

汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2023 年中期报告

2023 年 06 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 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。本中期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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.8 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	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	20
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1 资产负债表	20
6.2 利润表	21
6.3 净资产（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	24
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
7.3 期末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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
7.6 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	65
7.7 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	65
7.8 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	65
7.9 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	65

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12 本报告期投资基金情况.....	65
7.13 投资组合报告附注.....	66
§ 8 基金份额持有人信息.....	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
8.3 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.....	67
§ 9 开放式基金份额变动.....	68
§ 10 重大事件揭示.....	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
10.2 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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
11.1 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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§ 12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	汇添富中证 800ETF 联接	
基金主代码	012596	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 09 月 29 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	57,796,746.06	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 800ETF 联接 A	汇添富中证 800ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	012596	012597
报告期末下属分级基金的 份额总额(份)	19,459,925.04	38,336,821.02

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 08 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 16 日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	平安银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。在正常市场情况下，本基金力争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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致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、跟踪误差进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略，目标 ETF 的投资策略，成份股、备选成份

	股投资策略，债券投资策略，可转换债券投资策略，资产支持证券投资策略，金融衍生工具投资策略，转融通证券出借投资策略，存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为中证 800ETF 的联接基金，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，本基金通过投资目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。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、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95511-3
传真	021-28932998	0755-82080387
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	200010	518001
法定代表人	李文	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
----------------	---------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路 728 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 06 月 30 日)	
	汇添富中证 800ETF 联接 A	汇添富中证 800ETF 联接 C
本期已实现收益	184,934.04	16,119.96
本期利润	41,305.50	1,889,585.03
加权平均基金份额本期利润	0.0020	0.1362
本期加权平均净值利润率	0.21%	14.47%
本期基金份额净值增长率	-0.15%	-0.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	-1,842,873.35	-3,696,364.23
期末可供分配基金份额利润	-0.0947	-0.0964
期末基金资产净值	17,617,051.69	34,640,456.79
期末基金份额净值	0.9053	0.9036
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-9.47%	-9.64%

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

汇添富中证 800ETF 联接 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
过去一个月	1.13%	0.80%	0.61%	0.82%	0.52%	-0.02%
过去三个月	-4.62%	0.73%	-4.94%	0.76%	0.32%	-0.03%
过去六个月	-0.15%	0.75%	0.05%	0.76%	-0.20%	-0.01%
过去一年	-10.91%	0.88%	-11.94%	0.90%	1.03%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-9.47%	0.93%	-19.17%	1.03%	9.70%	-0.10%
汇添富中证 800ETF 联接 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
过去一个月	1.12%	0.79%	0.61%	0.82%	0.51%	-0.03%
过去三个月	-4.64%	0.73%	-4.94%	0.76%	0.30%	-0.03%
过去六个月	-0.19%	0.75%	0.05%	0.76%	-0.24%	-0.01%
过去一年	-10.98%	0.88%	-11.94%	0.90%	0.96%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-9.64%	0.93%	-19.17%	1.03%	9.53%	-0.10%

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800ETF联接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800ETF联接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29日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。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、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、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。

2023 上半年，汇添富基金新成立 27 只公开募集证券投资基金，包括 10 只股票型基金、9 只混合型基金、8 只债券型基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 297 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

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		
乐无穹	本基金的基金经理	2021 年 09 月 29 日		9	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资

				<p>部分分析师。2019 年 4 月 15 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 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。2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 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 9 月 29 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添</p>
--	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

				<p>富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）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。2021 年 12 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能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。2022 年 6 月 13 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 7 月 29 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年</p>
--	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>12月7日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2023年4月13日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金(QDII-LOF)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19日至今任汇添富中证1000交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
过蓓蓓	本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监	2021年09月29日	2023年05月18日	12	<p>国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2015年8月3日至今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。2015年8月3日至2023年4月13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。2015年8月3日至2023年4月6日任中证能源交</p>

				<p>易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今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。2015 年 8 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。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 5 月 22 日任深证 300 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生物科技主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2022 年 12 月 1 日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 10 月 23 日至 2023 年 5 月 22 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经</p>
--	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

				<p>理。2019 年 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2023 年 5 月 18 日任汇添富中证 800 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 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日任汇添富国证生物医药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 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药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 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 2 日至今任汇</p>
--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					添富中证中药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 3 月 14 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 3 月 30 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注:1、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;

2、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;

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、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 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,确保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 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

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、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化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，公平对待了旗下各投资组合。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% 的情况有 25 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。

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

2023 年上半年，资本市场先在经济复苏背景下显现出修复行情，二季度市场整体显著回调。

上半年美联储累计加息三次，将联邦基金目标利率提升至 5.00%-5.25% 区间。3 月议息会议声明文件对未来继续加息的表述有所弱化，5 月暗示后续加息暂缓但年内仍较难降息。市场普遍预期本轮加息周期接近尾声，但转向降息周期仍然需要一定时间。

全球来看，海外通胀回落速度较为缓慢，美元指数二季度阶段性走强，人民币兑美元贬值压力加大。北向资金二季度小幅净流入，较一季度显著放缓。

国内来看，3 月两会召开，仍然坚持以稳增长为中心，加强协同，共同促进高质量发展。经济数据在二季度普遍表现疲软。GDP 增速低于市场预期。6 月官方制造业 PMI 数据 49，较前值小幅企稳，但仍低于 50。1-5 月规模以上工业企业营业收入累计同比增长 0.1%，利润累计同比下滑 18.8%，相较 1-4 月累计营收增速下滑、累计利润增速降幅有所收窄。国内经济整体仍处于弱复苏阶段，内需修复动力不足、外需增长压力较大。经济发展模式转型阶段存在压力和挑战。在稳增长压力较大的背景下，政策层面有望持续发力。6 月 MLF 下调

10 个基点，随后一年期、五年期 LPR 均下调 10 个基点，有望减轻企业融资成本、居民债务负担压力。

资本市场方面，新一轮科技创新话题引发热议，信息技术领域表现强势，智能化相关子板块体现出较强的爆发力，并有向产业各领域扩散的态势。市场认知科技创新市场前景广阔。二季度市场有所回调，行业主题结构性分化显著。一季度表现强势的计算机、通信等板块在 4 月和 5 月显著回调，6 月开始重新受到市场关注。银行、证券等金融类资产则是 4 月表现强势之后进入回调。当前科技创新和中特估仍是市场重点关注的资本市场投资主线，对不同偏好的资金有差异化的吸引力。

中证 800 指数是 A 股市场代表性宽基指数，覆盖 A 股数千只个股中市值较大、流动性较好的前 800 只股票，风格均衡，是 A 股市场核心资产的代表。而 800ETF 及其联接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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 800ETF 联接 A 类份额净值增长率为-0.15%，同期业绩比较基准收益率为 0.05%。本报告期汇添富中证 800ETF 联接 C 类份额净值增长率为-0.19%，同期业绩比较基准收益率为 0.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济呈现弱复苏状态，复苏强度低于年初预期。分项来看，工业制造和投资相对具有韧性，消费和出口较为疲弱。但居民消费倾向有抬升迹象，结合收入提升预期，下半年内需动能有望出现改善。国内政策基调仍以稳增长为主，尽管难有强刺激，但或许可以期待整体托底和结构性的支持政策。

