

# 汇添富上证综合指数证券投资基金 2024 年中 期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
§ 4 管理人报告 .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
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 .....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	18
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	18
§ 5 托管人报告 .....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	18
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 .....	18
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	18
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	19
6.1 资产负债表 .....	19
6.2 利润表 .....	20
6.3 净资产变动表 .....	21
6.4 报表附注 .....	23
§ 7 投资组合报告 .....	47
7.1 期末基金资产组合情况 .....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	48
7.3 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 .....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	74
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	74
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	74
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	74

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
7.12 投资组合报告附注.....	74
§ 8 基金份额持有人信息 .....	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	76
§ 9 开放式基金份额变动 .....	77
§ 10 重大事件揭示 .....	77
10.1 基金份额持有人大会决议.....	77
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
10.4 基金投资策略的改变.....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
10.8 其他重大事件.....	82
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	83
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§ 12 备查文件目录 .....	83
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点 .....	83
12.3 查阅方式 .....	83

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合指数证券投资基金	
基金简称	汇添富上证综合指数	
基金主代码	470007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 07 月 01 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	957,914,328.34	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C
下属分级基金的交易代码	470007	018536
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	888,527,673.13	69,386,655.21

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 6%，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。本基金的投资策略主要包括：资产配置、抽样股票组合构建、股票组合调整、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	上证综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

## 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	(010) 66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	(010) 66105798
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		李文	廖林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路728号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日 - 2024年06月30日)	
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C
本期已实现收益	6,781,200.02	402,290.91
本期利润	22,799,875.31	950,977.02
加权平均基金份额本期利润	0.0259	0.0258

本期加权平均净值利润率	2.58%	2.59%
本期基金份额净值增长率	2.34%	2.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)	
期末可供分配利润	4,785,984.09	31,286.57
期末可供分配基金份额利润	0.0054	0.0005
期末基金资产净值	893,313,657.22	69,417,941.78
期末基金份额净值	1.005	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	34.55%	-5.02%

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

汇添富上证综合指数 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.62%	0.53%	-3.68%	0.52%	1.06%	0.01%
过去三个月	-0.40%	0.67%	-2.29%	0.69%	1.89%	-0.02%
过去六个月	2.34%	0.88%	-0.21%	0.91%	2.55%	-0.03%
过去一年	-3.18%	0.78%	-6.92%	0.80%	3.74%	-0.02%
过去三	-9.91%	0.87%	-16.41%	0.88%	6.50%	-0.01%

年						
自基金合同生效日起至今	34.55%	1.24%	2.02%	1.23%	32.53%	0.01%
汇添富上证综合指数 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.63%	0.54%	-3.68%	0.52%	1.05%	0.02%
过去三个月	-0.50%	0.67%	-2.29%	0.69%	1.79%	-0.02%
过去六个月	2.04%	0.88%	-0.21%	0.91%	2.25%	-0.03%
过去一年	-3.66%	0.78%	-6.92%	0.80%	3.26%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-5.02%	0.77%	-9.11%	0.79%	4.09%	-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

汇添富上证综合指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2009年07月01日）起3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金于 2023 年 05 月 19 日新增 C 类份额。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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、汇添富投资管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2024 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金，包括 12 只股票型基金、9 只债券型基金、1 只混合型基金。截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 336 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2010 年 02 月 06 日	-	18	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

				<p>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。</p> <p>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</p>
--	--	--	--	---

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

				<p>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2024年4月26日任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理。2019年7月26日至2022年6月13日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年9月24日至2022年6月13日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年11月6日至2022年6月13日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年3月5日至</p>
--	--	--	--	--

				<p>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。</p> <p>2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至今任汇</p>
--	--	--	--	---

					<p>添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 22 日至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。2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳丰回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，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。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 6 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

国家统计局数据显示，2024 年上半年 GDP 同比增长 5.0%。分项来看，社会消费品零售总额同比增长 3.7%；固定资产投资同比增长 3.9%；货物进出口总额同比增长 6.1%。宏观经济整体呈现回升向好态势，经济运行中积极因素增多，动能持续增强，社会预期改善，高质

