## 汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数 证券投资基金 2025 年第 3 季度报告

2025年09月30日

基金管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人:中信建投证券股份有限公司

送出日期: 2025年10月28日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## §2基金产品概况

## 2.1 基金基本情况

基金简称 汇添富中证全指证券公司 ETF			
场内简称	证券指数		
基金主代码	560090		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2023年02月27日		
报告期末基金份额总额(份)	2, 529, 365, 000. 00		
   投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪		
投页日外 	误差的最小化。		
	本基金主要采用完全复制法,即完全按照标		
	的指数的成份股组成及其权重构建基金股票		
	投资组合,并根据标的指数成份股及其权重		
	的变化进行相应调整。但在因特殊情况(如		
投资策略	流动性不足等)导致本基金无法有效复制和		
	跟踪标的指数时,基金管理人将运用其他合		
	理的投资方法构建本基金的实际投资组合,		
	追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金力		
	争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%, 年		

	跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则
	调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟
	踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合
	理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一
	步扩大。本基金的投资策略主要包括:资产
	配置策略、债券投资策略、资产支持证券投
	资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资
	投资策略、参与转融通证券出借业务策略、
	存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率
	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收
	益高于混合型基金、债券型基金与货币市场
风险收益特征	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。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司

注: 扩位证券简称: 证券 ETF 龙头。

## §3主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2025年07月01日 - 2025年09月30日)
1. 本期已实现收益	110, 467, 820. 02
2. 本期利润	275, 806, 189. 59
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1302
4. 期末基金资产净值	3, 428, 853, 430. 44
5. 期末基金份额净值	1.3556

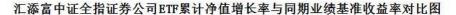
- 注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平 要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差	1)-3	2-4
过去三 个月	11.37%	1. 53%	10.83%	1.53%	0. 54%	0.00%
过去六 个月	16. 29%	1.68%	15. 57%	1.69%	0.72%	-0.01%
过去一年	11.70%	1. 99%	10.95%	2. 00%	0.75%	-0.01%
自基金 合同生 效起至 今	35. 56%	1.75%	31. 07%	1.77%	4. 49%	-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





注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2023年02月27日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

## § 4 管理人报告

## 4.1基金经理(或基金经理小组)简介

44 <i>t</i> 7	1111 夕	任本基金的基	金经理期限	证券从业年限	说明
姓名	职务	任职日期	离任日期	(年)	<b>近</b>
董瑾	本基金的基金经理	2023年02月27日		16	国历方从投格 2013 国限助 12 9 金公 20 万限部理月金公 12 日全数投籍: 经业资。2012 泰公理月管司5 高有望。加管司月9 任理产年年基司金公12 日全数投中京学格金业 8 12 管品 12 月管司6 16 家公基。加管司月9 任指券)助月年汇证发基中京学格金业 8 12 管品 12 12 12 13 14 14 14 15 16 16 17 16 17 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18 18

		(LOF) 的基金
		经理助理。2017
		年 12 月 18 日至
		2019年12月31
		日任中证上海国
		企交易型开放式
		指数证券投资基
		金联接基金的基
		金经理助理。
		2019年12月4
		日至今任汇添富
		沪深 300 交易型
		开放式指数证券
		投资基金的基金
		经理。2019年
		12月31日至今
		任汇添富沪深
		300 指数型发起
		式证券投资基金
		(LOF) 的基金
		经理。2019年
		12月31日至
		2023年5月8
		日任汇添富中证
		全指证券公司指
		数型发起式证券
		投资基金
		(LOF) 的基金
		经理。2019年
		12月31日至
		2023年8月29
		日任中证上海国
		企交易型开放式
		指数证券投资基
		金联接基金的基
		金经理。2020
		年3月5日至
		2023年8月29
		日任汇添富中证
		国企一带一路交
		易型开放式指数
		证券投资基金联
		接基金的基金经
		理。2021年2
		月1日至今任汇
		添富中证沪港深

		500 交易型开放
		式指数证券投资
		基金的基金经
		理。2021年8
		月9日至今任汇
		添富中证光伏产
		业交易型开放式
		指数证券投资基
		金的基金经理。
		2021年8月11
		日至 2022 年 5
		·
		月23日任汇添
		富中证电池主题
		指数型发起式证
		券投资基金的基
		金经理。2022
		年1月26日至
		2022年10月11
		日任汇添富中证
		沪港深 500 交易
		型开放式指数证
		券投资基金联接
		基金的基金经
		理。2022年3
		月3日至今任汇
		添富中证电池主
		题交易型开放式
		指数证券投资基
		金的基金经理。
		2022年4月28
		日至今任汇添富
		中证全指医疗器
		械交易型开放式
		指数证券投资基
		金的基金经理。
		2022年5月23
		日至今任汇添富
		中证电池主题交
		易型开放式指数
		证券投资基金发
		起式联接基金的
		基金经理。2022
		年6月13日至
		今任汇添富中证
		国企一带一路交
		易型开放式指数

