

# 汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2024 年 03 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现 .....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§ 4 管理人报告 .....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	20
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.....	22
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	23
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	24
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	25
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	25
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	25
§ 5 托管人报告 .....	25
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	25
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.....	26
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	26
§ 6 审计报告 .....	26
6.1 审计报告的基本信息.....	26
6.2 审计报告的基本内容.....	26
§ 7 年度财务报表.....	28
7.1 资产负债表 .....	28
7.2 利润表 .....	29
7.3 净资产变动表 .....	30
7.4 报表附注 .....	32
§ 8 投资组合报告.....	110
8.1 期末基金资产组合情况.....	110
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	111
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	112

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	137
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	138
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	139
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	139
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	139
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	139
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	139
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	139
8.12 投资组合报告附注.....	139
§ 9 基金份额持有人信息.....	141
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	141
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	142
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	142
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	143
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	143
9.6 发起式基金发起资金持有份额情况.....	143
§ 10 开放式基金份额变动.....	143
§ 11 重大事件揭示.....	144
11.1 基金份额持有人大会决议.....	144
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	144
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	144
11.4 基金投资策略的改变.....	144
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	144
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	144
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	144
11.8 其他重大事件.....	146
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	147
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	147
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	147
§ 13 备查文件目录.....	147
13.1 备查文件目录.....	147
13.2 存放地点.....	148
13.3 查阅方式.....	148

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 08 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	377,971,777.95	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）A	汇添富中证 500 指数（LOF）C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	253,598,367.28	124,373,410.67

注：汇添富中证 500 指数（LOF）A 类份额扩位证券简称：中证 500LOF；汇添富中证 500 指数（LOF）C 类份额扩位证券简称：中证 500LOFC。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数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，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争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%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、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 500 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，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，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	招商证券股份有限公司
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	95565
传真	021-28932998	0755-82960794
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码	200010	518000
法定代表人	李文	霍达

### 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据	2023年	2022年	2021年
---------------	-------	-------	-------

和 指 标						
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	-4,408,776 .25	-2,407,330 .19	790,198.32	39,923.12	41,518,266 .69	23,283,677 .95
本期利润	-13,623,53 0.76	-5,102,135 .53	-48,527,80 3.45	-26,010,02 2.76	38,618,346 .03	22,231,046 .42
加权平均基金份额本期利润	-0.0541	-0.0427	-0.2049	-0.2156	0.2147	0.2205
本期加权平均净值利润率	-4.87%	-3.91%	-17.97%	-19.11%	17.87%	18.53%
本期基金	-5.20%	-5.42%	-17.52%	-17.74%	20.61%	20.31%

份 额 净 值 增 长 率						
3.1 .2 期 末 数 据 和 指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期 末 可 供 分 配 利 润	7,574,786. 16	1,833,036. 64	22,209,765 .21	10,036,535 .53	64,296,842 .87	31,972,194 .71
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润	0.0299	0.0147	0.0864	0.0729	0.3172	0.3042
期 末 基 金 资 产 净 值	261,173,15 3.44	126,206,44 7.31	279,405,95 3.69	147,655,37 4.61	267,016,51 3.34	137,091,96 8.17



期末基金份额净值	1.0299	1.0147	1.0864	1.0729	1.3172	1.3042
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	2.99%	1.47%	8.64%	7.29%	31.72%	30.42%

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 500 指数 (LOF) A						
阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较基	业绩比较	①-③	②-④

	长率①	增长率标准差②	准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	-4.37%	0.82%	-4.36%	0.82%	-0.01%	0.00%
过去六个月	-8.25%	0.80%	-9.01%	0.81%	0.76%	-0.01%
过去一年	-5.20%	0.78%	-7.01%	0.78%	1.81%	0.00%
过去三年	-5.70%	1.02%	-13.83%	1.03%	8.13%	-0.01%
过去五年	54.34%	1.20%	29.29%	1.22%	25.05%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	2.99%	1.22%	-13.04%	1.24%	16.03%	-0.02%
汇添富中证 500 指数 (LOF) 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	-4.43%	0.82%	-4.36%	0.82%	-0.07%	0.00%
过去六个月	-8.36%	0.81%	-9.01%	0.81%	0.65%	0.00%
过去一年	-5.42%	0.78%	-7.01%	0.78%	1.59%	0.00%
过去三年	-6.39%	1.02%	-13.83%	1.03%	7.44%	-0.01%
过去五年	52.47%	1.20%	29.29%	1.22%	23.18%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	1.47%	1.22%	-13.04%	1.24%	14.51%	-0.02%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇添富中证500指数（LOF）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指数（LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

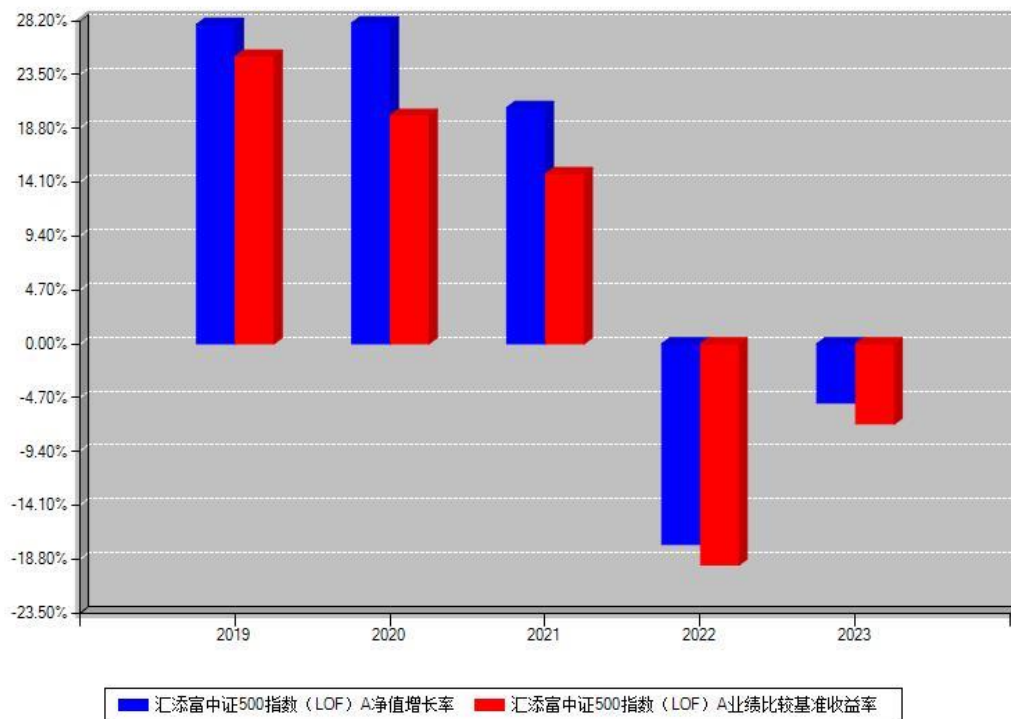


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年08月10日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

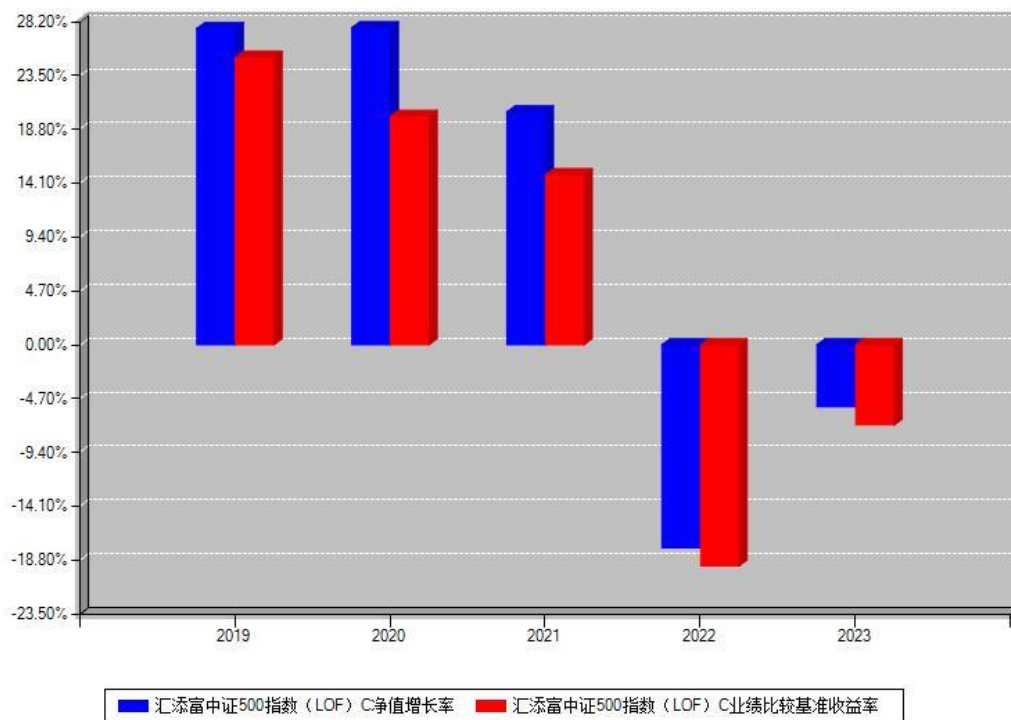
本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

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

汇添富中证500指数（LOF）A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数（LOF）C每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2017 年 08 月 10 日，合同生效当年按实际存续期计算，不

按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理(美国)控股有限公司、汇添富资产管理(新加坡)有限公司。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 年，汇添富基金新成立 48 只公募基金，包括 14 只混合型基金，21 只股票型基金，13 只债券型基金。2023 年底，公司公募基金产品总数达 318 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2023 年，汇添富基金坚持以“客户体验”为中心，以“创新”为宗旨，以“服务”为生命力，稳扎稳打实现互联网平台全方位发展。全年大力开拓投顾式销售及服务模式，持续提升自有平台创新能力。全面致力于基于买方视角下的投顾服务转型，提升客户投资的服务体验。通过打通公司投研端和销售端，实现资源共享最大化，为投顾转型提供更加充实的底层能力支持；同时针对客户端，通过投顾专区进行改版升级，优化投顾策略推荐逻辑，融入丰富的投资工具、工具使用场景和丰富的资讯、内容服务，提升客户投资体验，践行公司投

顾转型战略目标。

与此同时,积极拥抱第三方互联网基金销售平台,进一步加强与多家互联网巨头的深度合作。围绕客户需求,重构客户中心、资产中心、产品中心、内容中心、活动中心等,全面进行平台运营体系化建设。以开放、转型、服务、共享为目标,搭建以内容中台、营销运营中台、理财师中台、投顾中台等为主要模块的数字中台矩阵。坚持致力于为客户提供全生命周期服务,力争通过金融科技全流程赋能加持,进一步提升客户满意度。

2023 年,汇添富基金继续坚定推进与核心机构客户的合作战略,机构业务规模保持较好的增长势头。公司为机构投资者提供综合解决方案,并深受机构投资者信任。公司不断提升客户服务及产品运营能力,聚焦战略级机构客户,与银行及银行理财公司加快合作,保险规模维持市场领先地位。积极布局多只创新型品种,满足机构投资者专业化需求。养老金业务方面,公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格,也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展,受托管理组合账户数量持续增加。同时在数字化建设上开展系统平台建设,为客户及团队赋能。

2023 年渠道客户偏好低风险化、渠道运营线上线下一体化趋势愈加明显,公司持续深化核心渠道战略,始终秉持“客户第一”的价值观,围绕如何提升客户“获得感”,优化客户持有体验开展系列渠道服务和投资者教育工作。积极利用线上化数字营销工具,对客户进行分类经营和分层触达,建立精准的客户画像,提供标准化、体系化、专业化的客户陪伴。积极践行金融科技创新,搭建了一站式投研资讯服务平台,提供紧贴市场的专业投资服务,以及便捷高效的营销辅助工具,赋能渠道客户经理。全年合计开展超 8481 余场“价值投资添富行”线上、线下系列活动。大力开展走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列投资者教育活动,营销培训活动覆盖至各渠道分支机构。

2023 年是券商渠道业务服务深化的一年。为了更好地服务券商渠道客户,公司在 2023 年度组织了超过 2600 场的线上和线下投教、路演活动,主题包括 ETF 大讲堂、走进汇添富、基金经理面对面、投资策略报告会等,覆盖了各重点券商渠道的重点分支机构和营业部,旨在为一线投顾赋能的同时,也为广大投资者提供更全面的投资策略交流机会。此外,公司在重点券商渠道积极推广“指能添富”品牌和策略,并结合市场情况,为券商渠道提供相关 ETF 及指数增强产品的配置建议及以客户为中心的解决方案。

2023 年,汇添富基金继续提升客户服务能力,优化客户服务体系,为公司各项业务提供全方位支持。同时,持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设,丰富服务渠道,提升客户体验。

2023 年, 汇添富香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化, 并继续发挥显着成效, 国际业务总资产管理规模保持稳定。汇添富香港子公司发行汇添富美元货币市场基金, 进一步完善海外产品线布局, 涵盖境外权益、固收、货币类产品, 为投资者全球资产分散化布局进一步打下基础, “汇添富中港策略基金”保持国际权威基金评级机构晨星五星评级。从 2023 年年初开始, 继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通, 进一步完善个性化客户服务体系, 积极引导长期资金入市。

2023 年以来, 汇添富积极投身公益慈善, 充分发挥公募基金力量, 履行社会责任, 助力实现“共同富裕”。教育助学方面, 连续十五年开展“河流·孩子”公益助学项目, 组织党支部开展 9 场公益行活动, 约 300 名党员、员工、客户与合作伙伴成为公益志愿者, 相继回访了四川美姑、贵州黎平、云南怒江、青海互助、内蒙扎兰屯、宁夏泾源、广西百色、湖北恩施、湖南城步等中西部的添富小学, 开展学校调研、梦想课堂、学生走访。在上海成功举办“河流·孩子”十五周年公益音乐会及艺术夏令营, 帮助来自大山深处、偏远河畔的孩子们开阔眼界、增长见识、提升素养; 举办第十六期“河流·孩子”乡村优秀青年教师培训, 赋能了 80 位乡村优秀青年教师, 助力乡村教师掌握先进的教育理念与教学方法。金融慈善方面, 积极探索创新公益新模式, 在中国基金业协会的指导和支持下, 举办第二期、第三期“基业上善”慈善资产管理研修营, 三期累计已为 87 家基金会培养了 190 名慈善资产管理专业人才, 涵盖的慈善资产规模超过 148 亿元, 用专业力量推动我国公益慈善事业的可持续发展。参与中国慈善联合会《慈善组织投资管理指南》团体标准起草, 助力慈善资产管理的规范化和高质量发展。爱国拥军方面, 携手上海市拥军优属基金会开展“崇敬英雄”公益项目, 成为“爱国拥军支持单位”, 进一步服务国防建设及拥军优属事业。社区公益方面, 携手小东门街道开展南外滩健康直通车项目, 参与小东门社区公益发展专项基金, 支持本地社区建设, 共建更有温度的美好社区。乡村振兴方面, 参加云南、青海、内蒙古等地产业、教育和养老助老帮扶等项目, 深化东西部协作帮扶, 助力乡村振兴。