量发展扎实推进，呈现增长较快、结构优化、质效向好的特征。但另一方面，宏观经济仍面临诸多挑战，主要是有效需求仍然不足，企业经营压力较大，重点领域风险隐患较多，国内大循环不够顺畅，外部环境复杂性、严峻性、不确定性明显上升。

上半年权益市场以震荡行情为主。风格上来看，大中盘表现优于小微盘，小微盘股票波动程度较大；价值、红利优于成长。行业主题方面，能源、有色、银行、电力等行业表现较为稳定，相对于市场取得了较高的超额收益；多数行业仍延续调整。上证指数是 A 股市场代表性宽基指数，汇添富上证综合指数证券投资基金则是这一代表性指数的产品化形式，为投资者提供了整体配置国内权益资产的优质工具。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富上证综合指数 A 类份额净值增长率为 2.34%，同期业绩比较基准收益率为-0.21%。本报告期汇添富上证综合指数 C 类份额净值增长率为 2.04%，同期业绩比较基准收益率为-0.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，党的二十届三中全会将对进一步全面深化改革、推进中国式现代化作出战略部署。随着宏观政策不断落地显效，国内经济有望实现稳健高质量增长。当下，A 股已体现出不错的估值性价比，随着后续市场风险偏好的改善，或有望迎来估值修复。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估

值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金同一类别内每一基金份额享有同等分配权；收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转帐或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额；本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次至少将可供分配利润的 20% 进行收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类基金份额净值自动转为相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；在符合上述基金收益分配的前提下，每年度 6 月和 12 月的最后一个交易日每份基金份额可供分配利润超过 0.02 元时，至少将期末可供分配利润的 20% 进行收益分配，且在收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）之后的 15 个工作日之内完成；基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中

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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	55,881,222.18	45,401,172.83
结算备付金		64,226.47	1,970,778.91
存出保证金		39,253.73	22,649.88
交易性金融资产	6.4.7.2	908,700,613.99	831,070,055.74
其中：股票投资		908,700,613.99	825,769,024.73
基金投资		-	-
债券投资		-	5,301,031.01
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,983,056.89	1,748,061.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		971,668,373.26	880,212,719.23
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		5,217,894.26	-
应付赎回款		2,860,172.97	2,058,540.76
应付管理人报酬		582,589.40	541,805.83
应付托管费		116,517.87	108,361.17
应付销售服务费		17,980.23	7,773.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	141,619.53	695,451.69
负债合计		8,936,774.26	3,411,932.95
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	957,914,328.34	892,624,305.06
未分配利润	6.4.7.9	4,817,270.66	-15,823,518.78
净资产合计		962,731,599.00	876,800,786.28
负债和净资产总计		971,668,373.26	880,212,719.23

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 957,914,328.34 份。本基金下属汇添富上证综合指数 A 基金份额净值 1.005 元，基金份额总额 888,527,673.13 份；本基金下属汇添富上证综合指数 C 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 69,386,655.21 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>28,031,737.07</b>	<b>41,791,035.96</b>
1. 利息收入		96,937.14	77,580.65
其中：存款利息收入	6.4.7.10	96,937.14	77,580.65
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		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,156,068.60	12,489,138.54
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-1,381,787.73	3,535,802.38
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,908.99	21,917.26
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-

股利收益	6.4.7.17	12,527,947.34	8,931,418.90
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	16,567,361.40	29,050,930.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	211,369.93	173,386.32
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>4,280,884.74</b>	<b>3,664,798.38</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,429,776.79	2,970,585.33
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	685,955.35	594,117.16
3. 销售服务费		73,835.60	193.92
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	91,317.00	99,901.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>23,750,852.33</b>	<b>38,126,237.58</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>23,750,852.33</b>	<b>38,126,237.58</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>23,750,852.33</b>	<b>38,126,237.58</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	892,624,305.06	-15,823,518.78	876,800,786.28
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	892,624,305.06	-15,823,518.78	876,800,786.28
三、本期增减变	65,290,023.28	20,640,789.44	85,930,812.72

