汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资 基金 2025 年第 1 季度报告

2025年03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:中国建设银行股份有限公司

送出日期: 2025年04月22日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2025年4月18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 01 月 01 日起至 2025 年 03 月 31 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 500 基本面增强指数
基金主代 码	012498
基金运作 方式	契约型开放式
基金合同 生效日	2021年09月16日
报告期末	
基金份额	89, 074, 197. 32
总额(份)	
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上,通过基本面选股方法进行积极的组合管理和风险控制,力求实现超越标的指数的业绩表现。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数,立足于深入的基本面分析,精选高质量证券组合,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年跟踪误差不超过 7.75%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主。在本基金的投资过程中,将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离,以期在

	长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。 本基金运作过程中,当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则,履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 本基金的投资策略还包括:资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、国债期货投资策略。				
业绩比较 基准	中证 500 指数收益率*95%+活期存款利率(税后)*5%				
风险收益 特征	本基金为股票型指数增强基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。				
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司				
基金托管人	中国建设银行股份有限公司				
下属分级 基金的基 金简称	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C			
下属分级 基金的交 易代码	012498	012499			
报告期末 下属分级 基金的份 额总额 (份)	65, 771, 689. 88	23, 302, 507. 44			

§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01月01日 - 2025年03月31日)			
	汇添富中证 500 基本面增强指数	汇添富中证 500 基本面增强指数		
	A	С		
1. 本期已实现收益	130, 307. 58	16, 893. 71		
2. 本期利润	1, 269, 725. 01	321, 052. 94		
3. 加权平均基金份额	0.0179	0, 0136		
本期利润	0.0179	0.0130		
4. 期末基金资产净值	52, 592, 160. 77	18, 113, 997. 26		
5. 期末基金份额净值	0.7996	0. 7773		

注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收

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

3.2基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

	汇添富中证 500 基本面增强指数 A					
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	1)-(3)	2-4
过去三 个月	2. 04%	1.07%	2. 21%	1.14%	-0.17%	-0.07%
过去六 个月	-1.94%	1.49%	1.98%	1.59%	-3. 92%	-0.10%
过去一	3. 58%	1.43%	10. 43%	1.57%	-6. 85%	-0.14%
过去三	-10. 46%	1.26%	-6. 68%	1.31%	-3. 78%	-0.05%
自基金 合同生 效起至 今	-20. 04%	1. 23%	-21.50%	1. 29%	1. 46%	-0.06%
		汇添富品	中证 500 基本面	增强指数C		
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	1.83%	1.07%	2. 21%	1.14%	-0.38%	-0.07%
过去六 个月	-2. 32%	1.49%	1. 98%	1.59%	-4. 30%	-0.10%
过去一年	2. 75%	1.43%	10. 43%	1.57%	-7. 68%	-0.14%
过去三	-12. 57%	1.26%	-6. 68%	1.31%	-5. 89%	-0.05%
自基金 合同生 效起至 今	-22. 27%	1. 23%	-21.50%	1. 29%	-0. 77%	-0.06%

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500基本面增强指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图





汇添富中证500基本面增强指数C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

注:本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2021年09月16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

₩ <i>\</i>	1117 夕	任本基金的基	金经理期限	证券从业年限	28 BB
姓名	职务	任职日期	离任日期	(年)	说明
顾耀强	本基金的基 金经理,增 强收益部总 监	2021年09月 16日	_	21	国学学士格基格历永司通有业等等、"金。"磁技证限分中清学业券业业任团员股司师国华硕资投资经杭公、份行、国华研资资资经、价行、场行。