全球来看，美国通胀超预期回落，加息周期步入尾声成为市场共识，不排除下半年仍有加息的可能性。通胀数据及通胀预期仍然是加息节奏的关键指标。

资本市场上半年整体表现为震荡修复。业绩角度来看，A 股整体盈利增速尚未明显改善，结构分化仍然较为显著，且与股价表现存在一定的错位。信息技术领域在全球智能化浪潮的背景下获得资金关注，长期市场空间充分，但短期能体现出实际业绩增长的比例有限。与此同时低估值高分红类的资产也获得了较多资金流入。创新成长和具备安全边际的低估值资产，形成了两种较为极端的投资偏好，预计仍然会是下半年市场的关注焦点。

4.6 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。

4.7 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，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 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

自 2023 年 1 月 10 日起至 2023 年 3 月 29 日，本基金连续 52 个工作日基金资产净值低于五千万元。自 2023 年 4 月 7 日起至 2023 年 6 月 27 日，本基金连续 53 个工作日基金资产净值低于五千万元。自 2023 年 6 月 28 日起至报告期末，本基金未再出现基金资产净值预警情形。

§ 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	30,806,389.16	6,043,029.36
结算备付金		14,920.62	4,854.86
存出保证金		18,134.51	25,799.72
交易性金融资产	6.4.7.2	39,890,299.00	52,202,279.00
其中：股票投资		11,415,564.00	-
基金投资		28,474,735.00	52,202,279.00
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,822,610.45	14,515.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		72,552,353.74	58,290,478.30
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		20,147,777.96	3,015,130.17
应付赎回款		68,955.73	11,619.70
应付管理人报酬		406.21	348.47
应付托管费		135.38	116.11
应付销售服务费		536.19	2,497.92
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	6.4.7.7	77,033.79	20,000.00
负债合计		20,294,845.26	3,049,712.37
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	57,796,746.06	60,990,269.87
未分配利润	6.4.7.9	-5,539,237.58	-5,749,503.94
净资产合计		52,257,508.48	55,240,765.93
负债和净资产总计		72,552,353.74	58,290,478.30

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 57,796,746.06 份。本基金下属汇添富中证 800ETF 联接 A 基金份额净值 0.9053 元，基金份额总额 19,459,925.04 份；本基金下属汇添富中证 800ETF 联接 C 基金份额净值 0.9036 元，基金份额总额 38,336,821.02 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		1,988,846.33	3,193,494.29
1. 利息收入		7,693.98	21,949.30
其中：存款利息收入	6.4.7.10	7,693.98	21,949.30
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		249,284.82	-129,575.39
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-4,789.94	-106,360.52
基金投资收益	6.4.7.12	253,949.69	-23,244.47
债券投资收益	6.4.7.13	125.07	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	29.60
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）	6.4.7.18	1,729,836.53	3,301,002.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	2,031.00	117.91
减：二、营业总支出		57,955.80	25,226.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,366.44	7,422.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	788.82	2,474.18
3. 销售服务费		6,655.11	5,412.94
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	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		1,034.75	-
8. 其他费用	6.4.7.21	47,110.68	9,916.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,930,890.53	3,168,267.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,930,890.53	3,168,267.59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,930,890.53	3,168,267.59

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	60,990,269.87	-5,749,503.94	55,240,765.93
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	60,990,269.87	-5,749,503.94	55,240,765.93

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,193,523.81	210,266.36	-2,983,257.45
（一）、综合收益总额	-	1,930,890.53	1,930,890.53
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,193,523.81	-1,720,624.17	-4,914,147.98
其中：1. 基金申购款	83,702,125.58	-6,247,133.60	77,454,991.98
2. 基金赎回款	-86,895,649.39	4,526,509.43	-82,369,139.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	57,796,746.06	-5,539,237.58	52,257,508.48
项目	上年度可比期间		
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,566,296.26	105,425.48	4,671,721.74
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	4,566,296.26	105,425.48	4,671,721.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,415,393.70	745,664.08	51,161,057.78
（一）、综合收益总额	-	3,168,267.59	3,168,267.59
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	50,415,393.70	-2,422,603.51	47,992,790.19
其中：1. 基金申购款	143,514,688.19	-6,303,188.67	137,211,499.52

2. 基金赎回款	-93,099,294.49	3,880,585.16	-89,218,709.33
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	54,981,689.96	851,089.56	55,832,779.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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[2021]51 号文《关于准予汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2021 年 9 月 29 日生效。首次设立基金募集规模为 293,174,924.72 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（2021）验字第 60466941_B77 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于其他股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（分离交易可转债）等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具

(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资股指期货或其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%,每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的标的指数为中证 800 指数及其未来可能发生的变更。本基金通过投资于目标 ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 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、应用指南、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 3 号《半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。

6.4.3 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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%;

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;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让, 暂免征收印花税。

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。

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）及地方教育费附加。

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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2023 年 06 月 30 日
活期存款	30,806,389.16
等于：本金	30,805,663.90
加：应计利息	725.26
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	30,806,389.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	11,429,403.82	-	11,415,564.00	-13,839.82
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	29,080,322.29	-	28,474,735.00	-605,587.29
其他	-	-	-	-
合计	40,509,726.11	-	39,890,299.00	-619,427.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 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	9,923.11
其中：交易所市场	9,923.11
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	42,315.49
应付信息披露费	24,795.19
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	77,033.79

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 800ETF 联接 A	
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,505,007.35	19,505,007.35
本期申购	34,045,837.17	34,045,837.17
本期赎回（以“-”号填列）	-34,090,919.48	-34,090,919.48
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	19,459,925.04	19,459,925.04
汇添富中证 800ETF 联接 C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	41,485,262.52	41,485,262.52
本期申购	49,656,288.41	49,656,288.41
本期赎回（以“-”号填列）	-52,804,729.91	-52,804,729.91
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	38,336,821.02	38,336,821.02

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 800ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-177,957.76	-1,642,456.45	-1,820,414.21
本期利润	184,934.04	-143,628.54	41,305.50
本期基金份额交易产生的变动数	1,901.21	-65,665.85	-63,764.64
其中：基金申购款	-19,970.87	-1,970,086.11	-1,990,056.98
基金赎回款	21,872.08	1,904,420.26	1,926,292.34
本期已分配利	-	-	-

润			
本期末	8,877.49	-1,851,750.84	-1,842,873.35
汇添富中证 800ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-438,503.13	-3,490,586.60	-3,929,089.73
本期利润	16,119.96	1,873,465.07	1,889,585.03
本期基金份额 交易产生的变 动数	370,692.35	-2,027,551.88	-1,656,859.53
其中：基金申 购款	-104,931.00	-4,152,145.62	-4,257,076.62
基金赎回款	475,623.35	2,124,593.74	2,600,217.09
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	-51,690.82	-3,644,673.41	-3,696,364.23

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	7,322.30
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	186.44
其他	185.24
合计	7,693.98

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	989.15
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-5,779.09
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-4,789.94