动额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	23,750,852.33	23,750,852.33
（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）	65,290,023.28	-3,110,062.89	62,179,960.39
其中：1. 基金申购款	413,793,455.71	-1,782,428.33	412,011,027.38
2. 基金赎回款	-348,503,432.43	-1,327,634.56	-349,831,066.99
（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	957,914,328.34	4,817,270.66	962,731,599.00
项目	上年度可比期间		
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	788,438,630.11	891,344.88	789,329,974.99
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	788,438,630.11	891,344.88	789,329,974.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,595,291.07	37,196,302.81	19,601,011.74
（一）、综合收益总额	-	38,126,237.58	38,126,237.58
（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）	-17,595,291.07	-929,934.77	-18,525,225.84
其中：1. 基金申购款	131,587,469.50	6,966,726.25	138,554,195.75
2. 基金赎回款	-149,182,760.57	-7,896,661.02	-157,079,421.59
（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	770,843,339.04	38,087,647.69	808,930,986.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富上证综合指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]371号文《关于核准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的批复》准予注册，由汇添富基金管理有限公司（现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 2009 年 7 月 1 日生效。首次设立基金募集规模为 9,097,758,651.47 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（2009）验字第 60466941\_B02 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自 2023 年 5 月 19 日起，本基金增设 C 类基金份额，原基金份额变更为 A 类基金份额，基金注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司。

本基金的标的指数为上证综合指数。本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股（如一级市场初次发行或增发）、存托凭证等，其中股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 90%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。投资于标的指数成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%（但因法律法规限制原因导致本基金不能投资相关股票而致使本基金不能达到上述比例的情形除外）。今后如果法律法规允许，本基金的股票及存托凭证投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。如以

后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具，如股指期货、ETF 等，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，将其纳入投资范围。今后在有关法律法规许可时，本基金资产配置比例可作相应调整，股票资产及存托凭证投资比例可达到法律法规有关规定的限额。本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 6%，以实现对基准指数的有效跟踪。本基金的业绩比较基准为：上证综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；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）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

## 2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都

应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 5. 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
	2024 年 06 月 30 日
活期存款	55,881,222.18
等于：本金	55,875,152.11
加：应计利息	6,070.07
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	55,881,222.18

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	899,629,381.69	-	908,700,613.99	9,071,232.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	899,629,381.69	-	908,700,613.99	9,071,232.30

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	727.28
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	49,892.25
其中：交易所市场	49,892.25
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	31,327.66
应付信息披露费	59,672.34
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
其他	-
合计	141,619.53

### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富上证综合指数 A		
项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	865,474,870.80	865,474,870.80
本期申购	191,898,140.40	191,898,140.40
本期赎回（以“-”号填列）	-168,845,338.07	-168,845,338.07
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	888,527,673.13	888,527,673.13
汇添富上证综合指数 C		
项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,149,434.26	27,149,434.26
本期申购	221,895,315.31	221,895,315.31
本期赎回（以“-”号填列）	-179,658,094.36	-179,658,094.36
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	69,386,655.21	69,386,655.21

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富上证综合指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	327,380,293.89	-342,651,125.56	-15,270,831.67
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	327,380,293.89	-342,651,125.56	-15,270,831.67
本期利润	6,781,200.02	16,018,675.29	22,799,875.31
本期基金份额交易产生的变动数	8,825,378.88	-11,568,438.43	-2,743,059.55
其中：基金申购款	72,516,080.29	-74,908,543.64	-2,392,463.35
基金赎回款	-63,690,701.41	63,340,105.21	-350,596.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	342,986,872.79	-338,200,888.70	4,785,984.09
汇添富上证综合指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,187,180.89	-10,739,868.00	-552,687.11
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	10,187,180.89	-10,739,868.00	-552,687.11
本期利润	402,290.91	548,686.11	950,977.02
本期基金份额交易产生的变动数	15,828,000.60	-16,195,003.94	-367,003.34
其中：基金申购款	82,876,506.56	-82,266,471.54	610,035.02
基金赎回款	-67,048,505.96	66,071,467.60	-977,038.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,417,472.40	-26,386,185.83	31,286.57