海展公司前、基。2009年2月2日, 2009年2月2日, 2009年2日, 2009年2日, 2009年2日, 2009年2日, 2009年2日, 2009年2日, 2009年2日, 2012年2日, 2012年2日, 2012年2日, 2012年2020年, 2012年2020年, 2012年2020年, 2014年2日, 2014年2日, 2014年2日, 2014年2日, 2014年2日, 2014年2日, 2016年2日, 2016年2日, 2016年2日, 2016年2日, 2017年至2017年至2017年至2017年至2017年至2017年至2017年至2017年至2017年至2017年至2017年至2017年至2017年2017年2017年2017年2017年2017年2017年2017年			
级分析则现。是2009年3 富建设 2009年3 富建设 2009年3 富建设 7年 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2			海基金管理
级分析则现。是2009年3 富建设 2009年3 富建设 2009年3 富建设 7年 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2			有限公司高
金经理功。 2009年高月加 入汇管理份 有限品级行业 分析理助强,现 任总监,2009年12月22日至今今任江港 高第金型。 2012年3月9日至2020年9月3日和近天 大校会经理。 2012年3月9日至2020年9月3日和近天 海衛型正券 投资金经理。 2014年4月8日日在汇 海高台型证券 投资经验金的。 基础任年2日至2016年8月24日面增型 长规资经经验。 的基金年7月27日至2019年1月8日 在汇深新型。 2016年7月27日至2019年1月高阶。 港家经理。 2016年3月27日至2019年1月高阶。 港家新型。 2016年3月27日至2019年1月高阶。 港家新型。 是第二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十			
2009年3月加入汽海電整金管理股份有限公司,所任商级行业。金额型型			
入管理股份有限公司,历任高级行业 分析证。基现 任常级证。2009年12月22日至今任工添 富策略型证券 投资基型理。 2012年3月9日至202年3月9日至2020年3月3日任死资 高逆者处于。 国产者处于, 是一个工作。 高进行, 是一个工作。 高进行, 是一个工作, 是一个一个工作, 是一个一个工作, 是一个一个一一一个一个一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一一			
金管理股份有限公司,历任高级行业分析师基金经理助强业现任增强收益。部总量。2009年12月22日至全个任汇验言常型基础的基金经理。2012年3月9日至2020年9月3日任汉资温合资基建理。2014年4月8日至2016年4月8日至216年4月8日至2016年7月27日至1月日至2019年1月18日任汇添高途经经理。2017年2019年1月18日任汇流济证券投资经理。2017年3月15日至2017年3月15日至今任汇添资略定			
有限公司,历任高级行业分析师、基金经理增强收益部总型。2009年12月22日至今任汇部富策合型。企业的基金经理。2012年3月9日至2020年9月3日任汉等混合产基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金会的基金会对。2014年4月8日至2016年8月24日任河流高河增长混合资基金。的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇流流省流行值股票型金的基金经理。2017年3月15日至今任汇流流省绝对收益策略定			
任高级行业分析师、基金经理助理、规任增盛、企业的证据。2009年12月22日至今任汇添富策略回报。2012年3月9日至2020年3月9日至2020年3月9日至2020年3月9日至2020年3月9日至2020年3月3世代淡。高岭经建金的基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富的整金全的基金经验。的基金经验。的基金经验。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添新证券投资基金的基金经验。2017年3月15日至今任汇添富绝对收益策略定			
分析师、基金经理助理,现任增强收益部总监。2009年12月22日至今任汇添高策略回报混合型证券投资基金的基金金的基金全理。2012年3月9日至2020年9月3日任汉济高询向投资混合资基金的基金的基金的基金的基金的基金的数据。2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富治衡型证券投资基金的,基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添渝价值股票型基金的基金经理。2017年3月15日至今任汇添高绝对收益策略定			
经理助理,现任增强收益部总监。2009年12月22日至今任汇添富策略则报混合型基金的基金经理。2012年3月9日至2020年9月3日在投资基金理。2014年4月8日至2026年8月24日在广海富台资基金的基金经年4月8日至2016年8月24日在增长混合资基金的选择金额。2016年7月27日至2019年1月18沪浩深新型证金的基金经理。2017年3月15日至今行江添富岭市基金经对收益策略定			
任增强收益部总。2009年12月22日至今任汇添富策型金的提。2012年3月9日至2020年9月3日任投资混合产基金的基金经理。2012年3月9日至2020年9月3日投资混合产基金的基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日便汇添高户型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至219年1月18日任汇添新价值股票基金理。2017年3月15日至分任汇添新价值股票基金时基金经理。2017年3月15日至今任汇添编略定			
部总监。2009 年12月22日至今任汇添富策略回报 混合型金的基金经理。 2012年3月9 日至2020年9 月3日任投资混合资基金的基金经理。 2014年4月8 日至2016年8 月24日任汇添富混合型证券投资基金的型证券投资基金的型证券投资基金的型证券投资金经理。 2016年7月27日至2016年7月27日至2016年1月18日任汇添新价值股票基金的基金经理。 2017年3月15日在汇次新工金的基金经理。			
年12月22日至今任汇添富策略回报。富策略回报。混合型证券,投资基金的。基金全理。2012年3月9日至2020年9月3日任没资混合型证券,投资基金的基金经理。2014年4月8日至2016年8月24日任汇。添富合型证券投资基金的,基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添简值。股票型证券,投资基金的基金经理。2017年3月15日至今任汇添富绝对收益策略定			
至今任汇添富策略回报 混合型证券 投资基金的。 2012年3月9 日至2020年9 月3日仁汇资富户型证券 投资基金的基金经理。 2014年4月8 日至2016年8 月24日任汇 添富均型证金的 长混改基金。的基金经理。 2016年7月 27日至2019年1月18日 任汇添新价值 股票型证金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