证券投资基金2022年7月13日至2023年11月28日任汇添。经理11月28日任汇添。碳中和11月28日任汇添。碳中和交易证券投资或量量。2022年12月29日至全指发形成基金的基金经理。2022年12月29日至全指医疗放改基金分型类验量。2023年1月29日平途会易型外投资基金的基金1月16日至全局工产的基础。2023年2月27日产品。富中证如主发验型,2023年2月27日产品。2023年2月27日产品。2023年2月27日产品。2023年4月正成式参数。基金经理日日。2025年4月正成式参数。基金经理日日。2025年4月11日至2025年4月11日至2025年4月11日至2025年4月11日至2023年4月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年6月11日产品。2023年2024年2024年2024年2024年2024年2024年2024年			 
年7月13日至 2023年11月28 日任汇添高中证 上海环交所献式 指数证券投资基 金的基金20月29 10至今任汇添高 中证全指坚疗器 械交易型投资基金的基金全理。 2022年12月29 日至今任汇添高 中证金为型投资基金的基金全理。 2023年1月16 日至今任汇和歷交易 型开放式者的基金会易 型开放式者的基金会易 型开放式者的基金会易 型开放式者的。基金经理。 2023年2月27日中证全指证开放式者数证券投资基金的基金经理。 2023年2月27日中证全指证者数型证券投资基金的基金经理。 2023年4月6日流流者数量。 2023年4月13日至 2025年3月21日任汇、运营中证 环境治费基金(1007)的基金全理。 2023年4月13日至 2024年6月11日任			证券投资基金的
2023 年11 月 28 目住汇添溶所碳中和变质碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年12 月 29 日至今年12 万字。富中证全指医疗型形效基金的基金经理。2023 年 1 月 16 日至 年 2 月 27 居 2 日至 今 4 日 1 日 2 日至 今 4 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日 1 日			基金经理。2022
日任汇添富中证上海环交所做中和交易型投资基金的基金经型。2022 年 12 月 29 日至全分任汇签序器、被交易类型开放资基金发起式。经数基金发起式。经数基金发起式。全数基金发起或。2023 年 1 月 16 日至今什正添富。中证如上租货。全分上,还是有一个在一个人,是一个人们,我们就是一个人们就是一个人们,我们就是一个人们,我们就是一个人们就是一个人们,我们就是一个人们,我们就是一个人们就是一个人们就是一个人们就是一个人们就是一个人们就是一个人们就是一个人们的一个人们就是一个人们就是一个人们就是一个人们就是一个人们就是一个人们就是一个人们就是一个人们就是一个人们们,我们就是一个人们的,我们就是一个一个人们就是一个一个人们就是一个人们们,我们就是一个人们们,我们就是一个人们们,我们们就是一个人们们,我们们们们是一个人们们们们们们,我们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们们			年7月13日至
上海牙酸中和交别开放式指数能基金经理。2022年12月29日至全任汇示容器中证实易显为经数。2023年12月28日至全指医疗放式指数发起基金的基金全列,16日至实力,16日至实力,16日至实力,16日至实力,16日至实力,16日至,16日至,16日至,16日至,16日至,16日至,16日至,16日至			2023年11月28
和交易型升效式 指数证金经理。 2022 年 12 月 29 日至今任汇标常 械交多型升放式 指数是正式经基 金的基金经理。 2023 年 1 月 16 日至证金为型升放资基金的基本企会 国产开放资本企业。 2023 年 1 月 16 日至证细业主指数的基金经理。 2023 年 2 月 27 日至 今任汇证券公式指数。 证券经理,2023 年 2 月 27 自中证 全指进开放资基金公司, 2023年 4 月 6 品源有数证 券投资理。2023年 4 月 13 日日至 2025年 3 月 21 日任定治投资基金 (LOF)的基金经理。2023年 4 月 13 日至 2025年 3 月 21 日任定治投资基金 (LOF)的基金经理。2023年 4 月 13 日至 2024年 6 月 11 日任 汇添海指数型证券投资基金 (LOF)的基金经理。2023年 4 月 13 日至 2024年 6 月 11 日任 汇添高股总投资指			日任汇添富中证
和交易型升效式 指数证金经理。 2022 年 12 月 29 日至今任汇标常 械交多型升放式 指数是正式经基 金的基金经理。 2023 年 1 月 16 日至证金为型升放资基金的基本企会 国产开放资本企业。 2023 年 1 月 16 日至证细业主指数的基金经理。 2023 年 2 月 27 日至 今任汇证券公式指数。 证券经理,2023 年 2 月 27 自中证 全指进开放资基金公司, 2023年 4 月 6 品源有数证 券投资理。2023年 4 月 13 日日至 2025年 3 月 21 日任定治投资基金 (LOF)的基金经理。2023年 4 月 13 日至 2025年 3 月 21 日任定治投资基金 (LOF)的基金经理。2023年 4 月 13 日至 2024年 6 月 11 日任 汇添海指数型证券投资基金 (LOF)的基金经理。2023年 4 月 13 日至 2024年 6 月 11 日任 汇添高股总投资指			上海环交所碳中
指数证券投资基金经理。 2022年12月29日至全任汇海宫。中证全指医疗器被交易型开放基金发型进步数。 2023年1月16日至全组工业主题数据表验理。 2023年1月16日至全组工业主题数据表验经理。 2023年2月27日至今任汇添货投资基金的基金经理。 2023年2月27日至今任汇证数据数证券投资理。 2023年4月6日至今任中证武式参投资基金的基金经理。 2023年4月13日至2025年3月21日任汇建指数型证券投资基金。(LOF)的基金经理。 2023年4月13日至2024年6月11日任汇添高股息投资指			
金的基金经理。 2022年12月29日至今任汇降富 中证全指医疗器 被交易型开放或基金发起式联接基金的基金经理。 2023年1月16日至证细个角趣交易 型开放或基金经理。 2023年2月27日中证 全指证券放理。 2023年2月27日中证 全指证券投资理。2023年2月27日中证 全相证券改选理。2023年4月6日源分数。证券投资基金的 基金经理。2023年4月6日源省数证券投资基金的 基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添据指数, 市场治疗。有量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量量			
2022年12月29日至今任汇添富中证金指医疗器式指数证券投资基金发起式指数证券投资基金金的基金经过。2023年1月16日至细分主题交易型开放式基金发起或数证券投资基金的基金经理。2023年2月27日至今任汇证券改查理。2023年2月27日至今任汇证款或数证券投资理。2023年4月6日源交易型开放资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2025年4月13日至2025年4月13日至2025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			
日至今任汇添富中证会指更疗效式指数型开放式指数证式较基金份基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金经理。2023年1月16日至今任任汇令金属产业主档数的基金经理。2023年2月27日至今任汇派券公交理。2023年4月27届全人工作的基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添销数型证券投资基金的(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添销数型证券投资基金(LLOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富股息投资指			
中证全指医疗器 械交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联接基 金的基金经理。 2023年1月16 日至今任汇添富 中证细介色金 属产业主题数证 券投资基金023年2月27日至 今任汇添富司司交 易型开放式指数 证券投资基金023年4月6日至今 任中证能源数显 券投资基金023年4月13日至 2025年3月21日任汇添富中证 环境治理指数型 证券投资基金 (LOF)的基金经 理。2023年4月13日至 2025年3月21日任汇添富中证 环境治理指数型 证券投资基金			
械交易型开放式 指数证券投资基 金发起式联基 金的基金经理。 2023 年 1 月 16 日至今任介高富 中证知主题交易 型开放式指数证券投资基金的基 金经理。2023 年 2 月 27 日至 今任汇添公司者数 证券投资基金的 基金经理。2023 年 4 月 6 日至今 任中证能源交易 型开放式指数证 券投资基。2023 年 4 月 73 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富数型 证券投资基金 (LOF)的基金经 理。2023 年 4 月 13 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富数型 证券投资基金 (LOF)的基金经 理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任 汇添富中证港股 通高股息投资指			