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	94,498.29
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	2,103.13
其他	335.72
合计	96,937.14

注：“其他”为结算保证金利息收入。

### 6.4.7.11 股票投资收益

#### 6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	52,224,021.80
减：卖出股票成本总额	53,442,073.44
减：交易费用	163,736.09
买卖股票差价收入	-1,381,787.73

### 6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	4,008.99
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	5,900.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,908.99

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	5,304,520.00
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	5,194,100.00
减：应计利息总额	104,520.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	5,900.00

### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	12,527,947.34
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,527,947.34

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1. 交易性金融资产	16,567,361.40
——股票投资	16,573,781.40
——债券投资	-6,420.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	16,567,361.40

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	211,369.93
替代损益	-
其他	-
合计	211,369.93

## 6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	31,327.66
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	317.00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	-
合计	91,317.00

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

根据《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《基金管理公司子公司管理规定》等法律法规的有关规定，经中国证券监督管理委员会同意，汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）已受让汇添富资本管理有限公司持有的汇添富投资管理有限公司（以下简称“汇添富投资”）全部股权。汇添富投资已由本公司的“全资子公司的全资子公司”变更为“全资子公司”。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	6,681,642.27	3.88	-	-

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 基金交易

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。

##### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	4,916.76	3.88	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
	-	-	-	-

注：上述佣金的计算方式按相关协议约定的佣金率计算。上述佣金与应支付非关联方交易佣金的计算方式、佣金计算比率不存在差异，具有公允性。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（被动股票型基金不适用）。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,429,776.79	2,970,585.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,173,844.58	1,019,077.30
应支付基金管理人的净管理费	2,255,932.21	1,951,508.03

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	685,955.35	594,117.16

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

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，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	3,372.03	3,372.03
合计	-	3,372.03	3,372.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	0.95	0.95
合计	-	0.95	0.95

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.4%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	55,881,222.18	94,498.29	57,615,520.89	77,266.58

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

#### 6.4.12 期末(2024年06月30日)本基金持有的流通受限证券

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

注:本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注:截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止,本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构,并明确了相应的风险管理职能。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任,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。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	55,881,222.18	-	-	-	-	-	55,881,222.18
结算备付金	64,226.47	-	-	-	-	-	64,226.47
存出保证金	39,253.73	-	-	-	-	-	39,253.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	908,700,613.99	908,700,613.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
负债	-	-	-	-	-	-	-

投资							
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	6,983,056.89	6,983,056.89
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	55,984,702.38	-	-	-	-	915,683,670.88	971,668,373.26
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	-	-	-	-	-	5,217,894.26	5,217,894.26
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,860,172.97	2,860,172.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	582,589.40	582,589.40
应付托管	-	-	-	-	-	116,517.87	116,517.87

费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,980.23	17,980.23
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	141,619.53	141,619.53
负债总计	-	-	-	-	-	8,936,774.26	8,936,774.26
利率敏感度缺口	55,984,702.38	-	-	-	-	906,746,896.62	962,731,599.00
上年度末 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	45,401,172.83	-	-	-	-	-	45,401,172.83
结算备付金	1,970,778.91	-	-	-	-	-	1,970,778.91
存出保证金	22,649.88	-	-	-	-	-	22,649.88
交易性金融资产	5,301,031.01	-	-	-	-	825,769,024.73	831,070,055.74

衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,748,061.87	1,748,061.87
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	52,695,632.63	-	-	-	-	827,517,086.60	880,212,719.23
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	-	-	-	-	-	2,058,540.76	2,058,540.76

赎回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	541,805.83	541,805.83
应付托管费	-	-	-	-	-	108,361.17	108,361.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,773.50	7,773.50
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	695,451.69	695,451.69
负债总计	-	-	-	-	-	3,411,932.95	3,411,932.95
利率敏感度缺口	52,695,632.63	-	-	-	-	824,105,153.65	876,800,786.28