富策略回报 混合型证券 投资基金的 基金经理。 2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添 富逆合型证券 投资基金的基金经理。 2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡型证券 券投金经 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日 任汇添新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017 年 3 月 15 日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
混合型证券 投资基金的 基金经理。 2012年3月9 日至2020年9 月3日任汇添 高逆向投资 混合型证券 投资基金的 基金经理。 2014年4月8 日至2016年8 月24日任汇 添富均衡增 长混合型证 券投资基金 的基金经理。 2016年7月 27日至2019年1月18日 任汇添富的值 股票到证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
投资基金的基金经理。 2012年3月9日至2020年9月3日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金全理。 2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。 2016年7月27日至2019年1月18日任汇添高价值股票型证券投资基金的基金经理。 2017年3月15日至今任汇添富绝对收益策略定			
基金经理。 2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。 2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡证券投资基金的基金经理。 2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添新价值股票型证券投资基金的基金经理。 2017 年 3 月 15 日至今任汇添益策略定			
2012 年 3 月 9 日至 2020年 9 月 3 日任汇添富迪向投资混合型证券投资基金的基金经理。 2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡证券投资基金的基金经理。 2016 年 7 月 27 日至 2019年 1 月 18 日任汇添富价值股票型证券投资基金的基金经理。 2017年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定			
日至2020年9 月3日任汇添 富逆向投资 混合型证券 投资基金的 基金经理。 2014年4月8 日至2016年8 月24日任汇 添富均衡增 长混合型证 券投资基金 的基金经理。 2016年7月 27日至2019年1月18日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
月3日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。 2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。 2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。 2017年3月15日至今任汇添富绝对收益策略定			
富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。 2014年4月8日至2016年8月24日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。 2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。 2017年3月15日至今任汇添富绝对收益策略定			
混合型证券 投资基金的 基金经理。 2014年4月8 日至2016年8 月24日任汇 添富均衡增 长混合型证 券投资基金的基金经理。 2016年7月 27日至2019年1月18日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
投资基金的基金经理。 2014年4月8 日至2016年8 月24日任汇 添富均衡增 长混合型证 券投资基金 的基金经理。 2016年7月 27日至2019年1月18日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
基金经理。 2014年4月8 日至2016年8 月24日任汇 添富均衡增 长混合型证 券投资基金 的基金经理。 2016年7月 27日至2019年1月18日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
2014年4月8 日至2016年8 月24日任汇 添富均衡增 长混合型证 券投资基金 的基金经理。 2016年7月 27日至2019 年1月18日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
日至2016年8 月24日任汇 添富均衡增 长混合型证 券投资基金 的基金经理。 2016年7月 27日至2019年1月18日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
月 24 日任汇 添富均衡增 长混合型证 券投资基金 的基金经理。 2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017 年 3 月 15 日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017年3月15日至今任汇添富绝对收益策略定			
长混合型证 券投资基金 的基金经理。 2016年7月 27日至2019 年1月18日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
券投资基金的基金经理。 2016年7月 27日至2019年1月18日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。 2017年3月15日至今任汇添富绝对收益策略定			
的基金经理。 2016年7月 27日至2019年1月18日 在汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
2016年7月 27日至2019 年1月18日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
27 日至 2019 年 1 月 18 日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017 年 3 月 15 日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
年1月18日 任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
任汇添富沪 港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
港深新价值 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
股票型证券 投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
投资基金的 基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
基金经理。 2017年3月 15日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
2017 年 3 月 15 日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
15 日至今任 汇添富绝对 收益策略定			
汇添富绝对 收益策略定			
收益策略定			
期开放混合			
			期开放混合

