15,000	79,800.00	0.06
282	300957	贝泰妮	2,000	79,220.00	0.06
283	003022	联泓新科	3,900	77,259.00	0.05
284	300888	稳健医疗	1,900	71,896.00	0.05
285	000959	首钢股份	14,600	71,540.00	0.05
286	001286	陕西能源	7,600	70,756.00	0.05
287	301301	川宁生物	6,900	69,966.00	0.05
288	002265	建设工业	2,500	67,050.00	0.05
289	002032	苏泊尔	1,500	66,120.00	0.05
290	301498	乖宝宠物	1,000	65,150.00	0.05
291	000785	居然智家	21,400	62,488.00	0.04
292	002608	江苏国信	7,900	58,381.00	0.04
293	000937	冀中能源	10,800	58,104.00	0.04
294	000898	鞍钢股份	22,963	58,096.39	0.04
295	001391	国货航	9,600	56,832.00	0.04
296	002945	华林证券	3,000	45,990.00	0.03
297	001872	招商港口	2,300	44,459.00	0.03
298	000539	粤电力A	9,100	40,222.00	0.03
299	002461	珠江啤酒	4,000	37,160.00	0.03
300	001289	龙源电力	1,500	22,560.00	0.02

### 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	300255	常山药业	512,584.00	0.37
2	002195	岩山科技	396,924.00	0.28
3	002261	拓维信息	364,294.00	0.26
4	300857	协创数据	357,883.00	0.26
5	002131	利欧股份	325,769.00	0.23

6	002130	沃尔核材	313,044.00	0.22
7	300458	全志科技	300,236.10	0.22
8	002085	万丰奥威	279,479.00	0.20
9	300017	网宿科技	278,197.00	0.20
10	000034	神州数码	276,955.00	0.20
11	002851	麦格米特	269,174.00	0.19
12	300115	长盈精密	259,295.00	0.19
13	300024	机器人	256,593.00	0.18
14	000657	中钨高新	249,798.00	0.18
15	002155	湖南黄金	246,455.00	0.18
16	301308	江波龙	228,902.00	0.16
17	000997	新大陆	212,199.00	0.15
18	001696	宗申动力	206,754.00	0.15
19	000596	古井贡酒	183,813.00	0.13
20	301536	星辰科技	180,850.00	0.13

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	300750	宁德时代	555,638.00	0.40
2	300390	天华新能	332,412.00	0.24
3	002371	北方华创	236,487.00	0.17
4	300308	中际旭创	235,125.00	0.17
5	000333	美的集团	208,533.00	0.15
6	000792	盐湖股份	197,610.00	0.14
7	000858	五粮液	186,852.00	0.13
8	300567	精测电子	186,162.00	0.13
9	002487	大金重工	161,898.00	0.12
10	002407	多氟多	160,367.00	0.12
11	002385	大北农	156,436.52	0.11
12	000799	酒鬼酒	151,383.00	0.11
13	002145	钛能化学	147,144.80	0.11
14	000818	航锦科技	147,088.00	0.11
15	300573	兴齐眼药	143,368.00	0.10
16	002594	比亚迪	140,364.00	0.10
17	000591	太阳能	136,990.00	0.10
18	000998	隆平高科	129,720.48	0.09
19	002507	涪陵榨菜	127,927.80	0.09
20	000739	普洛药业	117,116.00	0.08

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	15,360,431.10
卖出股票收入（成交）总额	11,391,406.48

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

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

#### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	690.73
2	应收清算款	-
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	690.73

### 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		中国工商银行股份有限公司-汇添富深证300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 (%)
2,357	32,222.74	55,805,619.00	73.48	20,143,372.00	26.52	50,185,842.00	66.08