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	-	534.41
	基准利率增加 25 个基点	-	-534.30

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	908,700,613.99	94.39	825,769,024.73	94.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	5,301,031.01	0.60
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	908,700,613.99	94.39	831,070,055.74	94.78

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	上证综合指数 上涨 5%	44,209,612.24	41,029,369.56
	上证综合指数 下跌 5%	-44,209,612.24	-41,029,369.56

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日
第一层次	908,700,613.99
第二层次	-
第三层次	-

合计	908,700,613.99
----	----------------

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	908,700,613.99	93.52
	其中：股票	908,700,613.99	93.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	55,945,448.65	5.76
8	其他各项资产	7,022,310.62	0.72
9	合计	971,668,373.26	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末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	2,270,775.55	0.24
B	采矿业	98,462,693.80	10.23
C	制造业	364,674,019.18	37.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,021,708.46	5.92
E	建筑业	22,511,642.48	2.34
F	批发和零售业	15,034,767.30	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	50,620,250.64	5.26
H	住宿和餐饮业	456,681.54	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,526,520.76	4.00
J	金融业	224,581,491.56	23.33
K	房地产业	8,635,272.88	0.90
L	租赁和商务服务业	7,441,960.30	0.77
M	科学研究和技术服务业	3,530,140.61	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	4,460,673.80	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,335,715.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	8,904,551.90	0.92
S	综合	-	-
	合计	908,468,865.76	94.36

### 7.2.2 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	226,278.15	0.02
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	-	-

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	5,470.08	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	231,748.23	0.02

### 7.2.3 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。

### 7.3 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

#### 7.3.1 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	601288	农业银行	8,968,673	39,103,414.28	4.06
2	600519	贵州茅台	24,362	35,748,555.18	3.71
3	601857	中国石油	3,273,257	33,780,012.24	3.51
4	601988	中国银行	6,353,811	29,354,606.82	3.05
5	601088	中国神华	327,915	14,549,588.55	1.51
6	600036	招商银行	413,915	14,151,753.85	1.47
7	600900	长江电力	484,111	14,000,490.12	1.45

8	601628	中国人寿	419,271	13,018,364.55	1.35
9	600028	中国石化	1,885,877	11,918,742.64	1.24
10	601939	建设银行	1,553,911	11,498,941.40	1.19
11	601138	工业富联	399,700	10,951,780.00	1.14
12	601728	中国电信	1,569,100	9,649,965.00	1.00
13	601318	中国平安	216,823	8,967,799.28	0.93
14	601658	邮储银行	1,561,568	7,917,149.76	0.82
15	601899	紫金矿业	423,542	7,441,632.94	0.77
16	601166	兴业银行	411,806	7,256,021.72	0.75
17	601328	交通银行	768,717	5,742,315.99	0.60
18	600030	中信证券	307,950	5,613,928.50	0.58
19	600309	万华化学	66,011	5,337,649.46	0.55
20	601816	京沪高铁	981,400	5,270,118.00	0.55
21	600809	山西汾酒	23,856	5,030,753.28	0.52
22	601225	陕西煤业	193,381	4,983,428.37	0.52
23	600276	恒瑞医药	126,592	4,868,728.32	0.51
24	600000	浦发银行	579,592	4,770,042.16	0.50
25	601668	中国建筑	881,385	4,680,154.35	0.49
26	601998	中信银行	671,372	4,498,192.40	0.47
27	601919	中远海控	272,948	4,227,964.52	0.44
28	600406	国电南瑞	162,406	4,053,653.76	0.42
29	601985	中国核电	372,300	3,968,718.00	0.41