指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色交易属产业主题为数证券投资基金的基金经理。2023年2月27日至今任汇添富中证全指证券公者指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日安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2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金经理。2023年4月13日至2025年6月11日任汇添富自业进			
金发起式联接基金的基金经理。 2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题数型开放式基数证券投资基金企2023年2月27日至今任汇添富中证全指证券公费理。2023年4月6日至今任中证就式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至分任中证就式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金全理。2023年4月11日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(10F)的基础,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			
金的基金经理。 2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年2月27日至今任汇添富公司指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证允前数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富由证环境治资基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富数型证券投资基金经理。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			
2023年1月16日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年2月27日至今任汇添富中证全指证所放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富中证环境治理选金((LOF)的基金经理。2023年4月13日至2023年4月13日至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			
日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年2月27日至今任汇添为公指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2023年4月13日至2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富申证港股通高股息投资指			
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2月27日至今任汇添自司司查查的基金经理。2023年4月6日至今任中证就指数的基金经理。2023年4月6日至今任中证就指数的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富的股息投资指			
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2月27日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2023年4月13日至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			, ,, , , , , , , , , , , , , , , , ,
型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年2月27日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2023年4月13日至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			
券投资基金的基金经理。2023年2月27日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富申证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富中证港股通高股息投资指			
金经理。2023年2月27日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富申证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富中证港股通高股息投资指			
年2月27日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富中证港股通高股息投资指			
今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金((LOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富中证港股通高股息投资指			
全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富中证港股通高股息投资指			
易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2023 年4月6日至今 任中证能源交易 型开放式指数证 券投资基金的基 金经理。2023 年4月13日至 2025年3月21 日任汇添富中证 环境治理指数型 证券投资基金 (LOF)的基金经 理。2023年4 月13日至2024年6月11日任 汇添富中证港股 通高股息投资指			
证券投资基金的基金经理。2023年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富中证港股通高股息投资指			
基金经理。2023 年4月6日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年4月13日至2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富中证港股通高股息投资指			
年4月6日至今任中证能源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2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富中证港股通高股息投资指			
任中证能源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2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富中证港股通高股息投资指			
型开放式指数证 券投资基金的基 金经理。2023 年 4 月 13 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证 环境治理指数型 证券投资基金 (LOF) 的基金经 理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任 汇添富中证港股 通高股息投资指			
券投资基金的基金经理。2023年4月13日至2025年3月21日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年4月13日至2024年6月11日任汇添富中证港股通高股息投资指			
金经理。2023 年4月13日至 2025年3月21 日任汇添富中证 环境治理指数型 证券投资基金 (LOF)的基金经 理。2023年4 月13日至2024 年6月11日任 汇添富中证港股 通高股息投资指			
年 4 月 13 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证 环境治理指数型 证券投资基金 (LOF) 的基金经 理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任 汇添富中证港股 通高股息投资指			
2025 年 3 月 21 日任汇添富中证 环境治理指数型 证券投资基金 (LOF) 的基金经 理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任 汇添富中证港股 通高股息投资指			
日任汇添富中证 环境治理指数型 证券投资基金 (LOF)的基金经 理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任 汇添富中证港股 通高股息投资指			
环境治理指数型 证券投资基金 (LOF) 的基金经 理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任 汇添富中证港股 通高股息投资指			
证券投资基金 (LOF) 的基金经 理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任 汇添富中证港股 通高股息投资指			
(LOF) 的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2024年 6 月 11 日任 汇添富中证港股通高股息投资指			
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			
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			
年6月11日任     汇添富中证港股     通高股息投资指			•
汇添富中证港股 通高股息投资指			
通高股息投资指			
			汇添富中证港股
数发起式证券投			通高股息投资指
			数发起式证券投

