汇添富上证综合指数证券投资基金 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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	汇添富上证综合指数
基金主代 码	470007
基金运作 方式	契约型开放式
基金合同 生效日	2009年07月01日
报告期末	
基金份额	914, 684, 863. 17
总额(份)	
投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化 风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪 误差小于 0.35%,且年化跟踪误差小于 6%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性,主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合,并根据优化模型确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。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。本基金建 仓时间为 3 个月,3 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规 定。本基金的投资策略主要包括:资产配置、抽样股票组合构建、股票组合调 整、存托凭证的投资策略。				
业绩比较 基准	上证综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%				
风险收益 特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。				
基金管理 人	汇添富基金管理股份有限公司				
基金托管 人	中国工商银行股份有限公司				
下属分级 基金的基金简称	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C			
下属分级 基金的交 易代码	470007	018536			
报告期末 下属分级 基金的份 额总额 (份)	852, 133, 220. 58	62, 551, 642. 59			

§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)		
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	
1. 本期已实现收益	23, 084, 628. 15	1, 687, 843. 84	
2. 本期利润	-5, 984, 541. 01	-953, 925. 38	
3. 加权平均基金份	-0.0068	-0, 0135	
额本期利润	-0.0008	-0.0135	
4. 期末基金资产净	934, 248, 697. 63	68, 016, 225. 50	
值	554, 240, 051. 05	06, 010, 223. 30	
5. 期末基金份额净	1.096	1.087	
值	1.090	1.007	

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

	汇添富上证综合指数 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	基准收益 率标准差 ④	1)-(3)	2-4	
过去三 个月	-0.59%	0.79%	-0.44%	0.81%	-0.15%	-0.02%	
过去六 个月	-0.68%	1.15%	0.03%	1.20%	-0.71%	-0.05%	
过去一	11. 43%	1.10%	9. 29%	1.14%	2.14%	-0.04%	
过去三 年	11.09%	0. 95%	2. 68%	0. 97%	8. 41%	-0.02%	
过去五 年	36. 71%	0. 96%	20.60%	0. 98%	16. 11%	-0.02%	
自基金 合同生 效起至 今	50. 52%	1.24%	14. 12%	1.23%	36. 40%	0. 01%	
		汇	添富上证综合	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	-0.69%	0.79%	-0. 44%	0.81%	-0. 25%	-0.02%	
过去六 个月	-0.86%	1.15%	0.03%	1.20%	-0.89%	-0.05%	
过去一	10. 98%	1.10%	9. 29%	1.14%	1. 69%	-0.04%	
自基金 合同生 效起至 今	5. 93%	0.97%	1.66%	1.00%	4. 27%	-0. 03%	

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

汇添富上证综合指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图





汇添富上证综合指数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(2009年07月01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。

本基金于 2023 年 05 月 19 日新增 C 类份额。

§ 4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
姓石		任职日期	离任日期	(年)	
吴振翔	本基金的基 金经理,指 数与量化投 资部副总监	2010年02月 06日	_	19	国籍:中国科学 中国科学博士。学技博:大学位为 中国科学学格。 从 为 资 。 学技博:从 资 。 经 , 资 。 经 , 资 。 经 , 资 。 经 , 资 。 是 管理工程 是 是 。 是 要 有 限 公 会 管理有限 公 。 全 管理有限 公