2024 年, 汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则, 进一步加强风险管理能力, 提升客户服务水平, 推动业务稳步发展, 为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助	证券从业年限	说明
----	----	--------------	--------	----

		理) 期限		(年)	
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2017 年 08 月 10 日	-	17	国籍: 中国。学历: 中国科学技术大学管理学博士。从业资格: 证券投资基金从业资格。从业经历: 曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理, 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



				<p>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</p>
--	--	--	--	--

				<p>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（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 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</p>
--	--	--	--	---

				<p>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 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 日至今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 日至今任汇添富中证 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</p>
--	--	--	--	---

					<p>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。</p> <p>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 日至今任汇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。</p>
--	--	--	--	--	--

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类

资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

相关的各个环节。

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

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

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 45 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2023 年，中国宏观经济整体呈现结构性复苏态势。经济趋势温和回暖，上半年节后复工复产加快，出行链持续修复，工业生产逐步复苏；下半年宏观调控组合政策发力显效，局部数据企稳回升，经济向好的态势得到延续。经济在结构上呈现新旧动能转换态势，消费和服务业、高端制造等对经济的贡献在上升，而地产、投资、出口的贡献在下降。政策方向上坚持高质量发展，宏观调控注重精准，维持流动性合理充裕，中央财政加杠杆和提高存量政策有效性等政策思路显现。海外方面，2023 年前三季度美债收益率和美元指数持续波动上涨，抑制全球风险资产表现；四季度美债利率见顶下行，美元指数走低，全球风险资产有所提振。

2023 年，资本市场先在经济复苏背景下显现出修复行情，但自二季度起开始震荡下行，四季度呈现成交收缩、情绪持续低迷的态势。全年市场整体震荡下行，行业和风格波动较大，各子行业和概念板块来看，AI 及中特估相关板块上涨较多，地产链及消费板块跌幅靠前；风格方面，红利风格表现优异，市场整体上仍呈现小盘优于大盘、价值优于成长的特性。量化选股因子方面，质量、低波动、低估值等逆向类因子以及交易类因子仍延续之前的较好表现，与此同时，成长、预期等因子整体表现一般。

政策层面看，10 月末召开了中央金融工作会议，12 月召开了中央经济工作会议。中央金融工作会议强调金融服务实体经济的定位，以提供高质量金融服务作为发展导向目标，提出全面加强金融监管防风险。中央经济工作会议提出当前风险隐患仍然较多，2024 年政策主基调需坚持稳中求进、以进促稳、先立后破。会议同时指出，积极的财政政策要适度加力、提质增效，稳健的货币政策要灵活适度、精准有效。

中证 500 指数是中小盘股票的代表性指数，指数具有很好的衍生品环境，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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 500 指数（LOF）A 类份额净值增长率为-5.20%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。本报告期汇添富中证 500 指数（LOF）C 类份额净值增长率为-5.42%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，高质量发展仍是时代主题，整体宏观经济以稳为主。调控效果预计在新的一年里逐步显现，三大工程相关的财政准财政支撑有望缓解地产的下滑困境，居民消费潜力仍有释放空间，这些因素有利于巩固经济回升态势。同时，随着海外通胀逐步得到控制，外部流动性有望边际宽松。经济结构性转型需要经历新旧动能切换，带来阶段性阵痛，居民就业及收入预期改善需要时间。政策基调在最近一次中央经济工作会议上明确为偏积极，有望促进市场信心稳定，加快转型出清。

从政策预期来看，财政准财政政策可能成为托底经济的主导力量，同时货币政策提供适度的流动性支持，降准降息存在一定空间，总体仍然是稳总量重结构，强调政策的精准有效。

尽管资本市场目前仍面临对经济信心不足、财富效应收缩的问题，A 股市场估值处于历史分位点极低状态，中长期有较好的投资价值，短期角度，一旦投资者情绪发生改善，也将有较好的交易机会。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，

积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

##### 1、持续提升合规法务管理

公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的公司价值观，完善合规管理体系，提升专业能力，优化合规资源配置，不断提升合规管理工作的有效性。公司坚持广泛开展合规培训、强化从业人员合规意识，不断夯实公司合规文化体系基础；持续完善公司制度流程体系、优化合规管理制度机制，通过统一的合规审核标准、动态调整的合规管理指引，有效把控各类业务的合规关键点，防范潜在风险，保障各项业务规范开展；深入细致开展合规审查工作，为各部门提供有效的合规咨询与法务支持，督促强化一线合规执行效果；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；优化从业人员管理机制，加强管理措施，严格执行合规考核问责机制，引导全体员工不断提升合规执业意识，强化公司合规履职保障。

##### 2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品的设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

##### 3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报告与监督；通过协调并协助监管机构、第三方独立机构开展各项自查、核查以及审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过对各项检查、审计发现的风险隐患的整改情况进行跟踪检查，持续优化内控管理水平，切实维护基金持有人利益，促进公司持续、稳定、



健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利自动转为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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2024)审字第 70015647_B81 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF),并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对

	<p>其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并</p>

	评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	许培菁	韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层	
审计报告日期	2024年03月27日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	7.4.7.1	21,735,448.98	23,910,410.75
结算备付金		3,695,664.48	5,793,342.16
存出保证金		940,208.57	1,151,715.37
交易性金融资产	7.4.7.2	361,233,564.12	396,763,584.76
其中: 股票投资		357,976,156.00	393,096,493.34
基金投资		-	-
债券投资		3,257,408.12	3,667,091.42
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		184.33	-
应收股利		-	-
应收申购款		990,047.40	1,395,745.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	21,082.85	14,255.12
资产总计		388,616,200.73	429,029,053.70
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>

<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	13.18
应付赎回款		749,245.11	1,411,087.61
应付管理人报酬		165,024.34	179,978.11
应付托管费		33,004.88	35,995.60
应付销售服务费		21,643.35	30,199.37
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,297.61	1,582.55
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	265,384.69	308,868.98
负债合计		1,236,599.98	1,967,725.40
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.8	377,971,777.95	394,815,027.56
未分配利润	7.4.7.9	9,407,822.80	32,246,300.74
净资产合计		387,379,600.75	427,061,328.30
负债和净资产总计		388,616,200.73	429,029,053.70

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 377,971,777.95 份。本基金下属汇添富中证 500 指数 (LOF) A 基金份额净值 1.0299 元，基金份额总额 253,598,367.28 份；本基金下属汇添富中证 500 指数 (LOF) C 基金份额净值 1.0147 元，基金份额总额 124,373,410.67 份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-15,685,701.23</b>	<b>-71,509,570.49</b>
1. 利息收入		1,168,969.77	1,167,197.51
其中：存款利息收入	7.4.7.10	324,251.78	441,168.41
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		844,717.99	726,029.10

2. 投资收益 (损失以“-”填列)		-4,951,673.61	2,645,553.58
其中: 股票投资收益	7.4.7.11	-10,690,060.63	-2,957,841.91
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	103,516.29	98,192.98
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-509,885.29	-1,152,086.84
股利收益	7.4.7.17	6,144,756.02	6,657,289.35
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-11,909,559.85	-75,367,947.65
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.19	6,562.46	45,626.07
<b>减: 二、营业总支出</b>		<b>3,039,965.06</b>	<b>3,028,255.72</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,055,016.83	2,024,780.35
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	411,003.35	404,956.00
3. 销售服务费		310,928.18	339,405.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		4,709.83	2,615.61
8. 其他费用	7.4.7.21	258,306.87	256,498.18
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-18,725,666.29</b>	<b>-74,537,826.21</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-18,725,666.29</b>	<b>-74,537,826.21</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-18,725,666.29</b>	<b>-74,537,826.21</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体: 汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	394,815,027.56	32,246,300.74	427,061,328.30
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	394,815,027.56	32,246,300.74	427,061,328.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,843,249.61	-22,838,477.94	-39,681,727.55
（一）、综合收益总额	-	-18,725,666.29	-18,725,666.29
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-16,843,249.61	-4,112,811.65	-20,956,061.26
其中：1. 基金申购款	278,936,394.56	28,000,662.18	306,937,056.74
2. 基金赎回款	-295,779,644.17	-32,113,473.83	-327,893,118.00
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	377,971,777.95	9,407,822.80	387,379,600.75
项目	上年度可比期间		
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	307,839,443.93	96,269,037.58	404,108,481.51
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	307,839,443.93	96,269,037.58	404,108,481.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	86,975,583.63	-64,022,736.84	22,952,846.79
（一）、综合收益总额	-	-74,537,826.21	-74,537,826.21
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	86,975,583.63	10,515,089.37	97,490,673.00

(净资产减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	465,926,882.29	63,153,977.84	529,080,860.13
2. 基金赎回款	-378,951,298.66	-52,638,888.47	-431,590,187.13
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	394,815,027.56	32,246,300.74	427,061,328.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) (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[2017]770 号文《关于准予汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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 2017 年 8 月 10 日生效。首次设立基金募集规模为 735,804,689.63 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 (2017) 验字第 60466941\_B29 号验资报告予以验证。本基金为上市契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金的标的指数为中证 500 指数。本基金主要投资于标的指数成份股、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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、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)、中小企业私募债券等)、



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、权证、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)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及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:本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;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合计不低于基金资产净值的 5%,本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。本基金进行被动式指数化投资,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 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加

但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果初始确认后发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照摊余成本和实际利率计算利息收入;

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础,通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险,以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况;

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括:通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值,以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息;

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时,该金融资产成为已发生信用减值的金融资产;

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债),按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转

移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最小层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执

行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用,计入投资收益;

债券投资和资产支持证券投资持有期间,按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益,在证券实际持有期内逐日计提;

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认,并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账,同时转出已确认的公允价值变动收益;

(3)股利收益于除息日确认,并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账;

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认,并按处置衍生工具成交金额与其成本的差

额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账, 同时转出已确认的公允价值变动收益;

(5) 买入返售金融资产收入, 按实际利率法确认利息收入, 在回购期内逐日计提;

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额, 在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息, 实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入;

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则, 在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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;

2、本基金收益分配方式分两种: 现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额, 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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额, 只能选择现金分红的方式, 具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

3、同一类别内每一基金份额享有同等分配权;

4、法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下, 基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整, 并及时公告。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

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

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

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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	21,735,448.98	23,910,410.75
等于：本金	21,725,761.18	23,900,800.03
加：应计利息	9,687.80	9,610.72
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	21,735,448.98	23,910,410.75

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		413,230,471.16	-	357,976,156.00	-55,254,315.16
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,179,520.00	53,590.22	3,257,408.12	24,297.90
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	3,179,520.00	53,590.22	3,257,408.12	24,297.90
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		416,409,991.16	53,590.22	361,233,564.12	-55,230,017.26
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票		436,283,380.75	-	393,096,493.34	-43,186,887.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,613,740.00	63,881.42	3,667,091.42	-10,530.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	3,613,740.00	63,881.42	3,667,091.42	-10,530.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		439,897,120.75	63,881.42	396,763,584.76	-43,197,417.41

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
(国债期货投	-	-	-	-

资)				
货币衍生工具	-	-	-	-
(外汇期货投 资)	-	-	-	-
权益衍生工具	6,514,280.00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投 资)	6,514,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,514,280.00	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
(国债期货投 资)	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
(外汇期货投 资)	-	-	-	-
权益衍生工具	7,168,680.00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投 资)	7,168,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,168,680.00	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2401	IC2401	6	6,524,160.00	9,880.00
合计				9,880.00
减: 可抵销期货暂收款				9,880.00
净额				-

注: 在当日无负债结算制度下, 结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益, 则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注: 本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注: 本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注: 本基金无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注: 本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 7.4.7.6 其他资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	21,082.85	14,255.12
待摊费用	-	-
合计	21,082.85	14,255.12

#### 7.4.7.7 其他负债

单位: 人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	75,639.76	117,854.99
其中：交易所市场	75,639.76	117,854.99
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	50,000.00	50,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	19,744.93	21,013.99
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	-	-
应付持有人大会费-律师费	-	-
应付或有管理费	-	-
其他	-	-
合计	265,384.69	308,868.98

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	257,196,188.48	257,196,188.48
本期申购	89,212,899.64	89,212,899.64
本期赎回 (以“-”号填列)	-92,810,720.84	-92,810,720.84
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	253,598,367.28	253,598,367.28
汇添富中证 500 指数 (LOF) C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	137,618,839.08	137,618,839.08
本期申购	189,723,494.92	189,723,494.92
本期赎回 (以“-”号填列)	-202,968,923.33	-202,968,923.33

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	124,373,410.67	124,373,410.67

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	84,379,922.26	-62,170,157.05	22,209,765.21
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	84,379,922.26	-62,170,157.05	22,209,765.21
本期利润	-4,408,776.25	-9,214,754.51	-13,623,530.76
本期基金份额交易产生的变动数	-1,196,969.14	185,520.85	-1,011,448.29
其中：基金申购款	28,798,415.97	-17,971,926.35	10,826,489.62
基金赎回款	-29,995,385.11	18,157,447.20	-11,837,937.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,774,176.87	-71,199,390.71	7,574,786.16
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,023,293.05	-32,986,757.52	10,036,535.53
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	43,023,293.05	-32,986,757.52	10,036,535.53
本期利润	-2,407,330.19	-2,694,805.34	-5,102,135.53
本期基金份额交易产生的变动数	-4,197,515.65	1,096,152.29	-3,101,363.36
其中：基金申购款	58,071,787.34	-40,897,614.78	17,174,172.56
基金赎回款	-62,269,302.99	41,993,767.07	-20,275,535.92