					Til (I) de bie
					型发起式证
					券投资基金
					的基金经理。
					2019年8月
					24 日至 2024
					年10月18日
					任汇添富均
					衡增长混合
					型证券投资
					基金的基金
					经理。2021年
					1月20日至今
					任汇添富沪
					深 300 基本面
					增强指数型
					证券投资基
					金的基金经
					理。2021年2
					月5日至2022
					年9月22日
					任汇添富价
					值成长均衡 #1/2/2/2/2/2/2/2/2/2/2/2/2/2/2/2/2/2/2/2
					投资混合型
					证券投资基
					金的基金经
					理。2021年9
					月16日至今
					任汇添富中
					证 500 基本面
					增强指数型 证类机次基
					证券投资基
					金的基金经理。
					四
					学技术大学
					金融工程博
					士。从业资
					本。
温琪	本基金的基	2024年06月	_	15	基金从业资
	金经理	05 日		10	举
					历: 2011年6
					月起加入汇
					添富基金管
					理股份有限
					公司。2024年
					ムり。2024 平

		6月5日至今
		任汇添富中
		证 500 基本面
		增强指数型
		证券投资基
		金的基金经
		理。2024年9
		月 27 日至今
		任汇添富红
		利智选混合
		型发起式证
		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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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

2025年一季度市场开年经历震荡调整,此后受到 DeepSeek 催化以及春节期间国内消费数据相对亮眼,市场热度提升,尤其是机器人和 AI 等板块表现活跃。中证 500 指数上涨 2. 31%,小盘和成长风格相对占优。有色金属、汽车、机械设备等行业在整个一季度上涨较多,而石油石化、商贸零售、煤炭等行业跌幅靠前。

报告期内,我们增加了小市值暴露,也积极调整了行业板块配置。本基金管理人将继续采用基本面与量化选股相结合的方式,在投资实践中不断总结反思,持续优化投资框架,力争在控制跟踪误差的基础上获取稳健的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 500 基本面增强指数 A 类份额净值增长率为 2.04%,同期业绩比较基准收益率为 2.21%。本报告期汇添富中证 500 基本面增强指数 C 类份额净值增长率为 1.83%,同期业绩比较基准收益率为 2.21%。

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	64, 779, 150. 41	90. 59
	其中: 股票	64, 779, 150. 41	90. 59
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	1, 103, 386. 58	1.54
	其中:债券	1, 103, 386. 58	1.54
	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	4, 688, 410. 73	6. 56
8	其他资产	934, 838. 48	1.31
9	合计	71, 505, 786. 20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	340, 955. 00	0.48
В	采矿业	3, 181, 729. 00	4. 50
С	制造业	37, 548, 253. 77	53. 10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2, 432, 327. 00	3. 44
Е	建筑业	67, 500. 00	0.10
F	批发和零售业	2, 599, 710. 00	3. 68