30	603288	海天味业	114,060	3,931,648.20	0.41
31	600025	华能水电	357,700	3,856,006.00	0.40
32	601601	中国太保	137,178	3,821,779.08	0.40
33	601319	中国人保	711,800	3,665,770.00	0.38
34	601766	中国中车	485,961	3,649,567.11	0.38
35	600150	中国船舶	88,600	3,606,906.00	0.37
36	600690	海尔智家	125,000	3,547,500.00	0.37
37	600887	伊利股份	132,461	3,422,792.24	0.36
38	600104	上汽集团	232,100	3,216,906.00	0.33
39	688041	海光信息	44,200	3,108,144.00	0.32
40	601633	长城汽车	121,625	3,077,112.50	0.32
41	603993	洛阳钼业	358,039	3,043,331.50	0.32
42	600050	中国联通	646,642	3,039,217.40	0.32
43	600019	宝钢股份	456,155	3,033,430.75	0.32
44	601818	光大银行	924,867	2,931,828.39	0.30
45	600031	三一重工	174,094	2,872,551.00	0.30
46	600919	江苏银行	384,540	2,857,132.20	0.30
47	600018	上港集团	473,590	2,737,350.20	0.28
48	601390	中国中铁	415,628	2,709,894.56	0.28
49	600886	国投电力	147,505	2,690,491.20	0.28
50	601127	赛力斯	29,300	2,669,816.00	0.28
51	600016	民生银行	702,508	2,662,505.32	0.28

52	600989	宝丰能源	146,200	2,533,646.00	0.26
53	601888	中国中免	40,005	2,499,912.45	0.26
54	600436	片仔癀	12,037	2,493,705.29	0.26
55	601066	中信建投	129,390	2,489,463.60	0.26
56	600905	三峡能源	570,900	2,489,124.00	0.26
57	601169	北京银行	423,672	2,474,244.48	0.26
58	603501	韦尔股份	24,520	2,436,552.40	0.25
59	603556	海兴电力	51,800	2,425,794.00	0.25
60	601898	中煤能源	182,887	2,282,429.76	0.24
61	601009	南京银行	218,876	2,274,121.64	0.24
62	601989	中国重工	449,529	2,216,177.97	0.23
63	600760	中航沈飞	55,252	2,215,605.20	0.23
64	601012	隆基绿能	155,759	2,183,741.18	0.23
65	601229	上海银行	300,206	2,179,495.56	0.23
66	688256	寒武纪科技	10,900	2,165,503.00	0.22
67	600015	华夏银行	333,681	2,135,558.40	0.22
68	601006	大秦铁路	295,344	2,114,663.04	0.22
69	601800	中国交建	236,439	2,113,764.66	0.22
70	600188	兖矿能源	92,825	2,109,912.25	0.22
71	688111	金山办公	9,260	2,106,650.00	0.22
72	600011	华能国际	218,496	2,101,931.52	0.22
73	600048	保利发展	239,469	2,097,748.44	0.22

74	603259	药明康德	53,220	2,085,691.80	0.22
75	603661	恒林股份	49,300	2,080,953.00	0.22
76	600999	招商证券	148,286	2,062,658.26	0.21
77	603195	公牛集团	26,742	2,062,343.04	0.21
78	600795	国电电力	342,528	2,051,742.72	0.21
79	601211	国泰君安	147,700	2,001,335.00	0.21
80	600346	恒力石化	143,389	2,000,276.55	0.21
81	600585	海螺水泥	83,981	1,981,111.79	0.21
82	601600	中国铝业	259,565	1,980,480.95	0.21
83	601186	中国铁建	230,459	1,975,033.63	0.21
84	600547	山东黄金	72,090	1,973,824.20	0.21
85	600893	航发动力	53,652	1,960,980.60	0.20
86	600941	中国移动	18,100	1,945,750.00	0.20
87	601669	中国电建	344,783	1,927,336.97	0.20
88	600282	南钢股份	383,100	1,907,838.00	0.20
89	600761	安徽合力	86,900	1,880,516.00	0.20
90	600362	江西铜业	79,032	1,871,477.76	0.19
91	600642	申能股份	210,180	1,855,889.40	0.19
92	600575	淮河能源	472,400	1,837,636.00	0.19
93	688271	联影医疗	16,700	1,831,990.00	0.19
94	600219	南山铝业	479,149	1,825,557.69	0.19
95	600438	通威股份	95,185	1,818,985.35	0.19