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富深证 300 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	中信证券股份有限公司	2,111,568.00	2.78
2	广发证券股份有限公司	1,507,696.00	1.99
3	包鹰	789,000.00	1.04
4	北京无限立通通讯技术有限责任公司	708,499.00	0.93
5	张俊锋	701,900.00	0.92
6	杨宇帮	469,500.00	0.62
7	上海雁丰投资管理有限公司-雁丰稳进天泽9号私募基金	461,200.00	0.61
8	李莉	391,900.00	0.52
9	BARCLAYS BANK PLC	281,503.00	0.37
10	林侃	280,000.00	0.37
11	中国工商银行股份有限公司-汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	50,185,842.00	66.08

## 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基金情况

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（2011 年 09 月 16 日） 基金份额总额	521,548,991.00
本报告期期初基金份额总额	98,448,991.00
本报告期基金总申购份额	42,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	65,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	75,948,991.00

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。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2011 年 09 月 16 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 27,000.00 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

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	6	16,342,810.38	61.09	2,874.39	61.09	
兴业证券	3	10,200,524.20	38.13	1,794.33	38.13	
平安证券	3	161,481.00	0.60	28.37	0.60	
中信证券	4	47,022.00	0.18	8.26	0.18	
财通证券	2	-	-	-	-	
长城证券	2	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东吴证券	1	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国海证券	2	-	-	-	-	
国联民生	2	-	-	-	-	
国泰海	6	-	-	-	-	

通						
国信证 券	2	-	-	-	-	
恒泰证 券	2	-	-	-	-	
华安证 券	1	-	-	-	-	
华泰证 券	2	-	-	-	-	
摩根大 通证券	2	-	-	-	-	
瑞银证 券	2	-	-	-	-	
申万宏 源证券	3	-	-	-	-	
信达证 券	1	-	-	-	-	
银河证 券	1	-	-	-	-	
中金财 富	2	-	-	-	-	
中金公 司	2	-	-	-	-	
中泰证 券	1	-	-	-	-	
中信建 投证券	1	-	-	-	-	

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 (%)
东方 证券	98,841.46	85.04	-	-	-	-	-	-
兴业	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
平安 证券	17,381.69	14.96	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 民生	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根 大通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 7 家证券公司的 15 个交易单元:国泰海通(深交所单元,上交所单元)、平安证券(深交所单元)、申万宏源证券(深交所单元,上交所单元)、兴业证券(深交所单元,上交所单元)、中金财富(深交所单元,上交所单元)、中信建投证券(深交所单元,上交所单元)、中信证券(深交所单元,上交所单元);不再租用 2 家证券公司的 4 个交易单元:太平洋证券(深交所单元,上交所单元)、中信建投证券(深交所单元,上交所单元)。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东北证券为申购赎回代理券商的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 07 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关于旗下部分基金增加国盛证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 12 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券为申购赎回代理券商的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 13 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新法律文件	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所	2025 年 03 月 20 日
6	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数许可使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 20 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新产品资料概要	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年年报	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 31 日
10	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
11	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
12	汇添富基金管理股份有限公司关	公司网站, 中国证监	2025 年 04 月 30 日

	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	会基金电子披露网站, 上证报, 上交所, 深交所	
13	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2025 年 05 月 17 日
14	深证 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2025 年 5 月 21 日更新)	深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 05 月 21 日
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	关于汇添富基金管理股份有限公司住所变更的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025 年 07 月 29 日
21	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
22	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
23	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
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,	2025 年 09 月 19 日

		深交所, 上交所	
25	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 09 月 19 日
26	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国联民生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 10 月 27 日
27	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 10 月 27 日
28	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
29	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
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分深交所基金变更场内简称的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上证报	2025 年 12 月 29 日
31	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		到或者超过20%的时间区间					
中国工商银行股份有限公司 - 汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金	1	2025年1月1日至2025年12月31日	52,707,942.00	16,181,900.00	18,704,000.00	50,185,842.00	66.08

金 联 接 基 金							
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

## 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、中国证监会批准深证 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《深证 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《深证 300 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、报告期内深证 300 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