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

卖出股票成交总额	2,633,393.93
减：卖出股票成本总额	2,618,350.00
减：交易费用	14,054.78
买卖股票差价收入	989.15

6.4.7.11.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
申购基金份额总额	8,711,200.00
减：现金支付申购款总额	3,745,377.80
减：申购股票成本总额	4,971,601.29
减：交易费用	-
申购差价收入	-5,779.09

6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	41,292,662.46
减：卖出/赎回基金成本总额	41,028,191.97
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	8,622.87
减：交易费用	1,897.93
基金投资收益	253,949.69

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	55.07
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	70.00
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	125.07

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	1,010,481.37
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)	1,001,270.00

成本总额	
减：应计利息总额	9,141.37
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	70.00

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,729,836.53
——股票投资	-13,839.82
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,743,676.35
——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	1,729,836.53

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	2,031.00
替代损益	-
其他	-
合计	2,031.00

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	47,110.68

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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, 基金注册登记机构
平安银行股份有限公司 (“平安银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
中证 800 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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	-	-	15,298,584.81	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	35,856,539.20	100.00

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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 (%)
	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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	11,626.26	100.00	9,003.33	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,366.44	7,422.59
其中：支付销售机构的客户维护费	3,151.47	2,003.89

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	788.82	2,474.18

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0），若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 800ETF 联接 A	汇添富中证 800ETF 联接 C	合计
平安银行股份有限公司	-	423.40	423.40
东方证券股份有限公司	-	5.54	5.54
汇添富基金管理股份有限公司	-	705.45	705.45
合计	-	1,134.39	1,134.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 800ETF 联接 A	汇添富中证 800ETF 联接 C	合计
平安银行股份有限公司	-	67.03	67.03
东方证券股份有	-	5.47	5.47

限公司			
汇添富基金管理 股份有限公司	-	630.93	630.93
合计	-	703.43	703.43

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富中证 800ETF 联接 A		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2021 年 09 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	14,654,152.01	-
报告期间申购/买入总份额	-	14,654,152.01
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	14,654,152.01	14,654,152.01
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	75.30	81.00
汇添富中证 800ETF 联接 C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2021 年 09 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

注：基金管理人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。

6.4.10.5.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	30,806,389.16	7,322.30	2,976,890.16	19,841.28

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

于本报告期末，本基金持有 26,150,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 1.45%。（于上年度可比期间，本基金持有 43,362,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 2.62%。）本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券，和基金托管人平安银行发行的股票平安银行。于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 3,600.00 股，持有平安银行 1,600.00 股。

6.4.11 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。

6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 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							
银行存款	30,806,389.16	-	-	-	-	-	30,806,389.16
结算备付金	14,920.62	-	-	-	-	-	14,920.62
存出保证金	18,134.51	-	-	-	-	-	18,134.51
交易性金融资产	-	-	-	-	-	39,890,299.00	39,890,299.00
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	-	-	-	-	-	1,822,610.45	1,822,610.45
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	30,839,444.29	-	-	-	-	41,712,909.45	72,552,353.74
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-

债							
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	20,147,777.96	20,147,777.96
应付赎回款	-	-	-	-	-	68,955.73	68,955.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	406.21	406.21
应付托管费	-	-	-	-	-	135.38	135.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-	536.19	536.19
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	-	-	-	-	-	77,033.79	77,033.79
负债总计	-	-	-	-	-	20,294,845.26	20,294,845.26
利率敏感	30,839,444.29	-	-	-	-	21,418,064.19	52,257,508.48

度缺 口							
上年 度末 2022 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							
银行存款	6,043,029.36	-	-	-	-	-	6,043,029.36
结算 备付 金	4,854.86	-	-	-	-	-	4,854.86
存出 保证 金	25,799.72	-	-	-	-	-	25,799.72
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	52,202,279.00	52,202,279.00
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	-	-	-	-	-	14,515.36	14,515.36
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	6,073,683.94	-	-	-	-	52,216,794.36	58,290,478.30
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	3,015,130.17	3,015,130.17
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,619.70	11,619.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	348.47	348.47
应付托管费	-	-	-	-	-	116.11	116.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,497.92	2,497.92
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	-	-	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,049,712.37	3,049,712.37
利率敏感度缺口	6,073,683.94	-	-	-	-	49,167,081.99	55,240,765.93

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	11,415,564.00	21.84	-	-
交易性金融资产—基金投资	28,474,735.00	54.49	52,202,279.00	94.50
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	39,890,299.00	76.33	52,202,279.00	94.50
----	---------------	-------	---------------	-------

6.4.13.4.3.2 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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证 800 指数上涨 5%	2,424,429.85	2,313,228.38
	中证 800 指数下跌 5%	-2,424,429.85	-2,313,228.38

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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2023 年 06 月 30 日
第一层次	39,890,299.00
第二层次	-
第三层次	-

合计	39,890,299.00
----	---------------

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	11,415,564.00	15.73
	其中：股票	11,415,564.00	15.73
2	基金投资	28,474,735.00	39.25
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	30,821,309.78	42.48
8	其他各项资产	1,840,744.96	2.54
9	合计	72,552,353.74	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	48,298.00	0.09
B	采矿业	615,714.00	1.18
C	制造业	5,658,011.00	10.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	492,701.00	0.94
E	建筑业	345,516.00	0.66
F	批发和零售业	167,825.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	398,584.00	0.76
H	住宿和餐饮业	24,516.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	602,070.00	1.15
J	金融业	2,583,493.00	4.94
K	房地产业	153,619.00	0.29
L	租赁和商务服务业	124,761.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	113,263.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	7,004.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	45,040.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	21,669.00	0.04
S	综合	13,480.00	0.03
	合计	11,415,564.00	21.84

7.2.2 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。

7.3 期末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	600519	贵州茅台	400	676,400.00	1.29
2	601318	中国平安	7,200	334,080.00	0.64
3	600036	招商银行	8,400	275,184.00	0.53
4	601166	兴业银行	10,000	156,500.00	0.30
5	600276	恒瑞医药	3,200	153,280.00	0.29
6	600900	长江电力	6,800	150,008.00	0.29
7	600030	中信证券	6,800	134,504.00	0.26
8	601899	紫金矿业	11,200	127,344.00	0.24
9	600887	伊利股份	4,400	124,608.00	0.24