		资基金 (LOF)
		的基金经理。
		2023年5月9
		日至今任汇添富
		中证全指证券公
		司交易型开放式
		指数证券投资基
		金联接基金
		(LOF) 的基金
		经理。2023年8
		月 23 日至 2024
		年10月26日任
		汇添富中证沪港
		深消费龙头指数
		型发起式证券投
		资基金的基金经
		理。2023年9
		月 13 日至 2025
		年 3 月 21 日任
		汇添富中证
		2000 交易型开
		放式指数证券投
		资基金的基金经
		理。2024年4
		月 24 日至 2025
		年8月18日任
		汇添富中证港股
		通高股息投资交
		易型开放式指数
		证券投资基金的
		基金经理。2024
		年6月12日至
		2025年8月18
		日任汇添富中证
		港股通高股息投
		/ 3 / 3 / 2 3 .
		资交易型开放式
		指数证券投资基
		金联接基金
		(LOF) 的基金
		经理。2025年3
		月 21 日至今任
		汇添富中证细分
		有色金属产业主
		题交易型开放式
		指数证券投资基
		金发起式联接基

		金的基金经理。
		2025年5月22
		日至今任汇添富
		中证港股通汽车
		产业主题交易型
		开放式指数证券
		投资基金的基金
		经理。2025年7
		月2日至今任汇
		添富沪深 300 交
		易型开放式指数
		证券投资基金发
		起式联接基金的
		基金经理。