本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,418,447.21	-34,585,410.57	1,833,036.64

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	258,122.90	339,437.31
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	64,389.66	98,676.82
其他	1,739.22	3,054.28
合计	324,251.78	441,168.41

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,690,060.63	-2,957,841.91
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-10,690,060.63	-2,957,841.91

##### 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	161,014,813.21	153,752,319.30
减：卖出股票成本总额	171,331,972.08	156,216,248.31
减：交易费用	372,901.76	493,912.90

买卖股票差价收入	-10,690,060.63	-2,957,841.91
----------	----------------	---------------

#### 7.4.7.11.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比区间均无证券出借差价收入。

#### 7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	132,769.29	44,512.11
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-29,253.00	53,680.87
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	103,516.29	98,192.98

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	16,438,650.00	354,076.16
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	16,129,253.00	297,676.00
减：应计利息总额	338,650.00	2,709.07
减：交易费用	-	10.22
买卖债券差价收入	-29,253.00	53,680.87

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。



#### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-509,885.29	-1,152,086.84
外汇远期投资收益	-	-
外汇期货投资收益	-	-
国债期货投资收益	-	-

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,144,756.02	6,657,289.35
其中：证券出借权益补偿收入	417,181.21	726,899.34
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,144,756.02	6,657,289.35

#### 7.4.7.18 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-12,032,599.85	-75,093,947.65
——股票投资	-12,067,427.75	-75,077,046.45
——债券投资	34,827.90	-16,901.20
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	123,040.00	-274,000.00

——权证投资	-	-
——期货投资	123,040.00	-274,000.00
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	-11,909,559.85	-75,367,947.65

#### 7.4.7.19 其他收入

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 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	6,562.46	45,626.07
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	6,562.46	45,626.07

#### 7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	5,914.17	5,407.58
指数使用费	82,200.70	80,991.17
持有人大会-公证费	-	-
持有人大会-律师费	-	-
开户费	-	-
上市费	-	-
或有管理费	-	-
其他	192.00	99.43
合计	258,306.87	256,498.18

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日, 本基金无需要披露的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日, 本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金发起人
招商证券股份有限公司 (“招商证券”)	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
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (新加坡) 有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

注: 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
招商证券	300,420,058.42	100.00	400,108,476.62	100.00

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
招商证券	15,618,033.00	100.00	3,855,220.16	100.00

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
招商证券	218,511.20	100.00	75,639.76	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
招商证券	287,960.91	100.00	117,854.99	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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,055,016.83	2,024,780.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	634,740.39	600,071.64
应支付基金管理人的净管理费	1,420,276.44	1,424,708.71

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 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,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	411,003.35	404,956.00

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 3 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,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
招商证券股份 有限公司	-	254.78	254.78
东方证券股份	-	11,542.98	11,542.98

有限公司			
汇添富基金管理股份有限公司	-	54,003.16	54,003.16
合计	-	65,800.92	65,800.92
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
招商证券股份有限公司	-	325.40	325.40
东方证券股份有限公司	-	12,697.28	12,697.28
汇添富基金管理股份有限公司	-	61,139.36	61,139.36
合计	-	74,162.04	74,162.04

注：自 2023 年 9 月 26 日起，本基金 C 类基金份额销售服务费率由 0.25%/年下调为 0.20%/年。

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 0.20%。

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 0.20% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计算，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销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	485,594.00	321.03	-	-
东方证券	1,013,232.00	833.46	-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	40,650,341.00	28,022.92	469,650.00	113.99
招商证券	5,017,204.00	3,345.08	-	-

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

单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	23,633,148.00	1.00~3.90	1.95	18,829.97	469,842.00	155.99
招商证券	643,524.00	1.70~3.60	3.32	832.83	14,040.00	9.21
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	21,428,932.00	3.40~3.60	3.41	28,600.94	-	-
招商证券	3,461,530.00	3.50~4.00	3.88	5,389.69	-	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额，本报告期及上年度可比期间均未有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 股)	总金额
东方证券承销保荐有限公司	688347	华虹公司	IPO 网下配售	14,397.00	748,644.00
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 股)	总金额
				-	-

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

#### 7.4.12 期末 (2023 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301172	君	2023	6	新	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	



	逸 数 码	年 07 月 19 日	个 月	股 流 通 受 限						
301202	朗 威 股 份	2023 年 06 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	
301251	威 尔 高	2023 年 08 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	
301261	恒 工 精 密	2023 年 06 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	
301272	英 华 特	2023 年 07 月 06 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	
301292	海 科 新 源	2023 年 06 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	
301329	信 音 电 子	2023 年 07 月 05 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	
301348	蓝 箭 电	2023 年 08 月 01	6 个 月	新 股 流	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	

	子	日		通					
301393	昊帆生物	2023年07月05日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	160	10,828.80	9,499.20
301421	波长光电	2023年08月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84
301456	盘古智能	2023年07月06日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	329	12,488.84	9,998.31
301468	博盈特焊	2023年07月12日	6个月	新股流通受限	47.58	30.22	375	17,842.50	11,332.50
301469	恒达新材	2023年08月10日	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75
301487	盟固利	2023年08月01日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股流通受	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58

				限						
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	
301498	乖宝宠物	2023年08月09日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	266	10,637.34	10,323.46	
301499	维科精密	2023年07月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	
301500	飞南资源	2023年09月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	
301505	苏州规划	2023年07月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	
301507	民生健康	2023年08月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	
301509	金凯生科	2023年07月26日	6个月	新股流通受限	56.56	62.23	228	12,895.68	14,188.44	
301510	固	2023	6	新	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	

	高科技	年08月04日	个月	股流通受限						
301511	德福科技	2023年08月08日	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	482	13,496.00	10,926.94	
301517	陕西华达	2023年10月09日	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	
301519	舜禹股份	2023年07月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	
301525	儒竞科技	2023年08月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	113	11,251.41	9,204.98	
301528	多浦乐	2023年08月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	
301529	福赛科技	2023年08月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	
301533	威马农	2023年08月07日	6个月	新股流	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	

	机	日		通受限						
301548	崇德科技	2023年09月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	
301550	斯菱股份	2023年09月06日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	
301559	中集环科	2023年09月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	459	11,116.98	8,372.16	
603075	热威科技股份	2023年09月01日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	
603193	润本生物技术股份	2023年10月09日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	267	4,640.46	4,448.22	
603270	金帝精密科技股份	2023年08月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	
603273	天	2023	6	新	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	

	元智能	年10月16日	个月	股流通受限						
603275	上海众辰科技	2023年08月16日	6个月	新股流通受限	49.97	39.70	135	6,745.95	5,359.50	
603276	恒兴新材料科技	2023年09月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	
603296	华勤技术	2023年08月01日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	174	14,059.20	13,528.50	
688347	华虹半导体公司	2023年07月27日	6个月	新股流通受限	52.00	42.06	10,078	524,056.00	423,880.68	
688450	光格科技	2023年07月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	
688548	广钢气体股份	2023年08月08日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	1,665	16,433.55	21,228.75	
688549	中	2023	6	新	5.18	8.09	2,293	11,877.74	18,550.37	

	巨芯科技	年 08 月 30 日	个月	股流通受限						
688563	航空材料股份	2023 年 07 月 12 日	6 个月	新股流通受限	78.99	60.49	301	23,775.99	18,207.49	
688573	信宇人	2023 年 08 月 09 日	6 个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	
688582	芯动联科	2023 年 06 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	38.67	467	12,487.58	18,058.89	
688591	泰凌微	2023 年 08 月 18 日	6 个月	新股流通受限	24.98	28.02	549	13,714.02	15,382.98	
688627	精智达技术	2023 年 07 月 11 日	6 个月	新股流通受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	
688657	浩辰软件	2023 年 09 月 25 日	6 个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	
688671	碧兴物	2023 年 08 月 02 日	6 个月	新股流	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	

	联	日		通受限						
688693	锆威特	2023年08月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	
688716	中研股份	2023年09月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	
688719	爱科赛博	2023年09月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	162	11,336.76	9,736.20	

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年08月30日	重大事項停	0.01		-	283,500	738,496.28	2,835.00	



			牌						
--	--	--	---	--	--	--	--	--	--

注：截止 2023 年 12 月 31 日，本基金合计持有中天 3（在深圳证券交易所退市时的股票简称为\*ST 中天，证券代码为 000540）283,500 股。根据中天金融集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 6 月 29 日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市暨摘牌的公告》，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。

于 2023 年 6 月 17 日起，为维护基金持有人利益，根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定，依据中天金融集团股份有限公司公开披露的信息，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，将本基金所持有\*ST 中天（000540.SZ）按每股 0.01 元人民币估值。

根据公司于 2023 年 8 月 28 日发布的《中天金融集团股份有限公司股票转让公告》，公司可在全国中小企业股份转让系统有限责任公司依托原证券公司代办股份转让系统设立并代为管理的两网公司及退市公司板块（以下简称“退市板块”）转让仅限于原在深圳证券交易所（以下简称“深交所”）挂牌交易的流通股份，确权代码（即挂牌退市板块后的股票代码）：400174，开始转让日为 2023 年 8 月 30 日。根据公司于同日发布的《中天金融集团股份有限公司关于公司股票挂牌当日即暂停转让的公告》，因公司正在进行重整事项，经向全国股转公司申请，公司股票自 2023 年 8 月 30 日起暂停转让。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额

		称						
1	300502	新易盛	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 10 日	49.32	11,000	542,520.00
2	300418	昆仑万维	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	37.40	14,000	523,600.00
3	600157	永泰能源	2024 年 01 月 09 日	-	2024 年 01 月 09 日	1.37	370,000	506,900.00
4	000988	华工科技	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	29.76	16,700	496,992.00
5	000975	银泰黄金	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 10 日	15.00	32,000	480,000.00
6	600418	江淮汽车	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	16.15	28,400	458,660.00
7	601058	赛轮轮胎	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	11.75	38,600	453,550.00
8	601168	西部矿业	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 12 日	14.27	31,500	449,505.00
9	301236	软通动力	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 10 日	46.20	9,000	415,800.00
10	002517	恺英网络	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 12 日	11.17	35,100	392,067.00
11	300394	天孚通	2024 年 01 月 08	-	2024 年 01 月 12	91.52	4,000	366,080.00

		信	日	日				
12	002422	科伦药业	2024年01月02日	-	2024年01月02日	29.05	12,000	348,600.00
13	603596	伯特利	2024年01月08日	-	2024年01月08日	69.30	5,000	346,500.00
14	600415	小商品城	2024年01月02日	-	2024年01月08日	7.32	46,000	336,720.00
15	002273	水晶光电	2024年01月02日	-	2024年01月03日	13.54	24,000	324,960.00
16	002532	天山铝业	2024年01月03日	-	2024年01月08日	6.01	54,000	324,540.00
17	002600	领益智造	2024年01月03日	-	2024年01月03日	6.76	48,000	324,480.00
18	000066	中国长城	2024年01月08日	-	2024年01月08日	10.12	32,000	323,840.00
19	300017	网宿科技	2024年01月08日	-	2024年01月12日	7.85	40,000	314,000.00
20	300136	信维通信	2024年01月08日	-	2024年01月08日	23.60	13,300	313,880.00
21	002156	通富微电	2024年01月02日	-	2024年01月08日	23.12	13,500	312,120.00
22	600839	四川长虹	2024年01月02日	-	2024年01月10日	5.29	59,000	312,110.00

		虹	日	日				
23	600536	中国软件	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	36.26	8,600	311,836.00
24	600155	华创云信	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 10 日	8.34	37,000	308,580.00
25	600177	雅戈尔	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	6.55	47,000	307,850.00
26	002463	沪电股份	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 10 日	22.12	13,800	305,256.00
27	600096	云天化	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 10 日	15.60	19,400	302,640.00
28	300058	蓝色光标	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	7.18	41,000	294,380.00
29	002607	中公教育	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 08 日	4.08	72,000	293,760.00
30	002195	岩山科技	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 10 日	3.07	95,400	292,878.00
31	002739	万达电影	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 09 日	13.02	22,000	286,440.00
32	603816	顾家家居	2024 年 01 月 05 日	-	2024 年 01 月 05 日	35.00	8,000	280,000.00
33	000831	中国稀	2024 年 01 月 02	-	2024 年 01 月 02	27.67	10,000	276,700.00

		土	日	日				
34	688728	格科微有限公司	2024年01月02日	-	2024年01月02日	20.47	13,000	266,110.00
35	601666	平煤股份	2024年01月03日	-	2024年01月08日	11.56	23,000	265,880.00
36	300866	安克创新	2024年01月02日	-	2024年01月12日	88.60	3,000	265,800.00
37	300118	东方日升	2024年01月08日	-	2024年01月10日	17.65	14,900	262,985.00
38	688390	固德威电源	2024年01月02日	-	2024年01月02日	130.58	2,000	261,160.00
39	603688	石英股份	2024年01月10日	-	2024年01月10日	86.88	3,000	260,640.00
40	002131	利欧股份	2024年01月02日	-	2024年01月10日	2.28	113,500	258,780.00
41	603000	人民网	2024年01月02日	-	2024年01月03日	27.98	9,200	257,416.00
42	603606	东方电缆	2024年01月02日	-	2024年01月08日	42.75	6,000	256,500.00
43	002558	巨人网	2024年01月09日	-	2024年01月09日	11.14	23,000	256,220.00

		络	日	日				
44	300699	光威复材	2024年01月08日	-	2024年01月12日	26.67	9,600	256,032.00
45	600879	航天电子	2024年01月02日	-	2024年01月12日	7.71	33,000	254,430.00
46	600486	扬农化工	2024年01月03日	-	2024年01月03日	63.12	4,000	252,480.00
47	000683	远兴能源	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.87	43,000	252,410.00
48	600499	科达制造	2024年01月02日	-	2024年01月12日	10.55	23,900	252,145.00
49	000629	钒钛股份	2024年01月02日	-	2024年01月08日	3.28	76,000	249,280.00
50	603077	和邦生物	2024年01月02日	-	2024年01月03日	2.36	105,600	249,216.00
51	600143	金发科技	2024年01月08日	-	2024年01月08日	7.99	31,000	247,690.00
52	601997	贵阳银行	2024年01月03日	-	2024年01月03日	5.14	48,000	246,720.00
53	605358	立昂微	2024年01月02日	-	2024年01月02日	27.39	9,000	246,510.00
54	002152	广电运	2024年01月03日	-	2024年01月03日	12.26	20,000	245,200.00