产品开发高级名 月 200 年 3 月 加入公 第 3 月 加入公 第 6 基 6 管理股份	 	 	
加入汇添富基金管理股份有限公司,历任理、股份有限品开发高级经理、级音级分析师、基金经理助理,现任资高级分析师、基金经理为量化投资基金的重。2010年2月6日至今任汇率富上证综分基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任深证300交数证券投资基金的基金经理。2011年9月28日至2015年11月2日任中证金融地产交易型升投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型升放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产发易型外投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证统计数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能流发基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证费为工生交易型外货工生交易型分量,2013年8月23日至2015年11月2日任中证货为工生交易对比较证券投资证券投资证券投资证券投资证券投资证券投资证券投资证券投资证券投资证券投资			产品开发高级经
管理股份有限公司,历任产品开发高级给理、数量投资高级分析,所、基金给理、数量投资高级分析,所、基金给理助理,现任省数与量化化投资部副之。2010年2月6日正正综合指数证券投经建。2011年9月16日至2013年11月7日任任评证300数基金分型理,2011年9月18日至2013年11月7日任任率市富深处被基金的基金经理。2013年11月2日任中级时,基金会经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中级时,产交易型开放式指数形数。			理。2008年3月
司,历任产品开发高级资理、数量投资高级分押、数金经型助理,现任指数与量化投资的年2月6日至今任治数证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任军证300交易型开放资基金的基金经理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添易证券投资型产量的基金经理。2013年11月7日任汇添易证券投资基金联接基金的基金经理。2013年11月2日任中证金融对货基金的基金经理。2013年11月2日任中证金融对货基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能测察交易证券经经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能测察交易证券经经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证代为证券经经理。2013年8月23日至2015年11月2日年证证经约下生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。			加入汇添富基金
司,历任产品开发高级资理、数量投资高级分押、数金经型助理,现任指数与量化投资的年2月6日至今任治数证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任军证300交易型开放资基金的基金经理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添易证券投资型产量的基金经理。2013年11月7日任汇添易证券投资基金联接基金的基金经理。2013年11月2日任中证金融对货基金的基金经理。2013年11月2日任中证金融对货基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能测察交易证券经经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能测察交易证券经经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证代为证券经经理。2013年8月23日至2015年11月2日年证证经约下生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。			管理股份有限公
发高级经理、数量投资金级分析师、基金经型数点。 基金经数的 基金经型数点 监。2010年2月6日至正综验点。 2010年2月6日至正综验点。 2011年9月16日至 2013年11月7日任宪证300交易型开放武者数证券投资基金的基金经理。 2011年9月28日至 2013年11月7日任宪证300交易型开放式指数据接基金的基金经理。 2013年1月2日任中证金融地产交易型升投资基金给经理。 2013年8月23日至 2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数的基金经理。 2013年8月23日至 2015年11月2日任中证统额交易证券经理。 2013年8月23日至 2015年11月2日任中证统制数据条经理。 2013年8月23日至 2015年11月2日任中证统制数证券投资重量工程,2013年8月23日至 2015年11月2日任中证据			
量投资高级分析 师、基金经理助 理,现任指数局。 监。2010年2月6日至今任汇添 富上证验者给指数 证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至 2013年11月7日任任深 300交易型升收资基金的基金经理。2011年9月28日至 2013年11月7日任汇易 300交易型升收资 基金经理。2013年11月7日任汇易 300交易型升收资 基金经理。2013年1月月日任中证金融投资 2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型升投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证统 11月2日任中证统 11次多证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证统 11次多证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证统 11月2日任中证统 11月2日任中证统 11月2日任中证统 11月2日任中证长 11月2日中证长 11月			
师、基金经理助理,现任指数与量化投资部。2010年2月6日至今任汇添富上证综合指数证券经理。2011年9月16日至2013年11月7日任深证300交易型开放基金的基金经理。2011年9月28日至2013年1月7日任汇添易型开放式指数证券投资基金统约基金经验的基金经验的基金经验的基金经验的基金经验的基金经验的基金经验的基金经验的			
理,现任指数与量化投资部副总监。2010年2月6日至今任汇添富上证综价量。在2011年9月16日至全任汇添富上证综价基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任东证300交易型开放或指数证券投资理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添高型开放或式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金财产数证券投资基金的基金经经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证统,指数证券处理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证代,源交易对决定基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证代,2013年8月23日至2015年11月2日任中证代,2013年8月23日至2015年11月2日任中证长约工生分型开放式指数证券投			
量化投资部副总 监。2010年2月6日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任荣证300交易型开放资基金的基金经验。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富产业资数。2013年1月7日任产。2013年11月2日任中证型产资证券投资基金的基金经理。2013年11月2日任中证型产资证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证舱地产交易型券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证舱,源交易型投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型升资式指数证券投			
监。2010年2月6日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的,基金经资基金的的基金。2011年9月16日至2013年11月7日任保证300交易型开放式指数证券投资基金的基金全型。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富型开投资基金企理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金用放式指数证券全经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型券设建。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投理。2013年8月23日至2015年11月2日年中证能源交易型开放式指数证券投理。2013年8月23日至2015年11月2日年证长药工生交易型开放式指数证券投理。			
6日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任保证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011年9月28日任汇添富开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金额交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投票。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投理。			