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

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

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

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

### 4.3 公平交易专项说明

## 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

- 一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程,公平交易管控覆盖公司所有业 务类型、投资策略、投资品种,以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理 活动相关的各个环节。
- 二、本着"时间优先、价格优先"的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用 交易系统中的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。
- 三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的次数为 0。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

#### 4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

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

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

证券板块在一定程度上反映市场整体的风险偏好及流动性等情况。同时,在强监管防风险推动资本市场高质量发展的背景下,证券行业或将迎来中长期的发展机会。

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

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为11.37%。同期业绩比较基准收益率为10.83%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3, 411, 043, 870. 80	98. 84
	其中: 股票	3, 411, 043, 870. 80	98. 84
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	39, 726, 235. 52	1. 15
8	其他资产	415, 613. 66	0.01
9	合计	3, 451, 185, 719. 98	100.00

注:此处股票投资项含可退替代款估值增值,而"报告期末按行业分类的股票投资组合"章节的合计项不含可退替代款估值增值,最终导致两者在金额上不相等。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	_	_
В	采矿业	_	_
С	制造业	_	_
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	_	_
Е	建筑业	_	_
F	批发和零售业	_	_
G	交通运输、仓储和邮政业	_	_
Н	住宿和餐饮业	_	_
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	_	_
т	人可以	3, 411, 044, 326. 8	00.40
J	J 金融业	0	99. 48
K	房地产业	_	-
L	租赁和商务服务业	_	_
M	科学研究和技术服务业	_	-
N	水利、环境和公共设施管理业	_	_
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	_	_
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	_	_
	AL	3, 411, 044, 326. 8	00.40
	合计	0	99. 48

## 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

## 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 5.3.1报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股 票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300059	东方财富	20, 183, 178	547, 367, 787. 36	15. 96
2	600030	中信证券	15, 573, 661	465, 652, 463. 90	13. 58
3	601211	国泰海通	18, 034, 625	340, 313, 373. 75	9. 92
4	601688	华泰证券	8, 131, 192	177, 016, 049. 84	5. 16
5	000776	广发证券	4, 715, 580	105, 063, 122. 40	3.06
6	600999	招商证券	5, 921, 628	101, 319, 055. 08	2.95
7	600958	东方证 券	8, 343, 170	95, 445, 864. 80	2.78
8	000166	申万宏源	14, 389, 300	76, 694, 969. 00	2.24
9	601377	兴业证 券	11, 026, 067	72, 110, 478. 18	2.10
10	601995	中金公司	1, 864, 205	68, 770, 522. 45	2.01

## 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

- 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 注:本基金本报告期末未持有债券。
- 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

- 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细注:本基金本报告期末未持有权证投资。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

#### 5. 11. 1

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

#### 5, 11, 2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

J	亨号	名称	金额(元)
	1	存出保证金	415, 613. 66
	2	应收证券清算款	_

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	415, 613. 66

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

- 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
- 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## §6开放式基金份额变动

单位: 份

本报告期期初基金份额总额	2, 028, 865, 000. 00
本报告期基金总申购份额	1, 190, 000, 000, 00
减:本报告期基金总赎回份额	689, 500, 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	2, 529, 365, 000. 00

注: 总申购份额含红利再投、转换入份额, 总赎回份额含转换出份额。

## §7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注: 本基金的基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

## §8影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

			报告期内持有	报告期末持有基金情况			
投资类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份 占 ( % )
中信 建 近 券 股 有限	1	202 5 年 7 月	950, 934, 000. 00	81, 746, 800. 00	131, 821, 400. 00	900, 859, 400.	35. 6 2

公司		1			
一汇		日			
添富		至			
中证	:	202			
全指		5			
证券	:	年			
公司	!	9			
交易		月			
型开		30			
放式		日			
指数					
证券					
投资					
基金					
联接					
基金					
(LOF					
)				 	

#### 产品特有风险

#### 1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时,少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高,其在召开 持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

#### 2、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。

## 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
  - 2、《汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
  - 3、《汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
  - 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全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告;
  - 6、中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

#### 9.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司 2025年10月28日