G	交通运输、仓储和邮政业	882, 245. 00	1. 25
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4, 074, 782. 55	5. 76
J	金融业	8, 741, 324. 60	12. 36
K	房地产业	782, 964. 00	1. 11
L	租赁和商务服务业	803, 979. 00	1.14
M	科学研究和技术服务业	222, 350. 88	0. 31
N	水利、环境和公共设施管理业	923, 842. 00	1.31
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	482, 817. 00	0.68
R	文化、体育和娱乐业	786, 911. 00	1. 11
S	综合	_	_
	合计	63, 871, 690. 80	90. 33

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

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	907, 459. 61	1.28
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	_	_
J	金融业	_	_
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	_	_
	合计	907, 459. 61	1. 28

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

					占基金资产
序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	净值比例
					(%)
1	600839	四川长虹	79, 500	816, 465. 00	1.15
2	601933	永辉超市	149, 200	714, 668. 00	1.01
3	002966	苏州银行	82,700	651, 676. 00	0.92
4	000426	兴业银锡	38, 800	523, 800. 00	0.74
5	601577	长沙银行	52, 400	481, 032. 00	0.68
6	600988	赤峰黄金	20,700	474, 030. 00	0. 67
7	300476	胜宏科技	5, 400	437, 454. 00	0. 62
8	002797	第一创业	57,000	425, 220. 00	0.60
9	601555	东吴证券	54, 100	421, 980. 00	0.60
10	600060	海信视像	16, 500	409, 530. 00	0.58

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股

票投资明细

 	BL III (1277	肌蛋力粉	数是 (肌) 八石() (二)		占基金资产净
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元) 	值比例(%)
1 000540		广钢气体	32, 911	378, 805. 61	0 54
	1 688548 股份				0.54
2	600782	新钢股份	86, 400	350, 784. 00	0.50
3	002110	三钢闽光	46, 200	177, 870. 00	0. 25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1, 103, 386. 58	1. 56
2	央行票据	_	_
3	金融债券	_	_
	其中: 政策性金融债	_	_
4	企业债券	_	_
5	企业短期融资券	_	_
6	中期票据	_	_
7	可转债 (可交换债)	_	_
8	同业存单	_	_
9	地方政府债	_	_
10	其他	_	_
11	合计	1, 103, 386. 58	1.56

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净
			, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,		值比例(%)
1	25 国债		9,000	899, 473. 81	1. 27
1	019766	01	9,000	055, 475. 01	1.21
0	010001	20 国债	2 000	002 010 77	0.90
2	019631	05		203, 912. 77	0. 29

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

112 TTT	持仓量(买		公允价值变动	风险说	
代码	名称	/卖)	合约市值 (元)	(元)	明
IC2506	IC2506	-2.00	-2, 280, 000. 00	51, 600. 00	
	公允价值变	5	1,600.00		
	股指期货投		-55. 77		
股指期货投资本期公允价值变动(元)				5	1,600.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金按照风险管理的原则,以套期保值为目的,参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险 收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结 合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监 会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制等制度,并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时,基金管理人股指期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律

法规和监管要求的变化。

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,苏州银行股份有限公司、长沙银行股份有限公司、东吴证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。 本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5. 11. 2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	281, 115. 41
2	应收证券清算款	651, 901. 08
3	应收股利	_
4	应收利息	_
5	应收申购款	1, 821. 99
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	934, 838. 48

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:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C
本报告期期初基金份 额总额	73, 317, 028. 96	23, 866, 196. 18
本报告期基金总申购 份额	1, 094, 173. 56	1, 873, 251. 40
减:本报告期基金总赎回份额	8, 639, 512. 64	2, 436, 940. 14
本报告期基金拆分变 动份额	_	_
本报告期期末基金份 额总额	65, 771, 689. 88	23, 302, 507. 44

注: 总申购份额含红利再投、转换入份额, 总赎回份额含转换出份额。

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

§8影响投资者决策的其他重要信息

- 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况
- 注:无
- 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证500基本面增强指数型证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富中证 500 基本面增强指数型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 500 基本面增强指数型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04月22日