富上证综合指数 证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任深证 300交易型开放3省数 证券投资基金的基金经理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富开证300交易型开投资基金统理型。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证第5日至2015年11月2日任中证第5日至2015年11月2日任中证第5日至2015年11月2日任中证条药卫生交易型开放式指数证券投			
证券投资基金的基金经理。2011年9月16日至2013年11月7日任深证300变易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300交易型开放式指数证券基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数证券投理理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证第次分量至3013年8月23日至2015年11月2日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
基金经理。2011 年9月16日至2013年11月7日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金8月23日至2015年11月2日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
年9月16日至 2013年11月7 日任深证300交 易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2011 年9月28日至 2013年11月7 日任汇深富深证 300交易型开放 式指数证券投资 基金联基金的 基金经理。2013年8月23日至 2015年11月2 日任中证金放政 指数证券投理。2013年8月23日至 2015年11月2日任中证能 源交易型开放式 指数证券投理。2013年8月23日至 2015年11月2日任中证能 源交易型开放式 指数证券投			
2013年11月7日任深证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数证券投理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能流源交易型开放式指数正券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证的表验是理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证的表验是理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2011 年9月28日至 2013年11月7日任汇添富深证 300交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金的 基金经理。2013 年8月23日至 2015年11月2 日任中证金融地 产交易型开放式 指数证金经理。 2013年8月23日至 2015年11月2日任中证能 源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23日至 2015年11月2日任中证能 源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23日至 2015年11月2日任中证底 药工生交易型开 放式指数证券投			
证券投资基金的基金经理。2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证底额元生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证医药工生交易型开放式指数证券投			
基金经理。2011 年9月28日至 2013年11月7 日任汇添富深证 300交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金的 基金经理。2013 年8月23日至 2015年11月2 日任中证金融地 产交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23 日至2015年11月2日任中证能 源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23日至2015年11月2日任中证底 源交易型开放式 指数证券投资基			
年9月28日至 2013年11月7 日任汇添富深证 300交易型开放 式指数联券投资 基金联接基金的 基金经理。2013 年8月23日至 2015年11月2 日任中证金融地 产交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23日至 2015年11月2日任中证能 源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23日至 2015年11月2日任中证能 源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23日至 2015年11月2日任中证医 药卫生交易型开 放式指数证券投			
2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金的 基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地 产交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能 源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能 源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医 药卫生交易型开 放式指数证券投			
日任汇添富深证 300 交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金的 基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式 指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式 指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
300 交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金的 基金经理。2013 年8月23日至 2015年11月2 日任中证金融地 产交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23日至2015年11 月2日任中证能 源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23 日至2015年11 月2日任中证医 药卫生交易型开 放式指数证券投			
式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
基金联接基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
基金经理。2013 年8月23日至2015年11月2 日任中证金融地产交易型开放式 指数证券投资基金的基金经理。 2013年8月23 日至2015年11 月2日任中证能源交易型开放式 指数证券投资基金的基金经理。 2013年8月23 日至2015年11 月2日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
2015年11月2 日任中证金融地 产交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23 日至2015年11 月2日任中证能 源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23 日至2015年11 月2日任中证医 药卫生交易型开 放式指数证券投			
日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013年8月23日至2015年11月2日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
产交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能 源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医 药卫生交易型开 放式指数证券投			
指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
月2日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2013年8月23日至2015年11月2日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投			
源交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2013年8月23 日至2015年11 月2日任中证医 药卫生交易型开 放式指数证券投			
指数证券投资基金的基金经理。 2013年8月23 日至2015年11 月2日任中证医 药卫生交易型开放式指数证券投			
金的基金经理。 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医 药卫生交易型开 放式指数证券投			
2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医 药卫生交易型开 放式指数证券投			
日至 2015 年 11 月 2 日任中证医 药卫生交易型开 放式指数证券投			
月2日任中证医 药卫生交易型开 放式指数证券投			
放式指数证券投			
			资基金的基金经