		通	日	日			
55	000039	中集集团	2024年01月02日	- 2024年01月02日	7.65	32,000	244,800.00
56	000021	深科技	2024年01月02日	- 2024年01月12日	16.21	15,000	243,150.00
57	688772	珠海冠宇电池	2024年01月02日	- 2024年01月02日	22.01	11,000	242,110.00
58	600516	方大炭素	2024年01月02日	- 2024年01月08日	5.24	46,000	241,040.00
59	300024	机器人	2024年01月02日	- 2024年01月10日	11.87	20,000	237,400.00
60	600895	张江高科	2024年01月02日	- 2024年01月03日	19.30	12,300	237,390.00
61	600399	抚顺特钢	2024年01月03日	- 2024年01月03日	9.72	24,000	233,280.00
62	300383	光环新网	2024年01月08日	- 2024年01月08日	9.72	24,000	233,280.00
63	600118	中国卫星	2024年01月02日	- 2024年01月02日	25.82	9,000	232,380.00
64	601966	玲珑轮胎	2024年01月02日	- 2024年01月08日	19.23	12,000	230,760.00
65	000623	吉	2024	- 2024	15.14	15,100	228,614.00

		林 敖 东	年 01 月 02 日	-	年 01 月 08 日			
66	000997	新 大 陆	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	19.61	11,600	227,476.00
67	600988	赤 峰 黄 金	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 10 日	14.01	16,200	226,962.00
68	002203	海 亮 股 份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	11.15	20,000	223,000.00
69	300748	金 力 永 磁	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	20.22	11,000	222,420.00
70	600673	东 阳 光	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	7.33	30,000	219,900.00
71	600141	兴 发 集 团	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 08 日	18.25	12,000	219,000.00
72	600998	九 州 通	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	7.01	31,040	217,590.40
73	300487	蓝 晓 科 技	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	53.06	4,000	212,240.00
74	002429	兆 驰 股 份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	5.58	38,000	212,040.00
75	688220	翱 捷 科 技	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	70.44	3,000	211,320.00
76	600435	北	2024	-	2024	11.74	18,000	211,320.00



		方 导 航	年 01 月 02 日	年 01 月 03 日			
77	002506	协 鑫 集 成	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 10 日	2.74	76,900	210,706.00
78	600863	内 蒙 华 电	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	3.90	54,000	210,600.00
79	601216	君 正 集 团	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 08 日	3.74	55,800	208,692.00
80	600398	海 澜 之 家	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 08 日	7.42	28,000	207,760.00
81	689009	九 号 公 司	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 10 日	29.66	7,000	207,620.00
82	600859	王 府 井	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	15.97	13,000	207,610.00
83	002368	太 极 股 份	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 08 日	29.53	7,000	206,710.00
84	300253	卫 宁 健 康	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 08 日	7.19	28,700	206,353.00
85	601456	国 联 证 券	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	10.84	19,000	205,960.00
86	002465	海 格 通 信	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 10 日	12.85	16,000	205,600.00
87	600655	豫	2024	- 2024	6.21	33,000	204,930.00

		园股份	年 01 月 10 日	-	年 01 月 10 日			
88	000636	风华高科	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	13.66	15,000	204,900.00
89	603338	浙江鼎力	2024 年 01 月 10 日	-	2024 年 01 月 10 日	51.17	4,000	204,680.00
90	600008	首创环保	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	2.69	76,000	204,440.00
91	002268	电科网安	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 08 日	22.46	9,000	202,140.00
92	300474	景嘉微	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	70.71	2,800	197,988.00
93	000519	中兵红箭	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	14.04	14,000	196,560.00
94	600282	南钢股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	3.70	53,000	196,100.00
95	300251	光线传媒	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 08 日	8.15	24,000	195,600.00
96	600021	上海电力	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	8.46	23,000	194,580.00
97	002850	科达利	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	84.46	2,300	194,258.00
98	601016	节能	2024	-	2024	3.00	64,000	192,000.00

		能 风 电	年 01 月 02 日	-	年 01 月 12 日			
99	601128	常 熟 银 行	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	6.39	30,000	191,700.00
100	300212	易 华 录	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	31.45	6,000	188,700.00
101	601880	辽 港 股 份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	1.45	130,000	188,500.00
102	002372	伟 星 新 材	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	14.47	13,000	188,110.00
103	603225	新 凤 鸣	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	14.20	13,000	184,600.00
104	603939	益 丰 药 房	2024 年 01 月 10 日	-	2024 年 01 月 12 日	40.04	4,600	184,184.00
105	300373	扬 杰 科 技	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 08 日	36.70	5,000	183,500.00
106	000547	航 天 发 展	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	8.37	21,800	182,466.00
107	600271	航 天 信 息	2024 年 01 月 10 日	-	2024 年 01 月 10 日	10.64	17,000	180,880.00
108	603885	吉 祥 航 空	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	12.00	15,000	180,000.00
109	002670	国	2024	-	2024	9.32	19,000	177,080.00

		盛金控	年 01 月 12 日	-	年 01 月 12 日			
110	002080	中材科技	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 08 日	15.92	11,000	175,120.00
111	688114	华大智造	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 08 日	86.02	2,000	172,040.00
112	002281	光迅科技	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 08 日	28.50	6,000	171,000.00
113	300088	长信科技	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	6.69	25,500	170,595.00
114	002831	裕同科技	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 10 日	27.51	6,200	170,562.00
115	601179	中国西电	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 08 日	4.93	34,000	167,620.00
116	002385	大北农	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	5.96	28,100	167,476.00
117	000970	中科三环	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	10.35	16,000	165,600.00
118	300677	英科医疗	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	23.36	7,000	163,520.00
119	002192	融捷股份	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	54.21	3,000	162,630.00
120	002531	天	2024	-	2024	11.60	14,000	162,400.00

		顺 风 能	年 01 月 03 日	年 01 月 10 日			
121	300026	红 日 药 业	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 08 日	4.24	38,000	161,120.00
122	600481	双 良 节 能	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	8.46	19,000	160,740.00
123	002487	大 金 重 工	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 10 日	26.62	6,000	159,720.00
124	002572	索 菲 亚	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 10 日	15.95	10,000	159,500.00
125	000155	川 能 动 力	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	13.29	12,000	159,480.00
126	688005	容 百 科 技	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	39.80	4,000	159,200.00
127	601866	中 远 海 发	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 03 日	2.34	68,000	159,120.00
128	000887	中 鼎 股 份	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 03 日	12.37	12,800	158,336.00
129	600959	江 苏 有 线	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 03 日	3.14	49,700	156,058.00
130	600707	彩 虹 股 份	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 08 日	6.75	23,000	155,250.00
131	688385	复	2024	- 2024	38.63	4,000	154,520.00

		旦 微 电	年 01 月 02 日	年 01 月 08 日			
132	601958	金 铂 股 份	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	9.45	16,300	154,035.00
133	000739	普 洛 药 业	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	15.39	10,000	153,900.00
134	002244	滨 江 集 团	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 08 日	7.27	21,000	152,670.00
135	002683	广 东 宏 大	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 08 日	20.08	7,600	152,608.00
136	000630	铜 陵 有 色	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	3.28	46,000	150,880.00
137	002223	鱼 跃 医 疗	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	34.58	4,300	148,694.00
138	600995	南 网 储 能	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	9.86	15,000	147,900.00
139	300682	朗 新 科 技	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	16.39	9,000	147,510.00
140	000709	河 钢 股 份	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 08 日	2.13	69,000	146,970.00
141	002373	千 方 科 技	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 03 日	11.21	13,100	146,851.00
142	688536	思	2024	- 2024	146.30	1,000	146,300.00

		瑞浦股份	年 01 月 03 日	年 01 月 03 日			
143	600373	中文传媒	2024 年 01 月 04 日	- 2024 年 01 月 10 日	13.18	11,000	144,980.00
144	000703	恒逸石化	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	6.72	21,500	144,480.00
145	603737	三棵树	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 08 日	47.61	3,000	142,830.00
146	300438	鹏辉能源	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 12 日	28.29	5,000	141,450.00
147	002326	永太科技	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 10 日	11.62	12,000	139,440.00
148	600056	中国医药	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 03 日	11.17	12,200	136,274.00
149	600901	江苏金租	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 08 日	4.84	28,000	135,520.00
150	600517	国网英大	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	4.77	28,000	133,560.00
151	603650	彤程新材	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 08 日	33.30	4,000	133,200.00
152	600801	华新水泥	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	12.43	10,700	133,001.00

153	688234	天岳先进	2024年01月03日	-	2024年01月08日	66.07	2,000	132,140.00
154	601992	金隅集团	2024年01月02日	-	2024年01月10日	1.91	68,900	131,599.00
155	003035	南网能源	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.26	25,000	131,500.00
156	600062	华润双鹤	2024年01月03日	-	2024年01月08日	18.60	7,000	130,200.00
157	601106	中国一重	2024年01月02日	-	2024年01月02日	2.88	45,000	129,600.00
158	000937	冀中能源	2024年01月02日	-	2024年01月08日	7.14	18,000	128,520.00
159	300114	中航电测	2024年01月09日	-	2024年01月12日	43.75	2,900	126,875.00
160	603893	瑞芯微	2024年01月03日	-	2024年01月03日	63.40	2,000	126,800.00
161	002408	齐翔腾达	2024年01月03日	-	2024年01月08日	5.28	24,000	126,720.00
162	002926	华西证券	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.76	16,300	126,488.00
163	600871	石化油服	2024年01月02日	-	2024年01月08日	1.83	69,100	126,453.00



164	600352	浙江龙盛	2024年01月02日	-	2024年01月02日	8.40	15,000	126,000.00
165	002240	盛新锂能	2024年01月02日	-	2024年01月12日	22.75	5,500	125,125.00
166	688200	华峰测控	2024年01月03日	-	2024年01月03日	122.80	1,000	122,800.00
167	601098	中南传媒	2024年01月12日	-	2024年01月12日	10.17	12,000	122,040.00
168	600022	山东钢铁	2024年01月02日	-	2024年01月03日	1.37	89,000	121,930.00
169	600378	昊华科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	30.48	4,000	121,920.00
170	600497	驰宏锌锗	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.05	24,000	121,200.00
171	600129	太极集团	2024年01月08日	-	2024年01月08日	46.46	2,600	120,796.00
172	000581	威孚高科	2024年01月08日	-	2024年01月08日	15.07	8,000	120,560.00
173	002432	九安医疗	2024年01月03日	-	2024年01月10日	37.67	3,200	120,544.00
174	300776	帝尔激光	2024年01月10日	-	2024年01月12日	60.26	2,000	120,520.00

175	002624	完美世界	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 09 日	11.84	10,100	119,584.00
176	603305	旭升集团	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	19.73	6,000	118,380.00
177	603826	坤彩科技	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 12 日	59.03	2,000	118,060.00
178	600967	内蒙一机	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	8.26	14,000	115,640.00
179	000401	冀东水泥	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	6.39	18,000	115,020.00
180	688349	三一重能	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	28.62	4,000	114,480.00
181	603228	景旺电子	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 08 日	22.56	5,000	112,800.00
182	600390	五矿资本	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	4.68	23,900	111,852.00
183	600416	湘电股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	15.88	7,000	111,160.00
184	002407	多氟多	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 08 日	15.22	7,300	111,106.00
185	002065	东华软件	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	6.17	17,900	110,443.00

186	003022	联泓新科	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 08 日	18.31	6,000	109,860.00
187	688276	长春百克生物科技	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	54.81	2,000	109,620.00
188	000559	万向钱潮	2024 年 01 月 10 日	-	2024 年 01 月 10 日	5.19	21,100	109,509.00
189	600258	首旅酒店	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	15.62	7,000	109,340.00
190	000998	隆平高科	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	14.10	7,700	108,570.00
191	002010	传化智联	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	4.62	23,000	106,260.00
192	002032	苏泊尔	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	53.01	2,000	106,020.00
193	688063	派能科技	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	106.00	1,000	106,000.00
194	000027	深圳能源	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	6.45	16,400	105,780.00
195	601928	凤凰传媒	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	8.81	12,000	105,720.00

196	600208	新湖中宝	2024年01月03日	-	2024年01月09日	2.17	48,500	105,245.00
197	688521	芯原微电子	2024年01月02日	-	2024年01月02日	49.96	2,100	104,916.00
198	002756	永兴材料	2024年01月02日	-	2024年01月08日	52.21	2,000	104,420.00
199	688425	铁建重工	2024年01月08日	-	2024年01月08日	3.97	26,000	103,220.00
200	601598	中国外运	2024年01月02日	-	2024年01月03日	5.24	19,600	102,704.00
201	001286	陕西能源	2024年01月08日	-	2024年01月08日	8.55	12,000	102,600.00
202	002505	鹏都农牧	2024年01月02日	-	2024年01月10日	1.60	64,000	102,400.00
203	688520	神州细胞集团公司	2024年01月10日	-	2024年01月10日	53.87	1,900	102,353.00
204	603379	三美股份	2024年01月03日	-	2024年01月03日	34.00	3,000	102,000.00
205	603267	鸿远电	2024年01月03日	-	2024年01月03日	50.20	2,000	100,400.00

		子	日	日			
206	000830	鲁西化工	2024年01月02日	2024年01月02日	10.03	10,000	100,300.00
207	600764	中国海防	2024年01月08日	2024年01月08日	24.95	4,000	99,800.00
208	000750	国海证券	2024年01月02日	2024年01月02日	3.54	28,000	99,120.00
209	000423	东阿阿胶	2024年01月02日	2024年01月03日	49.32	2,000	98,640.00
210	688029	南微医学科技	2024年01月03日	2024年01月03日	96.80	1,000	96,800.00
211	300363	博腾股份	2024年01月03日	2024年01月10日	25.15	3,800	95,570.00
212	300850	新强联	2024年01月02日	2024年01月02日	31.83	3,000	95,490.00
213	688208	道通科技	2024年01月02日	2024年01月02日	23.75	4,000	95,000.00
214	601568	北元集团	2024年01月02日	2024年01月03日	4.74	20,000	94,800.00
215	300257	开山股份	2024年01月02日	2024年01月02日	15.76	6,000	94,560.00
216	600521	华	2024	2024	14.67	6,400	93,888.00