10	601012	隆基绿能	4,000	114,680.00	0.22
11	600436	片仔癀	400	114,544.00	0.22
12	601398	工商银行	23,600	113,752.00	0.22
13	601328	交通银行	18,800	109,040.00	0.21
14	600309	万华化学	1,200	105,408.00	0.20
15	300750	宁德时代	400	91,516.00	0.18
16	601888	中国中免	800	88,424.00	0.17
17	601816	京沪高铁	16,800	88,368.00	0.17
18	601668	中国建筑	14,400	82,656.00	0.16
19	600028	中国石化	12,800	81,408.00	0.16
20	601288	农业银行	21,600	76,248.00	0.15
21	603259	药明康德	1,200	74,772.00	0.14
22	600941	中国移动	800	74,640.00	0.14
23	600809	山西汾酒	400	74,028.00	0.14
24	601088	中国神华	2,400	73,800.00	0.14
25	601138	工业富联	2,800	70,560.00	0.14
26	600438	通威股份	2,000	68,620.00	0.13
27	600031	三一重工	4,000	66,520.00	0.13
28	600406	国电南瑞	2,800	64,680.00	0.12
29	600016	民生银行	16,800	63,000.00	0.12
30	600048	保利发展	4,800	62,544.00	0.12
31	600089	特变电工	2,800	62,412.00	0.12
32	601601	中国太保	2,400	62,352.00	0.12
33	600050	中国联通	12,800	61,440.00	0.12
34	688981	中芯国际	1,200	60,624.00	0.12
35	600837	海通证券	6,400	59,008.00	0.11
36	600919	江苏银行	8,000	58,800.00	0.11
37	601728	中国电信	10,400	58,552.00	0.11
38	600000	浦发银行	8,000	57,920.00	0.11
39	601857	中国石油	7,600	56,772.00	0.11
40	600690	海尔智家	2,400	56,352.00	0.11
41	601988	中国银行	14,400	56,304.00	0.11
42	603288	海天味业	1,200	56,220.00	0.11
43	601766	中国中车	8,400	54,600.00	0.10
44	600570	恒生电子	1,200	53,148.00	0.10
45	600150	中国船舶	1,600	52,656.00	0.10
46	002594	比亚迪	200	51,654.00	0.10
47	600905	三峡能源	9,600	51,552.00	0.10
48	601390	中国中铁	6,800	51,544.00	0.10
49	601225	陕西煤业	2,800	50,932.00	0.10
50	688777	中控技术	800	50,224.00	0.10
51	601688	华泰证券	3,600	49,572.00	0.09
52	000858	五粮液	300	49,071.00	0.09

53	000333	美的集团	800	47,136.00	0.09
54	601169	北京银行	10,000	46,300.00	0.09
55	688008	澜起科技	800	45,936.00	0.09
56	600104	上汽集团	3,200	45,344.00	0.09
57	601985	中国核电	6,400	45,120.00	0.09
58	601211	国泰君安	3,200	44,768.00	0.09
59	600660	福耀玻璃	1,200	43,020.00	0.08
60	603986	兆易创新	400	42,500.00	0.08
61	601628	中国人寿	1,200	41,952.00	0.08
62	688396	华润微电子	800	41,928.00	0.08
63	600600	青岛啤酒	400	41,452.00	0.08
64	601919	中远海控	4,400	41,360.00	0.08
65	603019	中科曙光	800	40,720.00	0.08
66	601818	光大银行	12,800	39,296.00	0.08
67	603501	韦尔股份	400	39,216.00	0.08
68	601229	上海银行	6,800	39,100.00	0.07
69	600111	北方稀土	1,600	38,368.00	0.07
70	600585	海螺水泥	1,600	37,984.00	0.07
71	601658	邮储银行	7,600	37,164.00	0.07
72	600132	重庆啤酒	400	36,864.00	0.07
73	600426	华鲁恒升	1,200	36,756.00	0.07
74	603799	华友钴业	800	36,728.00	0.07
75	601989	中国重工	7,600	36,632.00	0.07
76	600009	上海机场	800	36,336.00	0.07
77	600760	中航沈飞	800	36,000.00	0.07
78	600958	东方证券	3,600	34,920.00	0.07
79	688599	天合光能	800	34,088.00	0.07
80	600893	航发动力	800	33,808.00	0.06
81	600019	宝钢股份	6,000	33,720.00	0.06
82	600999	招商证券	2,400	32,568.00	0.06
83	688303	大全能源	800	32,360.00	0.06
84	601689	拓普集团	400	32,280.00	0.06
85	002371	北方华创	100	31,765.00	0.06
86	603596	伯特利	400	31,704.00	0.06
87	601186	中国铁建	3,200	31,520.00	0.06
88	300059	东方财富	2,200	31,240.00	0.06
89	603659	璞泰来	800	30,576.00	0.06
90	603882	金域医学	400	30,200.00	0.06
91	601360	三六零	2,400	30,096.00	0.06
92	300760	迈瑞医疗	100	29,980.00	0.06
93	601006	大秦铁路	4,000	29,720.00	0.06
94	601377	兴业证券	4,800	29,376.00	0.06

95	000651	格力电器	800	29,208.00	0.06
96	601009	南京银行	3,600	28,800.00	0.06
97	601600	中国铝业	5,200	28,548.00	0.05
98	600547	山东黄金	1,200	28,176.00	0.05
99	603260	合盛硅业	400	28,008.00	0.05
100	600010	宝钢股份	15,600	27,924.00	0.05
101	601669	中国电建	4,800	27,552.00	0.05
102	601939	建设银行	4,400	27,544.00	0.05
103	603392	万泰生物	400	26,708.00	0.05
104	002415	海康威视	800	26,488.00	0.05
105	601800	中国交建	2,400	26,184.00	0.05
106	000725	京东方 A	6,400	26,176.00	0.05
107	002475	立讯精密	800	25,960.00	0.05
108	600011	华能国际	2,800	25,928.00	0.05
109	601100	恒立液压	400	25,732.00	0.05
110	603993	洛阳钼业	4,800	25,584.00	0.05
111	600886	国投电力	2,000	25,300.00	0.05
112	600584	长电科技	800	24,936.00	0.05
113	600196	复星医药	800	24,720.00	0.05
114	600588	用友网络	1,200	24,600.00	0.05
114	600732	爱旭股份	800	24,600.00	0.05
116	600372	中航电子	1,600	24,288.00	0.05
117	600674	川投能源	1,600	24,080.00	0.05
118	600188	兖矿能源	800	23,936.00	0.05
119	600015	华夏银行	4,400	23,804.00	0.05
120	600926	杭州银行	2,000	23,500.00	0.04
121	300274	阳光电源	200	23,326.00	0.04
122	600085	同仁堂	400	23,024.00	0.04
123	601021	春秋航空	400	22,988.00	0.04
124	600795	国电电力	6,000	22,980.00	0.04
125	600346	恒力石化	1,600	22,928.00	0.04
126	600115	中国东航	4,800	22,848.00	0.04
127	000063	中兴通讯	500	22,770.00	0.04
128	600176	中国巨石	1,600	22,656.00	0.04
129	603338	浙江鼎力	400	22,404.00	0.04
130	600741	华域汽车	1,200	22,152.00	0.04
131	601877	正泰电器	800	22,120.00	0.04
132	600029	南方航空	3,600	21,708.00	0.04
133	600157	永泰能源	15,200	21,584.00	0.04
134	600079	人福医药	800	21,552.00	0.04
135	600765	中航重机	800	21,208.00	0.04
136	603369	今世缘	400	21,120.00	0.04
137	002714	牧原股份	500	21,075.00	0.04