		理。2013年8月
		23 日至 2015 年
		11月2日任中证
		主要消费交易型
		开放式指数证券
		投资基金的基金
		经理。2013年11
		月6日至今任汇
		添富沪深 300 安
		中动态策略指数
		型证券投资基金
		的基金经理。
		2015年2月16
		日至2023年4月
		24 日任汇添富成
		长多因子量化策
		略股票型证券投
		资基金的基金经
		理。2015年3月
		24日至2022年6
		月 13 日任汇添
		富中证主要消费
		交易型开放式指
		数证券投资基金
		联接基金的基金
		经理。2016年1
		月 21 日至今任
		汇添富中证精准
		医疗主题指数型
		发起式证券投资
		基金 (LOF) 的基
		金经理。2016年
		7月28日至今任
		中证上海国企交
		易型开放式指数
		证券投资基金的
		基金经理。2016
		年 12 月 22 日至
		今任汇添富中证
		互联网医疗主题
		指数型发起式证
		券投资基金 (LOE) 的某人经
		(LOF)的基金经
		理。2017年8月
		10 日至今任汇添 富中证 500 指数
		亩甲Ⅲ 300 指剱

			型发起式证券投
			资基金(LOF)的
			基金经理。2018
			年3月23日至
			2024年4月26
			日任汇添富沪深
			300 指数增强型
			证券投资基金的
			基金经理。2019
			年7月26日至
			2022年6月13
			日任中证长三角
			一体化发展主题
			交易型开放式指
			数证券投资基金
			的基金经理。
			2019年9月24
			日至2022年6月
			13 日任中证长三
			角一体化发展主
			题交易型开放式
			指数证券投资基
			金联接基金的基
			金经理。2019年
			11月6日至2022
			年6月13日任汇
			添富中证国企一
			带一路交易型开
			放式指数证券投
			资基金的基金经
			理。2020年3月
			5日至2022年6
			月13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 10 月 29 日至
			今任汇添富 MSCI
			中国 A50 互联互
			通交易型开放式
			指数证券投资基
			金的基金经理。
			2022年1月11
			日至2024年4月
		l	

		15 日任汇添富
		MSCI 中国 A50 互
		联互通交易型开
		放式指数证券投
		资基金联接基金
		的基金经理。
		2022年1月27
		日至2023年8月
		23 日任汇添富中
		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。
		2022年4月28
		日至2024年4月
		30 日任汇添富中
		证沪港深张江自
		主创新 50 交易
		型开放式指数证
		券投资基金的基
		金经理。2023年
		4月25日至2024
		年4月26日任汇
		添富中证 500 指
		数增强型证券投
		资基金的基金经
		理。2023年6月
		6 日至今任汇添
		富量化选股混合
		型证券投资基金
		的基金经理。
		2023年9月1日
		至今任汇添富稳
		健回报债券型证
		券投资基金的基
		金经理。2023年
		11月7日至今任
		汇添富国证 2000
		指数增强型证券
		投资基金的基金
		经理。2023年11
		月 22 日至 2025
		年3月21日任汇
		本3月21日任化 添富上证综合交
		易型开放式指数
		证券投资基金的