		海药业	年 01 月 02 日	年 01 月 02 日			
217	600663	陆家嘴	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	8.75	10,600	92,750.00
218	002761	浙江建投	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 10 日	10.26	9,000	92,340.00
219	002925	盈趣科技	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 09 日	19.47	4,700	91,509.00
220	688516	奥特维科技	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	90.50	1,000	90,500.00
221	000537	中绿电	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	9.63	9,000	86,670.00
222	002468	申通快递	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	7.79	11,000	85,690.00
223	600167	联美控股	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	5.67	15,000	85,050.00
224	002294	信立泰	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 10 日	32.66	2,600	84,916.00
225	600977	中国电影	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	12.24	6,900	84,456.00
226	001914	招商积余	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	11.96	7,000	83,720.00

227	002797	第一创业	2024年01月03日	-	2024年01月03日	5.81	14,400	83,664.00
228	000778	新兴铸管	2024年01月02日	-	2024年01月12日	3.82	21,900	83,658.00
229	002030	达安基因	2024年01月02日	-	2024年01月03日	9.68	8,600	83,248.00
230	002518	科士达	2024年01月02日	-	2024年01月02日	27.60	3,000	82,800.00
231	603218	日月股份	2024年01月02日	-	2024年01月02日	12.37	6,600	81,642.00
232	600598	北大荒	2024年01月02日	-	2024年01月02日	11.97	6,800	81,396.00
233	002791	坚朗五金	2024年01月08日	-	2024年01月08日	40.49	2,000	80,980.00
234	688387	中信科移动	2024年01月08日	-	2024年01月08日	7.21	11,000	79,310.00
235	002608	江苏国信	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.57	12,000	78,840.00
236	000591	太阳能	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.58	14,000	78,120.00
237	688297	中航无	2024年01月08日	-	2024年01月08日	38.33	2,000	76,660.00

		人 机	日	日				
238	000893	亚 钾 国 际	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	26.24	2,900	76,096.00
239	688107	安 路 科 技	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	36.78	2,000	73,560.00
240	002423	中 粮 资 本	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	6.68	11,000	73,480.00
241	002138	顺 络 电 子	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	27.01	2,700	72,927.00
242	002563	森 马 服 饰	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	5.77	12,600	72,702.00
243	300568	星 源 材 质	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	15.42	4,700	72,474.00
244	603056	德 邦 股 份	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	14.47	5,000	72,350.00
245	002399	海 普 瑞	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	11.73	6,100	71,553.00
246	603786	科 博 达	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	71.36	1,000	71,360.00
247	600928	西 安 银 行	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 08 日	3.33	21,000	69,930.00
248	601828	美 凯	2024 年 01	-	2024 年 01	3.87	18,000	69,660.00



		龙	月 02 日	月 02 日			
249	601990	南京 证券 券	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	7.98	8,600	68,628.00
250	000539	粤 电 力 A	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 10 日	4.89	14,000	68,460.00
251	601611	中 国 核 建	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	6.93	9,800	67,914.00
252	688153	唯 捷 创 芯	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	65.50	1,000	65,500.00
253	688105	诺 唯 赞 生 物	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 10 日	32.02	2,000	64,040.00
254	000031	大 悦 城	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 10 日	2.97	21,000	62,370.00
255	002439	启 明 星 辰	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	27.00	2,300	62,100.00
256	688331	荣 昌 生 物	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 10 日	62.06	1,000	62,060.00
257	601139	深 圳 燃 气	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	6.89	9,000	62,010.00
258	601061	中 信 金 属	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 12 日	7.71	8,000	61,680.00
259	603156	养	2024	- 2024	21.26	2,900	61,654.00

		元 饮 品	年 01 月 02 日	-	年 01 月 08 日			
260	002867	周 大 生	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	15.18	4,000	60,720.00
261	002945	华 林 证 券	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	15.10	4,000	60,400.00
262	600884	杉 杉 股 份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 09 日	13.62	4,300	58,566.00
263	300390	天 华 新 能	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 10 日	25.35	2,300	58,305.00
264	002625	光 启 技 术	2024 年 01 月 12 日	-	2024 年 01 月 12 日	14.78	3,900	57,642.00
265	002508	老 板 电 器	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	21.78	2,600	56,628.00
266	601231	环 旭 电 子	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	15.11	3,600	54,396.00
267	603707	健 友 股 份	2024 年 01 月 10 日	-	2024 年 01 月 10 日	15.00	3,600	54,000.00
268	603927	中 科 软	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	29.98	1,800	53,964.00
269	688690	纳 微 科 技	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	27.42	1,900	52,098.00
270	002444	巨	2024	-	2024	22.52	2,300	51,796.00

		星科技	2024年01月03日	-	2024年01月03日			
271	301029	怡合达	2024年01月10日	-	2024年01月10日	25.78	2,000	51,560.00
272	300558	贝达药业	2024年01月03日	-	2024年01月03日	51.55	1,000	51,550.00
273	002568	百润股份	2024年01月02日	-	2024年01月03日	24.61	2,000	49,220.00
274	000553	安道麦 A	2024年01月08日	-	2024年01月08日	6.94	7,000	48,580.00
275	001872	招商港口	2024年01月08日	-	2024年01月08日	15.96	3,000	47,880.00
276	000728	国元证券	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.83	7,000	47,810.00
277	600109	国金证券	2024年01月02日	-	2024年01月03日	9.08	5,100	46,308.00
278	002653	海思科	2024年01月12日	-	2024年01月12日	23.15	2,000	46,300.00
279	600369	西南证券	2024年01月10日	-	2024年01月10日	4.09	10,900	44,581.00
280	688002	睿创微纳	2024年01月03日	-	2024年01月03日	44.22	1,000	44,220.00
281	601118	海	2024	-	2024	4.24	10,400	44,096.00

		南 橡 胶	年 01 月 02 日	年 01 月 02 日			
282	002936	郑 州 银 行	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 12 日	2.01	21,800	43,818.00
283	002008	大 族 激 光	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	20.72	2,100	43,512.00
284	600299	安 迪 苏	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	8.00	5,100	40,800.00
285	600956	新 天 绿 能	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	8.13	5,000	40,650.00
286	300001	特 锐 德	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	20.10	2,000	40,200.00
287	600699	均 胜 电 子	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	17.96	2,200	39,512.00
288	688295	中 复 神 鹰 碳 纤 维	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	30.31	1,300	39,403.00
289	688819	天 能 电 池 集 团 股 份	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 10 日	27.92	1,400	39,088.00
290	600637	东 方	2024 年 01	- 2024 年 01	7.52	5,100	38,352.00

		明珠	月 02 日	月 08 日			
291	600325	华发股份	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	7.21	5,000	36,050.00
292	603858	步长制药	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	17.01	2,100	35,721.00
293	002262	恩华药业	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	27.12	1,300	35,256.00
294	300595	欧普康视	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	22.58	1,500	33,870.00
295	600985	淮北矿业	2024 年 01 月 09 日	- 2024 年 01 月 09 日	16.63	1,900	31,597.00
296	002497	雅化集团	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	13.09	2,300	30,107.00
297	300070	碧水源	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 03 日	4.99	6,000	29,940.00
298	603883	老百姓	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 10 日	29.89	1,000	29,890.00
299	601156	东航物流	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	14.78	2,000	29,560.00
300	002430	杭氧股份	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	29.21	1,000	29,210.00
301	000898	鞍钢	2024 年 01	- 2024 年 01	2.49	11,700	29,133.00

		股 份	月 03 日	月 03 日			
302	603127	昭 衍 新 药	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	23.71	1,200	28,452.00
303	603317	天 味 食 品	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	13.29	2,100	27,909.00
304	000883	湖 北 能 源	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 10 日	4.23	6,500	27,495.00
305	688248	南 方 电 网 电 力 科 技	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	24.97	1,000	24,970.00
306	600170	上 海 建 工	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 12 日	2.34	10,600	24,804.00
307	600032	浙 江 新 能	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 08 日	8.06	3,000	24,180.00
308	600583	海 油 工 程	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 12 日	5.94	3,800	22,572.00
309	603355	莱 克 电 气	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	22.30	1,000	22,300.00
310	600535	天 士 力	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	17.02	1,300	22,126.00
311	601162	天 风	2024 年 01	- 2024 年 01	3.09	6,900	21,321.00

		证 券	月 08 日	月 08 日			
312	688567	孚 能 科 技	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	16.31	1,200	19,572.00
313	600377	宁 沪 高 速	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	10.25	1,900	19,475.00
314	601778	晶 科 科 技	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 03 日	3.50	5,500	19,250.00
315	600160	巨 化 股 份	2024 年 01 月 03 日	- 2024 年 01 月 03 日	16.49	1,000	16,490.00
316	000930	中 粮 科 技	2024 年 01 月 08 日	- 2024 年 01 月 08 日	6.64	2,200	14,608.00
317	688538	和 辉 光 电	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 10 日	2.43	6,000	14,580.00
318	601991	大 唐 发 电	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	2.42	5,500	13,310.00
319	600392	盛 和 资 源	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	10.18	1,300	13,234.00
320	600350	山 东 高 速	2024 年 01 月 10 日	- 2024 年 01 月 10 日	6.94	1,800	12,492.00
321	300009	安 科 生 物	2024 年 01 月 02 日	- 2024 年 01 月 02 日	10.22	1,200	12,264.00
322	000402	金 融	2024 年 01	- 2024 年 01	3.63	3,300	11,979.00

		街	月 10 日	月 10 日				
323	600906	财达证 券	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	7.50	1,400	10,500.00
324	601696	中银证 券	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	10.29	1,000	10,290.00
325	600873	梅花生 物	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	9.55	1,000	9,550.00
326	600597	光明乳 业	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	8.73	1,000	8,730.00
327	002966	苏州银 行	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 03 日	6.46	1,300	8,398.00
328	300296	利亚德	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	6.00	1,000	6,000.00
329	000598	兴蓉环 境	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	5.69	1,000	5,690.00
合计	-	-	-	-	-	-	5,505,540	48,208,004.40

注：出借证券中如有其它流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组



织架构，并明确了相应的风险管理职能。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2023年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	21,735,448.98	-	-	-	-	-	21,735,448.98
结算备付金	3,695,664.48	-	-	-	-	-	3,695,664.48
存出保	26,826.17	-	-	-	-	913,382.40	940,208.57

证金							
交易性金融资产	2,244,190.58	-	1,013,217.54	-	-	357,976,156.00	361,233,564.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	184.33	184.33
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	108,839.69	-	-	-	-	881,207.71	990,047.40
递延所	-	-	-	-	-	-	-

得 税 资 产							
其 他 资 产	-	-	-	-	-	21,082.85	21,082.85
资 产 总 计	27,810,969.9 0	-	1,013,217.5 4	-	-	359,792,013.2 9	388,616,200.7 3
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							
应付赎回款	-	-	-	-	-	749,245.11	749,245.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	165,024.34	165,024.34
应付托管费	-	-	-	-	-	33,004.88	33,004.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,643.35	21,643.35
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	2,297.61	2,297.61
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得	-	-	-	-	-	-	-

税 负 债							
其 他 负 债	-	-	-	-	-	265,384.69	265,384.69
负 债 总 计	-	-	-	-	-	1,236,599.98	1,236,599.98
利 率 敏 感 度 缺 口	27,810,969.9 0	-	1,013,217.5 4	-	-	358,555,413.3 1	387,379,600.7 5
上 年 度 末 202 2 年 12 月 31 日	1 个月以内	1- 3 个 月	3 个月-1 年	1- 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资 产							
货 币 资 金	23,910,410.7 5	-	-	-	-	-	23,910,410.75
结 算 备 付 金	5,793,342.16	-	-	-	-	-	5,793,342.16
存 出 保 证 金	22,832.17	-	-	-	-	1,128,883.20	1,151,715.37

交易性金融资产	1,530,314.38	-	2,136,777.04	-	-	393,096,493.34	396,763,584.76
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	116,446.78	-	-	-	-	1,279,298.76	1,395,745.54
递延所得税	-	-	-	-	-	-	-

资产							
其他资产	-	-	-	-	-	14,255.12	14,255.12
资产总计	31,373,346.24	-	2,136,777.04	-	-	395,518,930.42	429,029,053.70
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	13.18	13.18
应	-	-	-	-	-	1,411,087.61	1,411,087.61



付 赎 回 款							
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	179,978.11	179,978.11
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	35,995.60	35,995.60
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	30,199.37	30,199.37
应 付 投 资 顾 问 费	-	-	-	-	-	-	-
应 交 税 费	-	-	-	-	-	1,582.55	1,582.55
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
递 延 所 得 税 负	-	-	-	-	-	-	-

债							
其他负债	-	-	-	-	-	308,868.98	308,868.98
负债总计	-	-	-	-	-	1,967,725.40	1,967,725.40
利率敏感度缺口	31,373,346.24	-	2,136,777.04	-	-	393,551,205.02	427,061,328.30

表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况; 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点,且除利率之外的其他市场变量保持不变; 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动; 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息,假定利率变动仅影响该类资产的未来收益,而对其本身的公允价值无重大影响;定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定,不受利率变化影响; 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	1,164.04	2,164.67
	基准利率增加 25 个基点	-1,162.12	-2,160.73

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	357,976,156.00	92.41	393,096,493.34	92.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,257,408.12	0.84	3,667,091.42	0.86
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	361,233,564.12	93.25	396,763,584.76	92.91

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证 500 指数 上涨 5%	18,248,780.88	19,945,841.41
	中证 500 指数 下跌 5%	-18,248,780.88	-19,945,841.41

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为

市场价格风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时,将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	357,049,178.54	391,592,626.94
第二层次	3,172,077.42	5,161,769.42
第三层次	1,012,308.16	9,188.40
合计	361,233,564.12	396,763,584.76

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位:人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	9,188.40	9,188.40
当期购买	-	1,018,980.66	1,018,980.66

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	415,552.00	415,552.00
转出第三层次	-	9,188.40	9,188.40
当期利得或损失总额	-	-422,224.50	-422,224.50
其中：计入损益的利得或损失	-	-422,224.50	-422,224.50
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,012,308.16	1,012,308.16
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-422,224.50	-422,224.50
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,203,062.97	1,203,062.97
当期购买	-	10,703.68	10,703.68
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,203,062.97	1,203,062.97
当期利得或损失总额	-	-1,515.28	-1,515.28
其中：计入损益的利得或损失	-	-1,515.28	-1,515.28
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	9,188.40	9,188.40
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-1,515.28	-1,515.28