138	000568	泸州老窖	100	20,957.00	0.04
139	600489	中金黄金	2,000	20,660.00	0.04
140	601868	中国能建	8,800	20,592.00	0.04
141	002230	科大讯飞	300	20,388.00	0.04
142	600845	宝信软件	400	20,324.00	0.04
143	601615	明阳智能	1,200	20,256.00	0.04
144	600989	宝丰能源	1,600	20,176.00	0.04
145	601633	长城汽车	800	20,136.00	0.04
146	601117	中国化学	2,400	19,872.00	0.04
147	601111	中国国航	2,400	19,776.00	0.04
148	603589	口子窖	400	19,740.00	0.04
149	600745	闻泰科技	400	19,560.00	0.04
150	601838	成都银行	1,600	19,536.00	0.04
151	601555	东吴证券	2,800	19,432.00	0.04
152	601066	中信建投	800	19,360.00	0.04
153	300124	汇川技术	300	19,263.00	0.04
154	601788	光大证券	1,200	19,068.00	0.04
155	601618	中国中冶	4,800	19,056.00	0.04
156	600482	中国动力	800	18,752.00	0.04
156	600536	中国软件	400	18,752.00	0.04
158	603160	汇顶科技	400	18,500.00	0.04
159	601901	方正证券	2,800	18,312.00	0.04
160	601058	赛轮轮胎	1,600	18,224.00	0.03
161	002352	顺丰控股	400	18,036.00	0.03
162	000001	平安银行	1,600	17,968.00	0.03
163	600329	达仁堂	400	17,956.00	0.03
164	601607	上海医药	800	17,928.00	0.03
165	603899	晨光股份	400	17,856.00	0.03
166	002142	宁波银行	700	17,710.00	0.03
167	600487	亨通光电	1,200	17,592.00	0.03
168	600233	圆通速递	1,200	17,472.00	0.03
169	601108	财通证券	2,400	17,376.00	0.03
170	688567	孚能科技	800	17,272.00	0.03
171	000792	盐湖股份	900	17,253.00	0.03
172	600415	小商品城	2,000	17,060.00	0.03
173	600754	锦江酒店	400	16,936.00	0.03
174	688223	晶科能源	1,200	16,872.00	0.03
175	000002	万科A	1,200	16,824.00	0.03
176	688126	上海硅产业集团	800	16,720.00	0.03
177	601238	广汽集团	1,600	16,672.00	0.03
178	002129	TCL 中环	500	16,600.00	0.03
179	300498	温氏股份	900	16,515.00	0.03

180	603127	昭衍新药	400	16,360.00	0.03
181	600988	赤峰黄金	1,200	16,152.00	0.03
182	688772	珠海冠宇 电池	800	16,120.00	0.03
183	600027	华电国际	2,400	16,056.00	0.03
184	600038	中直股份	400	15,928.00	0.03
185	601233	桐昆股份	1,200	15,900.00	0.03
186	600039	四川路桥	1,600	15,696.00	0.03
187	002920	德赛西威	100	15,581.00	0.03
188	600511	国药股份	400	15,540.00	0.03
189	603927	中科软	400	15,424.00	0.03
190	601865	福莱特	400	15,404.00	0.03
191	603816	顾家家居	400	15,260.00	0.03
192	600362	江西铜业	800	15,184.00	0.03
192	600803	新奥股份	800	15,184.00	0.03
194	600418	江淮汽车	1,200	15,108.00	0.03
195	600378	昊华科技	400	15,056.00	0.03
196	600352	浙江龙盛	1,600	14,960.00	0.03
197	600875	东方电气	800	14,920.00	0.03
198	603806	福斯特	400	14,876.00	0.03
199	603517	绝味食品	400	14,860.00	0.03
200	300015	爱尔眼科	800	14,840.00	0.03
201	603939	益丰药房	400	14,800.00	0.03
202	300308	中际旭创	100	14,745.00	0.03
203	600521	华海药业	800	14,728.00	0.03
204	601336	新华保险	400	14,708.00	0.03
205	605358	立昂微	400	14,692.00	0.03
206	600219	南山铝业	4,800	14,496.00	0.03
207	600298	安琪酵母	400	14,484.00	0.03
208	600383	金地集团	2,000	14,420.00	0.03
209	601077	渝农商行	4,000	14,360.00	0.03
210	601162	天风证券	4,800	14,304.00	0.03
211	600873	梅花生物	1,600	14,288.00	0.03
212	601995	中金公司	400	14,208.00	0.03
213	600699	均胜电子	800	14,112.00	0.03
214	002466	天齐锂业	200	13,982.00	0.03
215	601872	招商轮船	2,400	13,896.00	0.03
216	600109	国金证券	1,600	13,872.00	0.03
217	600918	中泰证券	2,000	13,820.00	0.03
218	600705	中航产融	3,600	13,788.00	0.03
219	600096	云天化	800	13,656.00	0.03
220	601128	常熟银行	2,000	13,640.00	0.03
221	000661	长春高新	100	13,630.00	0.03

222	600879	航天电子	1,600	13,584.00	0.03
223	002304	洋河股份	100	13,135.00	0.03
224	600153	建发股份	1,200	13,092.00	0.03
225	601990	南京证券	1,600	13,088.00	0.03
226	601699	潞安环能	800	13,056.00	0.02
227	603529	爱玛科技	400	12,888.00	0.02
228	601696	中银证券	1,200	12,792.00	0.02
229	600332	白云山	400	12,752.00	0.02
230	000938	紫光股份	400	12,740.00	0.02
230	600885	宏发股份	400	12,740.00	0.02
232	600177	雅戈尔	2,000	12,620.00	0.02
233	601168	西部矿业	1,200	12,612.00	0.02
234	002459	晶澳科技	300	12,510.00	0.02
235	600516	方大炭素	2,000	12,400.00	0.02
236	002460	赣锋锂业	200	12,192.00	0.02
237	600839	四川长虹	2,400	12,120.00	0.02
238	600884	杉杉股份	800	12,112.00	0.02
239	600460	士兰微	400	12,108.00	0.02
240	002050	三花智控	400	12,104.00	0.02
241	300014	亿纬锂能	200	12,100.00	0.02
242	603712	七一二	400	12,084.00	0.02
243	600497	驰宏锌锗	2,400	12,048.00	0.02
244	601998	中信银行	2,000	11,960.00	0.02
245	603883	老百姓	400	11,940.00	0.02
246	601878	浙商证券	1,200	11,856.00	0.02
247	600325	华发股份	1,200	11,820.00	0.02
248	600066	宇通客车	800	11,792.00	0.02
249	002821	凯莱英	100	11,786.00	0.02
250	600580	卧龙电驱	800	11,688.00	0.02
251	601319	中国人保	2,000	11,680.00	0.02
251	603000	人民网	400	11,680.00	0.02
253	600566	济川药业	400	11,616.00	0.02
254	600535	天士力	800	11,608.00	0.02
255	600315	上海家化	400	11,604.00	0.02
256	002027	分众传媒	1,700	11,577.00	0.02
257	600546	山煤国际	800	11,576.00	0.02
258	601155	新城控股	800	11,528.00	0.02
259	600061	国投资本	1,600	11,392.00	0.02
260	600183	生益科技	800	11,360.00	0.02
261	300454	深信服	100	11,325.00	0.02
262	600118	中国卫星	400	11,284.00	0.02
263	300724	捷佳伟创	100	11,235.00	0.02
264	000338	潍柴动力	900	11,214.00	0.02