		基金经理。2024
		年1月31日至今
		任汇添富稳丰回
		报债券型发起式
		证券投资基金的
		基金经理。2024
		年 12 月 10 日至
		2024年12月11
		日任汇添富中证
		A500 指数型证券
		投资基金的基金
		经理。2024年12
		月 12 日至今任
		汇添富中证 A500
		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 27 日至今任
		汇添富中证 A500
		指数增强型证券
		投资基金的基金
		经理。
		こと生。

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

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
	公募基金	13	19, 476, 278, 055.	2010年2月6
	公券荃金 	13	43	日
吴振	私募资产管理	1	0.000.050.04	2025年3月11
翔	计划	1	9, 866, 352. 94	日
	其他组合	_	-	
	合计	14	19, 486, 144, 408.	

-			
- 1			
- 1		0.5	
- 1		37	
- 1			
- 1			
- 1			

注: "任职时间"为首次开始管理上表中本类产品的时间。本报告期内兼任投资人员有产品 离任情况,离任产品情况如下:

吴振翔一离任产品类型:公募基金,离任数量:1只,离任时间:2025年3月21日;离任产品类型:私募资产管理计划,离任数量:0只,离任时间:无。

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,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A股市场经历年初大幅下挫之后整体震荡上行,季末再度有所回调,主要宽基季度表现基本收平。但行业、风格有着显著分化。行业主题方面,科技、消费表现突出,风格上则倾向于小盘成长类。

国内经济来看,2024年9月底政治局会议决定加大财政货币政策逆周期调节力度以来,一季度稳增长政策持续落地。从阶段性政策效果看,经济数据延续去年四季度以来的回稳趋势,市场风险偏好回暖。PMI继续维持在50以上水平,考虑季节效应后出口仍维持在较高增速,工业增加值、固定资产投资同比保持平稳,生产端仍延续平稳回暖,地产销售也出现企稳。但另一方面,从社融及通胀数据看,居民及企业部门信用收缩趋势尚未结束。

国内资本市场来看,一季度处于业绩相对真空阶段。政策提振稳住市场基本盘,同时新一轮 AI 发展带来主题聚焦。科技领域以 DeepSeek 及相关国产 AI 大模型为核心,扩散至 AI 端侧应用、AI 应用软件及 AI 与医药、金融等结合的信息化领域。以 AI 为代表的科技发展是较为明确的国家战略方向,在生产效率提升、全球科技竞争中有着重要意义,长期来看空间广阔。债市方面,由于去年四季度债市对于政策宽松预期过于乐观,利率下行幅度过大,今年一季度收益率回调修正。

上证综合指数是 A 股市场代表性宽基指数,本基金则是这一代表性指数的产品化形式, 为投资者提供了整体配置国内权益资产的优质工具。

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

本报告期汇添富上证综合指数 A 类份额净值增长率为-0.59%,同期业绩比较基准收益率为-0.44%。本报告期汇添富上证综合指数 C 类份额净值增长率为-0.69%,同期业绩比较基准

收益率为-0.44%。

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	946, 235, 898. 31	94. 08
	其中: 股票	946, 235, 898. 31	94. 08
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	7, 858, 681. 92	0.78
	其中:债券	7, 858, 681. 92	0.78
	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	49, 535, 906. 11	4. 93
8	其他资产	2, 139, 422. 38	0. 21
9	合计	1, 005, 769, 908. 72	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	1, 253, 834. 80	0. 13
В	采矿业	74, 053, 138. 90	7. 39
С	制造业	393, 054, 115. 67	39. 22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47, 898, 116. 23	4. 78
Е	建筑业	23, 994, 744. 75	2. 39