## 7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估	不可观察输入值
----	---------	------	---------

		值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股权	2,835.00	上市公司比较法	折现率	0.2	负相关
限售股票	1,009,473.16	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.1462-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	9,188.40	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.4326	负相关

#### 7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	357,976,156.00	92.12

	其中：股票	357,976,156.00	92.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,257,408.12	0.84
	其中：债券	3,257,408.12	0.84
	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	25,431,113.46	6.54
8	其他各项资产	1,951,523.15	0.50
9	合计	388,616,200.73	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 48,208,004.40 元，占期末基金资产净值比例 12.44%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,410,944.00	0.62
B	采矿业	13,723,542.00	3.54
C	制造业	223,774,540.25	57.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,571,788.49	2.99
E	建筑业	2,833,484.00	0.73
F	批发和零售业	10,729,672.24	2.77
G	交通运输、仓储和邮政业	6,574,912.47	1.70
H	住宿和餐饮业	582,626.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,843,905.19	6.93
J	金融业	32,124,445.11	8.29
K	房地产业	4,436,621.00	1.15
L	租赁和商务服务业	3,159,884.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	3,265,542.76	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	1,889,170.00	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	977,976.00	0.25
Q	卫生和社会工作	2,685,553.81	0.69
R	文化、体育和娱乐业	4,958,981.00	1.28
S	综合	2,078,432.60	0.54
	合计	354,622,020.92	91.54

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,087,755.96	0.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,336.64	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	177,833.88	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,835.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	45,698.70	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	18,674.90	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,354,135.08	0.87

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	39,400	1,943,208.00	0.50
2	002422	科伦药业	65,500	1,902,775.00	0.49
3	002028	思源电气	34,277	1,783,775.08	0.46
4	300418	昆仑万维	47,200	1,765,280.00	0.46
5	600157	永泰能	1,235,000	1,691,950.00	0.44



		源			
6	000988	华工科技	55,800	1,660,608.00	0.43
7	002463	沪电股份	74,000	1,636,880.00	0.42
8	601058	赛轮轮胎	138,600	1,628,550.00	0.42
9	601555	东吴证券	222,490	1,626,401.90	0.42
10	000975	银泰黄金	107,928	1,618,920.00	0.42
11	600079	人福医药	63,500	1,578,610.00	0.41
12	600418	江淮汽车	97,100	1,568,165.00	0.40
13	002340	格林美	285,400	1,558,284.00	0.40
14	601168	西部矿业	105,800	1,509,766.00	0.39
15	000933	神火股份	87,600	1,471,680.00	0.38
16	301236	软通动力	31,800	1,469,160.00	0.38
17	601233	桐昆股份	93,700	1,417,681.00	0.37
18	600161	天坛生物	45,800	1,417,052.00	0.37
19	601108	财通证券	180,750	1,402,620.00	0.36
20	601077	渝农商行	343,400	1,401,072.00	0.36
21	300394	天孚通信	15,300	1,400,256.00	0.36
22	000630	铜陵有色	422,000	1,384,160.00	0.36
23	002384	东山精密	76,100	1,383,498.00	0.36
24	300037	新宙邦	29,160	1,379,268.00	0.36
25	002156	通富微电	58,800	1,359,456.00	0.35
26	000009	中国宝安	114,540	1,344,699.60	0.35
27	688122	西部超导	25,200	1,341,396.00	0.35

28	002517	恺英网络	119,600	1,335,932.00	0.34
29	300012	华测检测	93,600	1,329,120.00	0.34
30	600109	国金证券	144,900	1,315,692.00	0.34
31	002966	苏州银行	203,440	1,314,222.40	0.34
32	600988	赤峰黄金	92,400	1,294,524.00	0.33
33	600885	宏发股份	46,418	1,282,993.52	0.33
34	300136	信维通信	53,700	1,267,320.00	0.33
35	002465	海格通信	96,600	1,241,310.00	0.32
36	000423	东阿阿胶	25,100	1,237,932.00	0.32
37	002625	光启技术	83,700	1,237,086.00	0.32
38	600160	巨化股份	74,960	1,236,090.40	0.32
39	688169	石头科技	4,340	1,228,003.00	0.32
40	300207	欣旺达	82,800	1,222,128.00	0.32
41	002185	华天科技	142,600	1,214,952.00	0.31
42	600352	浙江龙盛	144,600	1,214,640.00	0.31
43	600536	中国软件	33,460	1,213,259.60	0.31
44	002138	顺络电子	44,800	1,210,048.00	0.31
45	002738	中矿资源	32,120	1,198,397.20	0.31
46	601162	天风证券	385,500	1,191,195.00	0.31
47	600298	安琪酵母	33,800	1,189,084.00	0.31
48	000932	华菱钢铁	230,380	1,186,457.00	0.31
49	688072	拓荆科技	5,108	1,181,480.40	0.30

50	300003	乐普医疗	73,000	1,179,680.00	0.30
51	603596	伯特利	16,800	1,164,240.00	0.30
52	688099	晶晨半导体	18,558	1,162,287.54	0.30
53	000783	长江证券	215,000	1,156,700.00	0.30
54	002223	鱼跃医疗	33,400	1,154,972.00	0.30
55	300144	宋城演艺	116,500	1,149,855.00	0.30
56	300724	捷佳伟创	15,500	1,147,155.00	0.30
57	002439	启明星辰	42,000	1,134,000.00	0.29
58	002078	太阳纸业	93,000	1,131,810.00	0.29
59	603939	益丰药房	28,120	1,125,924.80	0.29
60	000723	美锦能源	168,000	1,118,880.00	0.29
61	600415	小商品城	152,200	1,114,104.00	0.29
62	600096	云天化	71,300	1,112,280.00	0.29
63	300568	星源材质	71,100	1,096,362.00	0.28
64	600765	中航重机	57,320	1,095,385.20	0.28
65	002385	大北农	183,700	1,094,852.00	0.28
66	600873	梅花生物	114,600	1,094,430.00	0.28
67	002756	永兴材料	20,960	1,094,321.60	0.28
68	600482	中国动力	60,700	1,093,207.00	0.28
69	000066	中国长城	107,400	1,086,888.00	0.28
70	002532	天山铝业	180,800	1,086,608.00	0.28
71	600839	四川长虹	205,000	1,084,450.00	0.28
72	002797	第一创业	186,500	1,083,565.00	0.28

73	300474	景嘉微	15,150	1,071,256.50	0.28
74	688180	君实生物	25,600	1,070,848.00	0.28
75	300017	网宿科技	135,400	1,062,890.00	0.27
76	603160	汇顶科技	15,300	1,057,230.00	0.27
77	300395	菲利华	28,831	1,054,061.36	0.27
78	002600	领益智造	155,500	1,051,180.00	0.27
79	600155	华创云信	125,500	1,046,670.00	0.27
80	002273	水晶光电	77,281	1,046,384.74	0.27
81	002044	美年健康	173,900	1,045,139.00	0.27
82	300285	国瓷材料	44,700	1,033,464.00	0.27
83	600862	中航高科	46,401	1,027,782.15	0.27
84	688120	华海清科	5,400	1,013,580.00	0.26
85	600177	雅戈尔	154,400	1,011,320.00	0.26
86	300601	康泰生物	37,200	1,009,980.00	0.26
87	002294	信立泰	30,900	1,009,194.00	0.26
88	600129	太极集团	21,666	1,006,602.36	0.26
89	300866	安克创新	11,300	1,001,180.00	0.26
90	600497	驰宏锌锗	198,200	1,000,910.00	0.26
91	000728	国元证券	145,600	994,448.00	0.26
92	300058	蓝色光标	138,200	992,276.00	0.26
93	688114	华大智造	11,500	989,230.00	0.26
94	002472	双环传动	37,800	983,556.00	0.25
95	002739	万达电影	75,500	983,010.00	0.25
96	600699	均胜电	54,700	982,412.00	0.25

		子			
97	601990	南京证券	122,900	980,742.00	0.25
98	603606	东方电缆	22,900	978,975.00	0.25
99	002607	中公教育	239,700	977,976.00	0.25
100	002195	岩山科技	318,201	976,877.07	0.25
101	000831	中国稀土	35,300	976,751.00	0.25
102	600066	宇通客车	73,700	976,525.00	0.25
103	600348	华阳股份	100,050	976,488.00	0.25
104	603882	金域医学	15,600	976,092.00	0.25
105	601128	常熟银行	152,400	973,836.00	0.25
106	002008	大族激光	46,800	969,696.00	0.25
107	300146	汤臣倍健	56,700	965,601.00	0.25
108	600546	山煤国际	55,000	963,050.00	0.25
109	002353	杰瑞股份	34,191	961,109.01	0.25
110	603816	顾家家居	27,400	959,000.00	0.25
111	601696	中银证券	92,600	952,854.00	0.25
112	002673	西部证券	148,800	947,856.00	0.24
113	000893	亚钾国际	36,100	947,264.00	0.24
114	600529	山东药玻	36,800	942,080.00	0.24
115	300604	长川科技	24,200	919,358.00	0.24
116	600985	淮北矿业	55,000	914,650.00	0.24
117	601577	长沙银行	133,900	913,198.00	0.24

118	300088	长信科技	136,500	913,185.00	0.24
119	600499	科达制造	86,400	911,520.00	0.24
120	600060	海信视像	43,600	911,240.00	0.24
121	002262	恩华药业	33,500	908,520.00	0.23
122	603589	口子窖	20,004	906,181.20	0.23
123	600369	西南证券	221,300	905,117.00	0.23
124	002444	巨星科技	40,000	900,800.00	0.23
125	000997	新大陆	45,800	898,138.00	0.23
126	300118	东方日升	50,600	893,090.00	0.23
127	002624	完美世界	75,400	892,736.00	0.23
128	601666	平煤股份	77,100	891,276.00	0.23
129	688301	奕瑞科技股份有限公司	2,740	891,212.40	0.23
130	688390	固德威电源	6,808	888,988.64	0.23
131	688728	格科微有限公司	43,400	888,398.00	0.23
132	601198	东兴证券	107,900	888,017.00	0.23
133	002409	雅克科技	15,900	886,107.00	0.23
134	688002	睿创微纳	19,952	882,277.44	0.23
135	603688	石英股份	10,100	877,488.00	0.23
136	600642	申能股份	136,000	873,120.00	0.23
137	000400	许继电气	39,600	869,616.00	0.22
138	300699	光威复材	32,400	864,108.00	0.22
139	300073	当升科技	22,500	859,500.00	0.22

140	603000	人民网	30,700	858,986.00	0.22
141	002131	利欧股份	375,792	856,805.76	0.22
142	600637	东方明珠	113,800	855,776.00	0.22
143	002558	巨人网络	76,800	855,552.00	0.22
144	600884	杉杉股份	62,600	852,612.00	0.22
145	000683	远兴能源	145,200	852,324.00	0.22
146	600486	扬农化工	13,490	851,488.80	0.22
147	600535	天士力	50,000	851,000.00	0.22
148	600399	抚顺特钢	87,500	850,500.00	0.22
149	000591	太阳能	152,200	849,276.00	0.22
150	600879	航天电子	110,100	848,871.00	0.22
151	000878	云南铜业	77,800	847,242.00	0.22
152	600118	中国卫星	32,800	846,896.00	0.22
153	000629	钒钛股份	258,100	846,568.00	0.22
154	002152	广电运通	68,900	844,714.00	0.22
155	000021	深科技	52,000	842,920.00	0.22
156	600867	通化东宝	77,400	838,242.00	0.22
157	002497	雅化集团	63,900	836,451.00	0.22
158	601997	贵阳银行	162,400	834,736.00	0.22
159	688521	芯原微电子	16,694	834,032.24	0.22
160	600895	张江高科	43,100	831,830.00	0.21
161	600143	金发科技	104,100	831,759.00	0.21
162	688188	上海柏楚电子科技	3,260	825,138.60	0.21

163	300390	天华新能	32,540	824,889.00	0.21
164	000998	隆平高科	58,500	824,850.00	0.21
165	605358	立昂微	30,100	824,439.00	0.21
166	300001	特锐德	41,001	824,120.10	0.21
167	688772	珠海冠宇电池	37,437	823,988.37	0.21
168	000703	恒逸石化	122,100	820,512.00	0.21
169	600516	方大炭素	156,500	820,060.00	0.21
170	600416	湘电股份	51,500	817,820.00	0.21
171	300024	机器人	68,800	816,656.00	0.21
172	688220	翱捷科技	11,567	814,779.48	0.21
173	002240	盛新锂能	35,800	814,450.00	0.21
174	002432	九安医疗	21,600	813,672.00	0.21
175	600549	厦门钨业	47,300	812,614.00	0.21
176	603712	七一二	25,776	812,201.76	0.21
177	603077	和邦生物	343,900	811,604.00	0.21
178	600170	上海建工	344,900	807,066.00	0.21
179	002407	多氟多	53,020	806,964.40	0.21
180	600153	建发股份	83,500	804,105.00	0.21
181	688052	纳芯微电子	4,800	800,880.00	0.21
182	002430	杭氧股份	27,400	800,354.00	0.21
183	600392	盛和资源	77,960	793,632.80	0.20
184	600141	兴发集团	43,140	787,305.00	0.20
185	601966	玲珑轮胎	40,900	786,507.00	0.20
186	000960	锡业股份	54,900	786,168.00	0.20



187	000623	吉林敖东	51,800	784,252.00	0.20
188	000039	中集集团	102,400	783,360.00	0.20
189	300383	光环新网	80,000	777,600.00	0.20
190	002065	东华软件	124,900	770,633.00	0.20
191	300748	金力永磁	38,080	769,977.60	0.20
192	600704	物产中大	173,000	766,390.00	0.20
193	600909	华安证券	156,570	764,061.60	0.20
194	600998	九州通	108,443	760,185.43	0.20
195	300212	易华录	24,080	757,316.00	0.20
196	601717	郑煤机	59,700	755,205.00	0.19
197	000750	国海证券	213,150	754,551.00	0.19
198	300487	蓝晓科技	14,050	745,493.00	0.19
199	002064	华峰化学	110,500	741,455.00	0.19
200	603658	安图生物	13,000	741,130.00	0.19
201	002203	海亮股份	66,300	739,245.00	0.19
202	002268	电科网安	32,830	737,361.80	0.19
203	600673	东阳光	100,100	733,733.00	0.19
204	600583	海油工程	122,900	730,026.00	0.19
205	002025	航天电器	15,200	729,904.00	0.19
206	600166	福田汽车	266,600	727,818.00	0.19
207	000738	航发控制	36,500	726,350.00	0.19
208	603456	九洲药业	30,000	726,300.00	0.19
209	600521	华海药业	49,500	726,165.00	0.19
210	000050	深天马	68,100	725,265.00	0.19