265	603233	大参林	400	11,204.00	0.02
266	600481	双良节能	800	11,184.00	0.02
266	600642	申能股份	1,600	11,184.00	0.02
268	600160	巨化股份	800	11,024.00	0.02
269	600271	航天信息	800	10,952.00	0.02
269	603456	九洲药业	400	10,952.00	0.02
271	600529	山东药玻	400	10,888.00	0.02
272	600166	福田汽车	3,200	10,880.00	0.02
273	600161	天坛生物	400	10,860.00	0.02
274	600170	上海建工	4,000	10,760.00	0.02
275	600739	辽宁成大	800	10,520.00	0.02
276	600018	上港集团	2,000	10,500.00	0.02
277	600143	金发科技	1,200	10,476.00	0.02
278	002555	三七互娱	300	10,464.00	0.02
279	000625	长安汽车	800	10,344.00	0.02
279	601636	旗滨集团	1,200	10,344.00	0.02
281	601997	贵阳银行	2,000	10,320.00	0.02
282	600392	盛和资源	800	10,296.00	0.02
283	601016	节能风电	2,800	10,276.00	0.02
284	603228	景旺电子	400	10,260.00	0.02
285	600970	中材国际	800	10,200.00	0.02
286	600380	健康元	800	10,168.00	0.02
287	601898	中煤能源	1,200	10,128.00	0.02
288	600862	中航高科	400	10,124.00	0.02
289	601717	郑煤机	800	9,960.00	0.02
290	600060	海信视像	400	9,900.00	0.02
291	600704	物产中大	2,000	9,880.00	0.02
291	603156	养元饮品	400	9,880.00	0.02
293	000100	TCL 科技	2,500	9,850.00	0.02
294	601216	君正集团	2,400	9,840.00	0.02
295	603077	和邦生物	4,000	9,720.00	0.02
296	000977	浪潮信息	200	9,700.00	0.02
297	300782	卓胜微	100	9,663.00	0.02
298	002812	恩捷股份	100	9,635.00	0.02
298	300496	中科创达	100	9,635.00	0.02
300	601198	东兴证券	1,200	9,624.00	0.02
301	600820	隧道股份	1,600	9,616.00	0.02
302	000733	振华科技	100	9,585.00	0.02
303	600848	上海临港	800	9,560.00	0.02
304	600348	华阳股份	1,200	9,492.00	0.02
305	603379	三美股份	400	9,404.00	0.02
306	600637	东方明珠	1,200	9,384.00	0.02
307	600316	洪都航空	400	9,380.00	0.02

308	600909	华安证券	2,000	9,340.00	0.02
309	002049	紫光国微	100	9,325.00	0.02
310	601577	长沙银行	1,200	9,312.00	0.02
311	601881	中国银河	800	9,288.00	0.02
312	688009	中国通号	1,600	9,280.00	0.02
313	600985	淮北矿业	800	9,216.00	0.02
314	600435	北方导航	800	9,192.00	0.02
315	600499	科达制造	800	9,088.00	0.02
316	002179	中航光电	200	9,070.00	0.02
317	688779	长远锂科	800	9,016.00	0.02
318	601958	金铂股份	800	8,920.00	0.02
319	600141	兴发集团	400	8,888.00	0.02
319	601966	玲珑轮胎	400	8,888.00	0.02
321	300122	智飞生物	200	8,840.00	0.02
322	300223	北京君正	100	8,831.00	0.02
323	600369	西南证券	2,400	8,760.00	0.02
324	600673	东阳光	1,200	8,652.00	0.02
325	600021	上海电力	800	8,616.00	0.02
326	600390	五矿资本	1,600	8,608.00	0.02
327	600025	华能水电	1,200	8,556.00	0.02
328	600867	通化东宝	800	8,352.00	0.02
329	600998	九州通	800	8,304.00	0.02
330	600863	内蒙华电	2,000	8,300.00	0.02
331	600398	海澜之家	1,200	8,256.00	0.02
332	002709	天赐材料	200	8,238.00	0.02
333	603858	步长制药	400	8,236.00	0.02
334	600655	豫园股份	1,200	8,232.00	0.02
335	300661	圣邦股份	100	8,213.00	0.02
336	603638	艾迪精密	400	8,208.00	0.02
337	002271	东方雨虹	300	8,178.00	0.02
338	600498	烽火通信	400	8,148.00	0.02
339	601880	辽港股份	5,200	8,112.00	0.02
340	600131	国网信通	400	8,076.00	0.02
341	600008	首创环保	2,800	8,064.00	0.02
342	601698	中国卫通	400	7,952.00	0.02
343	601991	大唐发电	2,400	7,944.00	0.02
344	300142	沃森生物	300	7,935.00	0.02
345	600859	王府井	400	7,916.00	0.02
346	600528	中铁工业	800	7,904.00	0.02
347	600663	陆家嘴	800	7,896.00	0.02
348	600606	绿地控股	2,800	7,700.00	0.01
349	600416	湘电股份	400	7,636.00	0.01
350	600549	厦门钨业	400	7,612.00	0.01

351	000988	华工科技	200	7,602.00	0.01
352	603218	日月股份	400	7,596.00	0.01
353	600258	首旅酒店	400	7,580.00	0.01
354	000776	广发证券	500	7,355.00	0.01
355	600171	上海贝岭	400	7,300.00	0.01
356	002409	雅克科技	100	7,288.00	0.01
357	601456	国联证券	800	7,280.00	0.01
358	300450	先导智能	200	7,234.00	0.01
359	600399	抚顺特钢	700	7,140.00	0.01
360	688538	和辉光电	2,800	7,112.00	0.01
361	002241	歌尔股份	400	7,100.00	0.01
362	300316	晶盛机电	100	7,090.00	0.01
363	601000	唐山港	2,000	7,060.00	0.01
364	603568	伟明环保	400	7,004.00	0.01
365	600582	天地科技	1,200	6,996.00	0.01
366	600062	华润双鹤	400	6,968.00	0.01
367	600208	新潮中宝	2,800	6,944.00	0.01
368	000166	申万宏源	1,500	6,930.00	0.01
369	601866	中远海发	2,800	6,916.00	0.01
370	002180	纳思达	200	6,850.00	0.01
371	600517	国网英大	1,200	6,840.00	0.01
372	600959	江苏有线	2,000	6,760.00	0.01
372	601611	中国核建	800	6,760.00	0.01
374	600282	南钢股份	2,000	6,740.00	0.01
375	601005	重庆钢铁	4,800	6,720.00	0.01
375	601106	中国一重	2,000	6,720.00	0.01
377	002841	视源股份	100	6,684.00	0.01
378	001979	招商蛇口	500	6,515.00	0.01
379	600927	永安期货	400	6,504.00	0.01
380	002410	广联达	200	6,498.00	0.01
381	601179	中国西电	1,200	6,492.00	0.01
382	300347	泰格医药	100	6,454.00	0.01
383	600737	中粮糖业	800	6,440.00	0.01
384	002025	航天电器	100	6,380.00	0.01
385	601665	齐鲁银行	1,600	6,272.00	0.01
386	002756	永兴材料	100	6,261.00	0.01
387	300487	蓝晓科技	100	6,242.00	0.01
388	002340	格林美	900	6,219.00	0.01
389	600755	厦门国贸	800	6,192.00	0.01
390	603885	吉祥航空	400	6,172.00	0.01
391	603056	德邦股份	400	6,168.00	0.01
392	601992	金隅集团	2,800	6,104.00	0.01
393	601666	平煤股份	800	6,032.00	0.01