批发和零售业	11, 955, 844. 64	1. 19
交通运输、仓储和邮政业	44, 873, 456. 07	4.48
住宿和餐饮业	1, 047, 497. 00	0. 10
信息传输、软件和信息技术服务业	64, 584, 361. 43	6. 44
金融业	253, 975, 170. 30	25. 34
房地产业	9, 503, 408. 54	0.95
租赁和商务服务业	7, 219, 350. 00	0.72
科学研究和技术服务业	4, 257, 434. 78	0.42
水利、环境和公共设施管理业	4, 288, 674. 88	0.43
居民服务、修理和其他服务业	_	_
教育	_	_
卫生和社会工作	1, 157, 508. 63	0. 12
文化、体育和娱乐业	3, 119, 241. 69	0.31
综合	_	_
合计	946, 235, 898. 31	94. 41
	交通运输、仓储和邮政业 住宿和餐饮业 信息传输、软件和信息技术服务业 金融业 房地产业 租赁和商务服务业 科学研究和技术服务业 水利、环境和公共设施管理业 居民服务、修理和其他服务业 教育 卫生和社会工作 文化、体育和娱乐业 综合	交通运输、仓储和邮政业 44,873,456.07 住宿和餐饮业 1,047,497.00 信息传输、软件和信息技术服务业 64,584,361.43 金融业 253,975,170.30 房地产业 9,503,408.54 租赁和商务服务业 7,219,350.00 科学研究和技术服务业 4,257,434.78 水利、环境和公共设施管理业 4,288,674.88 居民服务、修理和其他服务业 - 教育 - 卫生和社会工作 1,157,508.63 文化、体育和娱乐业 3,119,241.69 综合 -

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

		股票名			占基金资产
序号	股票代码		数量(股)	公允价值 (元)	净值比例
		1/2/\			(%)
1	601288	农业银	7, 836, 973	40, 595, 520. 14	4. 05
	001200	行	., 000, 010	10, 000, 020. 11	1.00

2	600519	贵州茅台	24, 829	38, 758, 069. 00	3. 87
3	601988	中国银	5, 663, 772	31, 717, 123. 20	3. 16
4	601857	中国石油	3, 060, 957	25, 161, 066. 54	2.51
5	600036	招商银	398, 115	17, 234, 398. 35	1.72
6	601628	中国人寿	402, 971	15, 151, 709. 60	1.51
7	601328	交通银 行	1, 962, 217	14, 618, 516. 65	1.46
8	600900	长江电 力	468, 811	13, 037, 633. 91	1.30
9	601939	建设银行	1, 466, 511	12, 949, 292. 13	1. 29
10	601088	中国神	313, 315	12, 015, 630. 25	1.20

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	7, 858, 681. 92	0.78
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	7, 858, 681. 92	0.78

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

		债券名			占基金资产
序号	债券代码	阪分石 称	数量(张)	公允价值 (元)	净值比例
		沙小			(%)
1	019749	24 国债	E9, 000	5 940 067 40	0.59
	019749	15	58,000	5, 849, 967. 40	0. 58
0	010750	24 国债	20, 000	9 000 714 59	0.20
2	019758	21	20,000	2, 008, 714. 52	0.20

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,中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司出现 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	71, 680. 31
2	应收证券清算款	646, 703. 18
3	应收股利	_
4	应收利息	_
5	应收申购款	1, 421, 038. 89
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	2, 139, 422. 38

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§6开放式基金份额变动

单位: 份

项目	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数C
本报告期期初基金份	878, 654, 902. 79	83, 802, 442. 15
额总额	878, 034, 902. 79	03, 002, 442. 13
本报告期基金总申购	73, 546, 848. 30	43, 681, 654. 74
份额	73, 340, 646. 30	43, 001, 034. 74
减:本报告期基金总赎	100, 068, 530. 51	64, 932, 454. 30
回份额	100, 008, 530. 51	04, 932, 434. 30

本报告期基金拆分变 动份额	_	-
本报告期期末基金份 额总额	852, 133, 220. 58	62, 551, 642. 59

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上证综合指数证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富上证综合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、报告期内汇添富上证综合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04月22日