		A			
211	601456	国联证 券	66,300	718,692.00	0.19
212	002939	长城证 券	89,800	718,400.00	0.19
213	300114	中航电 测	16,400	717,500.00	0.19
214	300558	贝达药 业	13,900	716,545.00	0.18
215	000513	丽珠集 团	20,464	716,444.64	0.18
216	603338	浙江鼎 力	14,000	716,380.00	0.18
217	002568	百润股 份	29,100	716,151.00	0.18
218	002368	太极股 份	24,202	714,685.06	0.18
219	689009	九号公 司	23,996	711,721.36	0.18
220	600398	海澜之 家	95,900	711,578.00	0.18
221	002299	圣农发 展	41,400	711,252.00	0.18
222	002506	协鑫集 成	259,400	710,756.00	0.18
223	002128	电投能 源	49,800	710,646.00	0.18
224	600863	内蒙华 电	181,000	705,900.00	0.18
225	600820	隧道股 份	122,400	705,024.00	0.18
226	600859	王府井	44,102	704,308.94	0.18
227	000636	风华高 科	51,500	703,490.00	0.18
228	002429	兆驰股 份	125,900	702,522.00	0.18
229	002092	中泰化 学	115,000	701,500.00	0.18
230	600739	辽宁成 大	59,500	700,910.00	0.18
231	601216	君正集 团	187,300	700,502.00	0.18
232	600563	法拉电	7,501	694,592.60	0.18

		子			
233	002414	高德红 外	94,900	692,770.00	0.18
234	002373	千方科 技	61,400	688,294.00	0.18
235	300253	卫宁健 康	95,600	687,364.00	0.18
236	600435	北方导 航	58,300	684,442.00	0.18
237	002926	华西证 券	87,600	679,776.00	0.18
238	300595	欧普康 视	30,000	677,400.00	0.17
239	300296	利亚德	112,400	674,400.00	0.17
240	000729	燕京啤 酒	78,100	674,003.00	0.17
241	600655	豫园股 份	108,300	672,543.00	0.17
242	300009	安科生 物	65,076	665,076.72	0.17
243	300244	迪安诊 断	27,901	664,322.81	0.17
244	688567	孚能科 技	40,653	663,050.43	0.17
245	600325	华发股 份	91,900	662,599.00	0.17
246	300251	光线传 媒	81,300	662,595.00	0.17
247	300676	华大基 因	13,800	662,400.00	0.17
248	002595	豪迈科 技	22,200	660,894.00	0.17
249	600021	上海电 力	78,100	660,726.00	0.17
250	300373	扬杰科 技	18,000	660,600.00	0.17
251	688536	思瑞浦 股份	4,504	658,935.20	0.17
252	600008	首创环 保	244,440	657,543.60	0.17
253	600271	航天信 息	61,700	656,488.00	0.17
254	600498	烽火通	39,400	655,616.00	0.17

		信			
255	000519	中兵红箭	46,500	652,860.00	0.17
256	601016	节能风电	215,750	647,250.00	0.17
257	002500	山西证券	119,510	644,158.90	0.17
258	600380	健康元	51,708	642,730.44	0.17
259	600004	白云机场	65,700	642,546.00	0.17
260	600566	济川药业	20,400	641,172.00	0.17
261	002507	涪陵榨菜	44,850	640,906.50	0.17
262	000830	鲁西化工	63,893	640,846.79	0.17
263	688005	容百科技	16,100	640,780.00	0.17
264	002372	伟星新材	44,180	639,284.60	0.17
265	688234	天岳先进	9,600	634,272.00	0.16
266	002850	科达利	7,500	633,450.00	0.16
267	600282	南钢股份	171,200	633,440.00	0.16
268	002936	郑州银行	313,665	630,466.65	0.16
269	002281	光迅科技	22,105	629,992.50	0.16
270	603233	大参林	25,252	628,774.80	0.16
271	000060	中金岭南	145,400	628,128.00	0.16
272	600038	中直股份	16,300	628,039.00	0.16
273	688063	派能科技	5,900	625,400.00	0.16
274	002192	融捷股份	11,500	623,415.00	0.16
275	688032	禾迈股份	2,300	621,000.00	0.16
276	601636	旗滨集团	89,700	613,548.00	0.16
277	002056	横店东	45,000	609,300.00	0.16

		磁			
278	688331	荣昌生物	9,800	608,188.00	0.16
279	601880	辽港股份	417,000	604,650.00	0.16
280	002019	亿帆医药	40,900	604,502.00	0.16
281	002670	国盛金控	64,598	602,053.36	0.16
282	002120	韵达股份	80,700	602,022.00	0.16
283	603225	新凤鸣	42,320	600,944.00	0.16
284	300070	碧水源	120,400	600,796.00	0.16
285	603156	养元饮品	28,200	599,532.00	0.15
286	300682	朗新科技	36,500	598,235.00	0.15
287	600580	卧龙电驱	51,000	598,230.00	0.15
288	600511	国药股份	20,902	598,215.24	0.15
289	300529	健帆生物	26,900	597,987.00	0.15
290	300677	英科医疗	25,540	596,614.40	0.15
291	000547	航天发展	71,200	595,944.00	0.15
292	603927	中科软	19,820	594,203.60	0.15
293	002080	中材科技	37,200	592,224.00	0.15
294	603893	瑞芯微	9,300	589,620.00	0.15
295	603885	吉祥航空	49,100	589,200.00	0.15
296	002865	钧达股份	7,600	588,848.00	0.15
297	002557	洽洽食品	16,900	588,458.00	0.15
298	603444	吉比特	2,400	588,288.00	0.15
299	600390	五矿资本	125,000	585,000.00	0.15
300	600258	首旅酒店	37,300	582,626.00	0.15
301	002531	天顺风	49,900	578,840.00	0.15

		能			
302	601000	唐山港	164,830	576,905.00	0.15
303	002508	老板电 器	26,400	574,992.00	0.15
304	002831	裕同科 技	20,680	568,906.80	0.15
305	688385	复旦微 电	14,721	568,672.23	0.15
306	601933	永辉超 市	201,500	568,230.00	0.15
307	603517	绝味食 品	21,100	566,746.00	0.15
308	000598	兴蓉环 境	99,600	566,724.00	0.15
309	002572	索菲亚	35,500	566,225.00	0.15
310	002958	青农商 行	215,600	564,872.00	0.15
311	002487	大金重 工	21,200	564,344.00	0.15
311	300026	红日药 业	133,100	564,344.00	0.15
313	688516	奥特维 科技	6,235	564,267.50	0.15
314	601179	中国西 电	114,100	562,513.00	0.15
315	688538	和辉光 电	230,673	560,535.39	0.14
316	000970	中科三 环	54,150	560,452.50	0.14
317	601231	环旭电 子	36,900	557,559.00	0.14
318	603737	三棵树	11,660	555,132.60	0.14
319	601778	晶科科 技	158,600	555,100.00	0.14
320	300438	鹏辉能 源	19,600	554,484.00	0.14
321	688200	华峰测 控	4,500	552,600.00	0.14
322	600970	中材国 际	58,700	548,258.00	0.14
323	000155	川能动 力	41,100	546,219.00	0.14
324	600906	财达证	72,300	542,250.00	0.14

		券			
325	000887	中鼎股份	43,800	541,806.00	0.14
326	600707	彩虹股份	79,900	539,325.00	0.14
327	603185	弘元绿能	16,100	535,808.00	0.14
328	600329	达仁堂	15,900	535,035.00	0.14
329	600848	上海临港	53,200	534,660.00	0.14
330	002030	达安基因	54,495	527,511.60	0.14
331	600481	双良节能	62,200	526,212.00	0.14
332	600995	南网储能	53,300	525,538.00	0.14
333	600959	江苏有线	166,800	523,752.00	0.14
334	603858	步长制药	30,600	520,506.00	0.13
335	002155	湖南黄金	46,700	520,238.00	0.13
336	000563	陕国投 A	170,820	519,292.80	0.13
337	601866	中远海发	220,300	515,502.00	0.13
338	600208	新湖中宝	236,300	512,771.00	0.13
339	600755	厦门国贸	73,300	510,901.00	0.13
340	000027	深圳能源	79,060	509,937.00	0.13
341	000778	新兴铸管	133,300	509,206.00	0.13
342	600131	国网信通	33,500	507,525.00	0.13
343	300357	我武生物	17,500	507,500.00	0.13
344	601958	金钼股份	53,700	507,465.00	0.13
345	600977	中国电影	41,400	506,736.00	0.13
346	600316	洪都航	23,901	505,984.17	0.13

		空			
347	688029	南微医学科技	5,220	505,296.00	0.13
348	000739	普洛药业	32,800	504,792.00	0.13
349	000987	越秀资本	83,325	501,616.50	0.13
350	688082	盛美上海半导体	4,800	501,168.00	0.13
351	002244	滨江集团	68,900	500,903.00	0.13
352	601991	大唐发电	206,900	500,698.00	0.13
353	002683	广东宏大	24,900	499,992.00	0.13
354	600582	天地科技	91,800	499,392.00	0.13
355	603127	昭衍新药	21,056	499,237.76	0.13
356	601665	齐鲁银行	127,400	498,134.00	0.13
357	600373	中文传媒	37,700	496,886.00	0.13
358	002266	浙富控股	146,100	496,740.00	0.13
359	300888	稳健医疗	13,260	493,935.00	0.13
360	600737	中粮糖业	59,500	490,280.00	0.13
361	000709	河钢股份	230,100	490,113.00	0.13
362	603883	老百姓	16,247	485,622.83	0.13
363	000825	太钢不锈	127,300	474,829.00	0.12
364	002032	苏泊尔	8,900	471,789.00	0.12
365	002326	永太科技	40,600	471,772.00	0.12
366	600598	北大荒	39,400	471,618.00	0.12
367	601611	中国核建	67,000	464,310.00	0.12
368	600056	中国医	41,560	464,225.20	0.12



		药			
369	600378	昊华科技	15,200	463,296.00	0.12
370	600801	华新水泥	37,200	462,396.00	0.12
371	000785	居然之家	140,100	462,330.00	0.12
372	603826	坤彩科技	7,800	460,434.00	0.12
373	300363	博腾股份	18,300	460,245.00	0.12
374	000883	湖北能源	108,600	459,378.00	0.12
375	300776	帝尔激光	7,620	459,181.20	0.12
376	603379	三美股份	13,500	459,000.00	0.12
377	600528	中铁工业	61,600	458,304.00	0.12
378	601598	中国外运	87,400	457,976.00	0.12
379	600901	江苏金租	94,000	454,960.00	0.12
380	600517	国网英大	95,300	454,581.00	0.12
381	603568	伟明环保	28,399	454,384.00	0.12
382	603267	鸿远电子	9,000	451,800.00	0.12
383	003035	南网能源	84,200	442,892.00	0.11
384	603650	彤程新材	13,300	442,890.00	0.11
385	002511	中顺洁柔	44,279	442,790.00	0.11
386	002153	石基信息	45,378	441,981.72	0.11
387	601992	金隅集团	231,000	441,210.00	0.11
388	600500	中化国际	99,500	439,790.00	0.11
389	601106	中国一重	152,100	438,048.00	0.11

390	002653	海思科	18,500	428,275.00	0.11
391	600062	华润双鹤	23,000	427,800.00	0.11
392	600827	百联股份	44,700	424,203.00	0.11
393	603228	景旺电子	18,701	421,894.56	0.11
394	000937	冀中能源	58,800	419,832.00	0.11
395	002408	齐翔腾达	78,920	416,697.60	0.11
396	000581	威孚高科	27,600	415,932.00	0.11
397	600871	石化油服	226,400	414,312.00	0.11
398	603026	胜华新材	9,000	412,740.00	0.11
399	603305	旭升集团	20,800	410,384.00	0.11
400	001227	兰州银行	157,800	410,280.00	0.11
401	600022	山东钢铁	298,000	408,260.00	0.11
402	601098	中南传媒	40,000	406,800.00	0.11
403	003022	联泓新科	22,200	406,482.00	0.10
404	601118	海南橡胶	95,100	403,224.00	0.10
405	603707	健友股份	26,859	402,885.00	0.10
406	600126	杭钢股份	74,920	399,323.60	0.10
407	688520	神州细胞集团公司	7,400	398,638.00	0.10
408	600315	上海家化	18,800	398,184.00	0.10
409	600764	中国海防	15,800	394,210.00	0.10
410	600967	内蒙一机	47,400	391,524.00	0.10
411	601156	东航物流	26,400	390,192.00	0.10

412	688779	长远锂科	53,383	389,695.90	0.10
413	002690	美亚光电	19,630	385,533.20	0.10
414	688349	三一重能	13,400	383,508.00	0.10
415	000559	万向钱潮	73,600	381,984.00	0.10
416	000156	华数传媒	51,500	379,555.00	0.10
417	688276	长春百克生物科技	6,900	378,189.00	0.10
418	000401	冀东水泥	59,100	377,649.00	0.10
419	601928	凤凰传媒	42,400	373,544.00	0.10
420	601187	厦门银行	73,200	371,124.00	0.10
421	601608	中信重工	96,000	370,560.00	0.10
422	002867	周大生	24,400	370,392.00	0.10
423	688778	厦钨新能源	9,331	369,880.84	0.10
424	000089	深圳机场	56,700	364,581.00	0.09
425	600808	马钢股份	133,600	363,392.00	0.09
426	002518	科士达	13,100	361,560.00	0.09
427	603529	爱玛科技	14,400	360,576.00	0.09
428	600663	陆家嘴	41,100	359,625.00	0.09
429	002010	传化智联	77,700	358,974.00	0.09
430	600095	湘财股份	47,700	358,227.00	0.09
431	001286	陕西能源	41,700	356,535.00	0.09
432	688208	道通科技	14,977	355,703.75	0.09
433	603218	日月股份	28,620	354,029.40	0.09
434	688425	铁建重	88,900	352,933.00	0.09