394	300919	中伟股份	100	6,025.00	0.01
395	002252	上海莱士	800	6,008.00	0.01
396	300676	华大基因	100	5,999.00	0.01
397	601231	环旭电子	400	5,984.00	0.01
398	601236	红塔证券	800	5,960.00	0.01
399	002422	科伦药业	200	5,936.00	0.01
400	601778	晶科科技	1,200	5,928.00	0.01
401	002236	大华股份	300	5,925.00	0.01
402	000301	东方盛虹	500	5,910.00	0.01
403	300832	新产业	100	5,900.00	0.01
404	300408	三环集团	200	5,870.00	0.01
405	300012	华测检测	300	5,850.00	0.01
406	603317	天味食品	400	5,844.00	0.01
407	600297	广汇汽车	2,800	5,824.00	0.01
408	002493	荣盛石化	500	5,820.00	0.01
409	600667	太极实业	800	5,808.00	0.01
410	600906	财达证券	800	5,760.00	0.01
411	600556	天下秀	800	5,672.00	0.01
412	601136	首创证券	400	5,668.00	0.01
413	601598	中国外运	1,200	5,592.00	0.01
414	600167	联美控股	800	5,576.00	0.01
415	600895	张江高科	400	5,568.00	0.01
416	601808	中海油服	400	5,552.00	0.01
417	600871	石化油服	2,800	5,544.00	0.01
418	002074	国轩高科	200	5,524.00	0.01
419	000425	徐工机械	800	5,416.00	0.01
420	000157	中联重科	800	5,400.00	0.01
420	603707	健友股份	400	5,400.00	0.01
422	601118	海南橡胶	1,200	5,376.00	0.01
423	000768	中航西飞	200	5,350.00	0.01
424	600827	百联股份	400	5,348.00	0.01
425	000423	东阿阿胶	100	5,345.00	0.01
426	600598	北大荒	400	5,332.00	0.01
427	600373	中文传媒	400	5,328.00	0.01
428	002202	金风科技	500	5,310.00	0.01
429	000538	云南白药	100	5,248.00	0.01
430	601156	东航物流	400	5,200.00	0.01
431	600056	中国医药	400	5,192.00	0.01
432	300037	新宙邦	100	5,189.00	0.01
433	002384	东山精密	200	5,180.00	0.01
434	600022	山东钢铁	3,600	5,112.00	0.01
435	002738	中矿资源	100	5,094.00	0.01
436	000807	云铝股份	400	5,092.00	0.01

437	601608	中信重工	1,200	5,052.00	0.01
438	300073	当升科技	100	5,033.00	0.01
439	600155	华创云信	800	4,976.00	0.01
440	600901	江苏金租	1,200	4,956.00	0.01
441	600801	华新水泥	400	4,940.00	0.01
442	300395	菲利华	100	4,920.00	0.01
443	000786	北新建材	200	4,902.00	0.01
444	000895	双汇发展	200	4,898.00	0.01
445	300207	欣旺达	300	4,896.00	0.01
446	600339	中油工程	1,200	4,884.00	0.01
447	000009	中国宝安	400	4,828.00	0.01
448	300438	鹏辉能源	100	4,804.00	0.01
449	300558	贝达药业	100	4,803.00	0.01
450	300146	汤臣倍健	200	4,796.00	0.01
451	601718	际华集团	1,600	4,752.00	0.01
452	300604	长川科技	100	4,749.00	0.01
453	002311	海大集团	100	4,684.00	0.01
454	000876	新希望	400	4,672.00	0.01
454	002028	思源电气	100	4,672.00	0.01
454	600195	中牧股份	400	4,672.00	0.01
457	601098	中南传媒	400	4,640.00	0.01
458	002001	新和成	300	4,620.00	0.01
459	002625	光启技术	300	4,578.00	0.01
460	601928	凤凰传媒	400	4,560.00	0.01
461	300003	乐普医疗	200	4,522.00	0.01
462	002156	通富微电	200	4,520.00	0.01
463	002648	卫星化学	300	4,488.00	0.01
464	002007	华兰生物	200	4,482.00	0.01
465	600782	新钢股份	1,200	4,452.00	0.01
466	600500	中化国际	800	4,448.00	0.01
467	603225	新风鸣	400	4,420.00	0.01
468	600995	南网储能	400	4,404.00	0.01
469	002736	国信证券	500	4,365.00	0.01
470	600409	三友化工	800	4,360.00	0.01
471	000963	华东医药	100	4,337.00	0.01
472	600718	东软集团	400	4,264.00	0.01
473	601568	北元集团	800	4,216.00	0.01
474	300888	稳健医疗	100	4,167.00	0.01
475	600597	光明乳业	400	4,160.00	0.01
476	002557	洽洽食品	100	4,155.00	0.01
477	000066	中国长城	300	4,149.00	0.01
478	002368	太极股份	100	4,117.00	0.01
479	600808	马钢股份	1,600	4,112.00	0.01

480	000783	长江证券	700	4,060.00	0.01
481	300373	扬杰科技	100	4,057.00	0.01
482	603866	桃李面包	400	4,048.00	0.01
483	003816	中国广核	1,300	4,043.00	0.01
484	600967	内蒙一机	400	4,040.00	0.01
485	300418	昆仑万维	100	4,028.00	0.01
486	300136	信维通信	200	4,016.00	0.01
486	601187	厦门银行	800	4,016.00	0.01
488	002518	科士达	100	4,001.00	0.01
489	300999	金龙鱼	100	3,999.00	0.01
490	000021	深科技	200	3,998.00	0.01
491	002407	多氟多	200	3,972.00	0.01
492	002385	大北农	600	3,960.00	0.01
493	600377	宁沪高速	400	3,932.00	0.01
494	002966	苏州银行	600	3,930.00	0.01
495	000933	神火股份	300	3,900.00	0.01
496	000513	丽珠集团	100	3,891.00	0.01
497	601228	广州港	1,200	3,876.00	0.01
498	300058	蓝色光标	400	3,868.00	0.01
499	601828	美凯龙	800	3,832.00	0.01
500	300759	康龙化成	100	3,828.00	0.01
501	600707	彩虹股份	800	3,808.00	0.01
502	300144	宋城演艺	300	3,720.00	0.01
503	002281	光迅科技	100	3,709.00	0.01
504	600507	方大特钢	800	3,704.00	0.01
505	600968	海油发展	1,200	3,684.00	0.01
506	002185	华天科技	400	3,680.00	0.01
507	000983	山西焦煤	400	3,640.00	0.01
508	002568	百润股份	100	3,635.00	0.01
509	002223	鱼跃医疗	100	3,599.00	0.01
510	300390	天华新能	100	3,580.00	0.01
511	002497	雅化集团	200	3,556.00	0.01
512	300433	蓝思科技	300	3,528.00	0.01
513	002432	九安医疗	100	3,521.00	0.01
514	002595	豪迈科技	100	3,513.00	0.01
515	000975	银泰黄金	300	3,510.00	0.01
516	300628	亿联网络	100	3,507.00	0.01
517	600956	新天绿能	400	3,488.00	0.01
518	600126	杭钢股份	800	3,472.00	0.01
519	000630	铜陵有色	1,200	3,468.00	0.01
520	002600	领益智造	500	3,455.00	0.01
521	300568	星源材质	200	3,438.00	0.01
522	002430	杭氧股份	100	3,436.00	0.01