		工			
435	300861	美畅股份	10,600	352,874.00	0.09
436	000958	电投产融	89,400	352,236.00	0.09
437	300257	开山股份	22,101	348,311.76	0.09
438	000930	中粮科技	51,600	342,624.00	0.09
439	002423	中粮资本	51,200	342,016.00	0.09
440	002505	鹏都农牧	213,500	341,600.00	0.09
441	603866	桃李面包	44,255	338,993.30	0.09
442	002925	盈趣科技	17,380	338,388.60	0.09
443	000967	盈峰环境	71,000	337,250.00	0.09
444	600597	光明乳业	38,300	334,359.00	0.09
445	002468	申通快递	42,600	331,854.00	0.09
446	000898	鞍钢股份	132,400	329,676.00	0.09
447	688107	安路科技	8,800	323,664.00	0.08
448	600968	海油发展	112,800	321,480.00	0.08
449	603786	科博达	4,500	321,120.00	0.08
450	300850	新强联	10,000	318,300.00	0.08
451	003031	中瓷电子	3,600	317,628.00	0.08
452	688006	浙江杭可科技	13,383	314,232.84	0.08
453	688281	华秦科技实业	2,300	312,018.00	0.08
454	601568	北元集团	65,790	311,844.60	0.08
455	688690	纳微科技	11,285	309,434.70	0.08
456	002761	浙江建投	30,100	308,826.00	0.08

457	688348	昱能科技	2,500	305,950.00	0.08
458	000959	首钢股份	86,300	298,598.00	0.08
459	000537	中绿电	30,900	297,567.00	0.08
460	002791	坚朗五金	7,200	291,528.00	0.08
461	600167	联美控股	50,980	289,056.60	0.07
462	688297	中航无人机	7,400	283,642.00	0.07
463	001914	招商积余	23,600	282,256.00	0.07
464	600339	中油工程	92,700	280,881.00	0.07
465	600377	宁沪高速	27,400	280,850.00	0.07
466	002608	江苏国信	42,200	277,254.00	0.07
467	688387	中信科移动	38,200	275,422.00	0.07
468	601228	广州港	84,200	263,546.00	0.07
469	600350	山东高速	37,600	260,944.00	0.07
470	002563	森马服饰	44,800	258,496.00	0.07
471	001203	大中矿业	25,300	257,301.00	0.07
472	600927	永安期货	16,200	254,502.00	0.07
473	301029	怡合达	9,660	249,034.80	0.06
474	600928	西安银行	74,400	247,752.00	0.06
475	603056	德邦股份	17,001	246,004.47	0.06
476	002399	海普瑞	20,800	243,984.00	0.06
477	000539	粤电力 A	49,800	243,522.00	0.06
478	601298	青岛港	39,200	242,256.00	0.06
479	000402	金融街	66,600	241,758.00	0.06
480	603317	天味食品	17,616	234,116.64	0.06

481	601828	美凯龙	60,000	232,200.00	0.06
482	600925	苏能股份	42,000	231,420.00	0.06
483	688153	唯捷创芯	3,500	229,250.00	0.06
484	002945	华林证券	15,000	226,500.00	0.06
485	601139	深圳燃气	32,200	221,858.00	0.06
486	688295	中复神鹰碳纤维	7,100	215,201.00	0.06
487	688105	诺唯赞生物	6,700	214,534.00	0.06
488	000031	大悦城	71,600	212,652.00	0.05
489	601061	中信金属	27,300	210,483.00	0.05
490	688819	天能电池集团股份	7,474	208,674.08	0.05
491	001872	招商港口	12,900	205,884.00	0.05
492	601158	重庆水务	31,800	180,306.00	0.05
493	600299	安迪苏	22,400	179,200.00	0.05
494	000553	安道麦A	24,000	166,560.00	0.04
495	688375	国博电子	2,000	159,060.00	0.04
496	600956	新天绿能	19,333	157,177.29	0.04
497	603355	莱克电气	6,342	141,426.60	0.04
498	603868	飞科电器	2,700	136,350.00	0.04
499	688248	南方电网电力科技	4,700	117,359.00	0.03
500	600032	浙江新能	12,000	96,720.00	0.02

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

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	688347	华虹半导体公司	10,078	423,880.68	0.11
2	002985	北摩高科	10,610	367,954.80	0.09
3	688549	中巨芯科技	22,501	187,893.41	0.05
4	301550	斯菱股份	2,600	119,857.40	0.03
5	688716	中研股份	2,668	104,555.63	0.03
6	688719	爱科赛博	1,616	103,112.08	0.03
7	301517	陕西华达	1,841	100,653.05	0.03
8	301500	飞南资源	4,550	98,243.60	0.03
9	301559	中集环科	4,581	86,113.08	0.02
10	688657	浩辰软件	1,008	82,656.17	0.02
11	301548	崇德科技	1,351	82,246.99	0.02
12	301529	福赛科技	1,816	72,009.06	0.02
13	301348	蓝箭电子	1,324	60,304.70	0.02
14	688443	智翔金泰	1,456	58,167.20	0.02
15	301383	天键股份	856	55,640.00	0.01
16	603193	润本生物技术股份	2,666	48,062.04	0.01
17	603075	热威科技股份	1,812	43,802.52	0.01
18	301421	波长光电	715	43,621.53	0.01
19	603273	天元智能	1,772	43,322.30	0.01
20	688548	广钢气体股份	3,330	42,973.65	0.01
21	301488	豪恩汽电	618	42,893.42	0.01
22	688627	精智达技术	444	39,271.80	0.01
23	688563	航空材料股份	602	36,628.69	0.01
24	688472	阿特斯阳光电力	2,866	36,197.58	0.01
25	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
26	603276	恒兴新材料科技	1,336	34,970.56	0.01
27	603296	华勤技术	438	34,619.46	0.01
28	301172	君逸数码	876	33,730.38	0.01
29	688591	泰凌微	1,098	31,342.41	0.01
30	688629	四川华丰	1,416	31,010.40	0.01

		科技			
31	301510	固高科技	857	30,455.35	0.01
32	688334	西高院	1,732	30,015.56	0.01
33	301509	金凯生科	477	29,910.30	0.01
34	301507	民生健康	1,709	27,645.35	0.01
35	301528	多浦乐	378	27,101.38	0.01
36	301525	儒竞科技	325	27,093.54	0.01
37	301262	海看股份	835	26,010.25	0.01
38	301225	恒勃股份	724	25,919.20	0.01
39	301251	威尔高	707	24,941.49	0.01
40	301320	豪江智能	1,316	24,306.52	0.01
41	301261	恒工精密	473	24,263.80	0.01
42	688620	安凯微电子	2,032	24,018.24	0.01
43	301315	威士顿	453	23,945.58	0.01
44	301393	昊帆生物	395	23,601.55	0.01
45	301272	英华特	429	23,140.66	0.01
46	301468	博盈特焊	750	22,766.25	0.01
47	301329	信音电子	977	21,962.64	0.01
48	301469	恒达新材	643	21,534.47	0.01
49	301376	致欧科技	892	21,336.64	0.01
50	301202	朗威股份	660	21,104.82	0.01
51	301519	舜禹股份	914	18,674.90	0.00
52	301355	南王科技	1,224	18,543.60	0.00
53	301170	锡南科技	596	18,136.28	0.00
54	688582	芯动联科	467	18,058.89	0.00
55	301505	苏州规划	434	15,683.14	0.00
56	300804	广康生化	457	14,103.02	0.00
57	603275	上海众辰科技	350	14,064.85	0.00
58	603270	金帝精密科技股份	443	13,381.70	0.00
59	301397	溯联股份	284	12,831.12	0.00
60	688631	莱斯信息	326	11,491.50	0.00
61	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
62	301511	德福科技	482	10,926.94	0.00
63	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
64	301498	乖宝宠物	266	10,323.46	0.00
65	301456	盘古智能	329	9,998.31	0.00
66	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
67	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
68	301232	飞沃科技	165	8,000.85	0.00
69	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00



70	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
71	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
72	688623	二元科技	103	7,310.94	0.00
73	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
74	400174	中天 3	283,500	2,835.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	2,248,134.00	0.53
2	601966	玲珑轮胎	1,847,628.00	0.43
3	002463	沪电股份	1,681,082.00	0.39
4	000066	中国长城	1,584,918.00	0.37
5	300394	天孚通信	1,538,770.08	0.36
6	002517	恺英网络	1,483,949.00	0.35
7	600372	中航机载	1,456,386.08	0.34
8	688072	拓荆科技	1,442,173.97	0.34
9	000423	东阿阿胶	1,400,254.00	0.33
10	688122	西部超导	1,387,802.32	0.32
11	000933	神火股份	1,310,898.00	0.31
12	301236	软通动力	1,309,790.00	0.31
13	300395	菲利华	1,285,910.29	0.30
14	002240	盛新锂能	1,274,867.00	0.30
15	300207	欣旺达	1,264,712.00	0.30
16	300601	康泰生物	1,220,635.00	0.29
17	000723	美锦能源	1,218,290.00	0.29
18	002008	大族激光	1,203,733.00	0.28
19	688120	华海清科	1,183,917.30	0.28
20	603882	金域医学	1,180,593.00	0.28

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	4,599,831.00	1.08
2	688256	寒武纪科技	2,209,505.03	0.52

3	600489	中金黄金	2,176,469.00	0.51
4	600372	中航机载	1,894,239.00	0.44
5	000807	云铝股份	1,773,431.00	0.42
6	603345	安井食品	1,767,585.00	0.41
7	688122	西部超导	1,764,192.56	0.41
8	600487	亨通光电	1,756,529.00	0.41
9	601607	上海医药	1,702,469.00	0.40
10	300832	新产业	1,609,499.20	0.38
11	688777	中控技术	1,596,174.44	0.37
12	000999	华润三九	1,588,192.00	0.37
13	002603	以岭药业	1,486,572.40	0.35
14	603606	东方电缆	1,407,422.00	0.33
15	603605	珀莱雅	1,375,303.80	0.32
16	601699	潞安环能	1,358,188.00	0.32
17	601872	招商轮船	1,313,152.00	0.31
18	603613	国联股份	1,295,262.80	0.30
19	600027	华电国际	1,273,188.00	0.30
20	600705	中航产融	1,261,268.00	0.30

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	148,279,062.49
卖出股票收入（成交）总额	161,014,813.21

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	3,154,018.53	0.81
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）	103,389.59	0.03
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-

11	合计	3,257,408.12	0.84
----	----	--------------	------

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019694	23 国债 01	21,000	2,140,800.99	0.55
2	019703	23 国债 10	6,000	608,518.36	0.16
3	019678	22 国债 13	4,000	404,699.18	0.10
4	118030	睿创转债	770	103,389.59	0.03

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，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，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市

场监督管理局及机关单位、交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	940,208.57
2	应收清算款	184.33
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	990,047.40
6	其他应收款	21,082.85
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,951,523.15

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	118030	睿创转债	103,389.59	0.03

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300502	新易盛	542,520.00	0.14	转融通出借流通受限
2	300418	昆仑万维	523,600.00	0.14	转融通出借流通受限
3	600157	永泰能源	506,900.00	0.13	转融通出借流通受限
4	000988	华工科技	496,992.00	0.13	转融通出

					借流通受限
5	000975	银泰黄金	480,000.00	0.12	转融通出借流通受限
6	601058	赛轮轮胎	453,550.00	0.12	转融通出借流通受限
7	002422	科伦药业	348,600.00	0.09	转融通出借流通受限
8	002463	沪电股份	305,256.00	0.08	转融通出借流通受限

### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688347	华虹半导体公司	423,880.68	0.11	新股流通受限
2	688549	中巨芯科技	18,550.37	0.00	新股流通受限
3	301550	斯菱股份	11,328.20	0.00	新股流通受限
4	688716	中研股份	9,716.13	0.00	新股流通受限

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 500 指数 (LOF) A	14,590	17,381.66	10,016,606.28	3.95	243,581,761.00	96.05
汇添富中	17,473	7,118.03	435,207.98	0.35	123,938,202.69	99.65

证 500 指数 (LOF) C						
合计	32,063	11,788.41	10,451,814.26	2.77	367,519,963.69	97.23

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	钟爱民	166,061.00	2.57
2	高明英	137,684.00	2.13
3	何涛	130,000.00	2.01
4	余建萍	125,322.00	1.94
5	王轶轮	104,512.00	1.62
6	毕艳	103,205.00	1.60
7	李峰	101,125.00	1.56
8	陈靖	99,412.00	1.54
9	沈雯	99,407.00	1.54
10	王文惠	92,793.00	1.44
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	黄晖	2,548,413.00	40.81
2	玉志	1,076,579.00	17.24
3	张炯	500,000.00	8.01
4	赵丽妹	200,018.00	3.20
5	欧阳东	150,000.00	2.40
6	周曲	121,506.00	1.95
7	吴斌珍	100,000.00	1.60
8	顾奔驰	99,018.00	1.59
9	钱中明	95,972.00	1.54
10	殷彭深	55,000.00	0.88

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

## 9.3 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 500 指数 (LOF) A	428,913.54	0.17
	汇添富中证 500 指数	2,795.85	0.00

	(LOF) C		
	合计	431,709.39	0.11

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) 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 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0

#### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

#### 9.6 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,002,700.27 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 08 月 10 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份额总额	257,196,188.48	137,618,839.08
本报告期基金总申购份额	89,212,899.64	189,723,494.92
减：本报告期基金总赎回份额	92,810,720.84	202,968,923.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	253,598,367.28	124,373,410.67

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

2023 年 7 月 23 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部副总经理职务，另有任用。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2017 年 08 月 10 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 50,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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况。

#### 11.6.2 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，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	



			(%)			
招商 证券	3	300,420,058.42	100.00	218,511.20	100.00	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商 名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
招商 证券	15,618,033.00	100.00	-	-	-	-	-	-

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：招商证券（北交所单元）。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 17 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第二季度报告	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 07 月 21 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 29 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 17 日
9	关于汇添富基金管理股份有限公司运用自有资金投资旗下基金的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年中期报告	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 08 月 31 日
11	关于汇添富基金管理股份有限公	上证报, 公司网站, 中	2023 年 09 月 04 日

	司终止与南京途牛基金销售有限公司合作关系的公告	中国证监会基金电子披露网站	
12	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与凤凰金信（海口）基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 12 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金销售费率并修订基金合同的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 26 日
14	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）更新法律文件	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 26 日
15	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第三季度报告	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 10 月 25 日
16	关于汇添富运用自有资金投资旗下基金的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 09 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）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 指数型发起式证券投资基金（LOF）在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 13.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2024 年 03 月 29 日