523	002797	第一创业	600	3,432.00	0.01
524	300413	芒果超媒	100	3,421.00	0.01
525	000591	太阳能	500	3,390.00	0.01
526	002624	完美世界	200	3,378.00	0.01
527	300357	我武生物	100	3,363.00	0.01
528	000932	华菱钢铁	700	3,339.00	0.01
529	300024	机器人	200	3,334.00	0.01
530	300212	易华录	100	3,323.00	0.01
531	002601	龙佰集团	200	3,300.00	0.01
532	300253	卫宁健康	300	3,246.00	0.01
533	000623	吉林敖东	200	3,208.00	0.01
534	002078	太阳纸业	300	3,207.00	0.01
535	600299	安迪苏	400	3,188.00	0.01
536	002240	盛新锂能	100	3,187.00	0.01
537	002673	西部证券	500	3,175.00	0.01
538	000708	中信特钢	200	3,168.00	0.01
539	600095	湘财股份	400	3,120.00	0.01
540	601139	深圳燃气	400	2,916.00	0.01
541	600928	西安银行	800	2,816.00	0.01
542	601969	海南矿业	400	2,632.00	0.01
543	600350	山东高速	400	2,548.00	0.00
544	600623	华谊集团	400	2,492.00	0.00
545	601158	重庆水务	400	2,224.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600519	贵州茅台	1,018,525.00	1.84
2	601318	中国平安	504,113.00	0.91
3	600036	招商银行	414,621.00	0.75
4	601166	兴业银行	235,142.00	0.43
5	600276	恒瑞医药	231,162.00	0.42
6	600900	长江电力	225,558.00	0.41
7	600030	中信证券	201,427.00	0.36
8	601899	紫金矿业	192,124.00	0.35
9	600887	伊利股份	187,546.00	0.34
10	601012	隆基绿能	173,308.00	0.31
11	600436	片仔癀	172,158.00	0.31
12	601398	工商银行	170,754.00	0.31

13	601328	交通银行	163,899.00	0.30
14	600309	万华化学	158,163.00	0.29
15	601888	中国中免	133,182.00	0.24
16	601816	京沪高铁	133,006.00	0.24
17	601668	中国建筑	125,076.00	0.23
18	600028	中国石化	121,989.00	0.22
19	601288	农业银行	113,946.00	0.21
20	603259	药明康德	112,313.00	0.20

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。

7.4.2 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	600519	贵州茅台	175,932.00	0.32
2	601318	中国平安	92,521.00	0.17
3	600036	招商银行	74,756.00	0.14
4	601166	兴业银行	43,605.00	0.08
5	600900	长江电力	42,563.00	0.08
6	601012	隆基绿能	39,374.00	0.07
7	600276	恒瑞医药	38,932.00	0.07
8	600030	中信证券	36,800.00	0.07
9	601888	中国中免	35,463.00	0.06
10	601899	紫金矿业	35,013.00	0.06
11	603259	药明康德	32,231.00	0.06
12	600887	伊利股份	31,220.00	0.06
13	600309	万华化学	29,356.00	0.05
14	601398	工商银行	28,560.00	0.05
15	600436	片仔癀	27,473.00	0.05
16	601328	交通银行	25,832.00	0.05
17	600809	山西汾酒	24,648.00	0.04
18	601668	中国建筑	23,256.00	0.04
19	601816	京沪高铁	22,268.00	0.04
20	600438	通威股份	20,126.00	0.04

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。

7.4.3 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	16,401,005.11
卖出股票收入（成交）总额	2,633,393.93

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策与风险说明

本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便投资者通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策，投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	515800	添富中证 800ETF	交易型开放式	26,150,000.00	28,474,735.00	54.49	是

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中信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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	18,134.51
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,822,610.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,840,744.96

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
汇添富中证 800ETF 联接 A	798	24,385.87	14,654,152.01	75.30	4,805,773.03	24.70
汇添富中证 800ETF 联接 C	336	114,097.68	24,838,357.85	64.79	13,498,463.17	35.21
合计	1,134	50,967.15	39,492,509.86	68.33	18,304,236.20	31.67

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富中证 800ETF 联接 A	67,743.05	0.35
	汇添富中证 800ETF 联接 C	0.00	0.00
	合计	67,743.05	0.12

8.3 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	份额级别	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	汇添富中证 800ETF 联接 A	0
	汇添富中证 800ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 800ETF 联接 A	0
	汇添富中证 800ETF 联接 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 800ETF 联接 A	汇添富中证 800ETF 联接 C
基金合同生效日（2021 年 09 月 29 日）基金份额总额	165,303,587.03	127,871,337.69
本报告期期初基金份额总额	19,505,007.35	41,485,262.52
本报告期基金总申购份额	34,045,837.17	49,656,288.41
减：本报告期基金总赎回份额	34,090,919.48	52,804,729.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	19,459,925.04	38,336,821.02

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊

普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
海通证券	2	19,034,399.04	100.00	9,923.11	100.00	
东方证券	2	-	-	-	-	
广发证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
兴业证券	3	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	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。

10.7.2 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	债券交易	债券回购交	权证交易	基金交易
---	------	-------	------	------

商名称			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 (%)
海通证券	2,002,610.00	100.00	-	-	-	-	43,530,718.50	100.00
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (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决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

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 1 家证券公司的 1 个交易单元:中信建投证券(北交所单元)。

10.8 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旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
2	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	公司网站	2023 年 03 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日

5	汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理变更公告	中证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 19 日
6	汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书(2023 年 5 月 22 日更新)	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	份额占比 (%)
机构	1	2023 年 6 月 28 日至 2023 年 6 月 30 日	-	22,153,300.84	-	22,153,300.84	38.33
	2	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	14,654,152.01	-	-	14,654,152.01	25.35
	3	2023 年 3 月 30 日至 2023 年 4 月 6 日	-	11,684,724.88	11,684,724.88	-	-
	4	2023 年 1 月 1 日至	13,508,751.75	-	13,508,751.75	-	-

	2023 年 1 月 30 日					
5	2023 年 1 月 31 日至 2023 年 3 月 29 日, 202 3 年 4 月 7 日 至 2023 年 4 月 18 日	8,512,486.14	-	8,512,486.14	-	-
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、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、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>4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、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>						

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

- 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 800 交易型开放式指数证券投资基金联接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。

12.2 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

12.3 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

2023 年 08 月 31 日