96	600489	中金黄金	122,543	1,813,636.40	0.19
97	605499	东鹏饮料	8,400	1,812,300.00	0.19
98	600023	浙能电力	254,479	1,809,345.69	0.19
99	601688	华泰证券	145,960	1,808,444.40	0.19
100	688036	传音控股	23,583	1,805,042.82	0.19
101	688012	中微半导体设备	12,531	1,770,129.06	0.18
102	600183	生益科技	83,653	1,761,732.18	0.18
103	688981	中芯国际	38,200	1,761,020.00	0.18
104	603408	建霖家居	133,200	1,756,908.00	0.18
105	601168	西部矿业	97,600	1,751,920.00	0.18
106	600483	福能股份	150,100	1,750,166.00	0.18
107	600875	东方电气	94,799	1,749,041.55	0.18
108	605117	德业股份	23,440	1,742,529.60	0.18
109	601111	中国国航	235,281	1,736,373.78	0.18
110	601995	中金公司	58,500	1,732,185.00	0.18
111	600660	福耀玻璃	36,130	1,730,627.00	0.18
112	603392	万泰生物	26,205	1,726,385.40	0.18
113	600373	中文传媒	114,662	1,701,584.08	0.18
114	600674	川投能源	90,700	1,700,625.00	0.18
115	600863	内蒙华电	366,100	1,698,704.00	0.18
116	603323	苏农银行	352,500	1,695,525.00	0.18
117	600970	中材国	139,200	1,678,752.00	0.17

		际			
118	600098	广州发展	261,900	1,676,160.00	0.17
119	600368	五洲交通	468,250	1,671,652.50	0.17
120	600323	瀚蓝环境	79,192	1,655,112.80	0.17
121	600926	杭州银行	126,680	1,653,174.00	0.17
122	600100	同方股份	324,622	1,652,325.98	0.17
123	600837	海通证券	192,386	1,646,824.16	0.17
124	601107	四川成渝	312,300	1,639,575.00	0.17
125	601058	赛轮轮胎	117,100	1,639,400.00	0.17
126	601838	成都银行	107,900	1,639,001.00	0.17
127	600461	洪城环境	141,100	1,633,938.00	0.17
128	601298	青岛港	169,100	1,616,596.00	0.17
129	603871	嘉友国际	91,120	1,611,912.80	0.17
130	600009	上海机场	49,565	1,598,471.25	0.17
131	600029	南方航空	269,841	1,589,363.49	0.17
132	600897	厦门空港	124,820	1,573,980.20	0.16
133	601018	宁波港	459,574	1,562,551.60	0.16
134	601827	三峰环境	181,900	1,544,331.00	0.16
135	601916	浙商银行	556,443	1,535,782.68	0.16
136	603855	华荣股份	69,100	1,527,801.00	0.16
137	600269	赣粤高速	294,500	1,522,565.00	0.16
138	688766	普冉半导体	15,640	1,519,738.80	0.16
139	600997	开滦股份	220,700	1,514,002.00	0.16

140	601077	渝农商行	301,478	1,513,419.56	0.16
141	601717	郑煤机	101,300	1,499,240.00	0.16
142	688223	晶科能源	210,080	1,491,568.00	0.15
143	601137	博威合金	97,400	1,484,376.00	0.15
144	601881	中国银河	136,604	1,483,519.44	0.15
145	600845	宝信软件	46,440	1,482,829.20	0.15
146	603019	中科曙光	35,700	1,481,550.00	0.15
147	603111	康尼机电	253,300	1,474,206.00	0.15
148	603365	水星家纺	93,900	1,469,535.00	0.15
149	600480	凌云股份	149,200	1,466,636.00	0.15
150	601231	环旭电子	91,378	1,466,616.90	0.15
151	600582	天地科技	212,300	1,462,747.00	0.15
152	600233	圆通速递	93,100	1,457,015.00	0.15
153	601117	中国化学	176,727	1,456,230.48	0.15
154	603889	新澳股份	188,080	1,455,739.20	0.15
155	603338	浙江鼎力	24,093	1,455,699.06	0.15
156	601019	山东出版	122,700	1,450,314.00	0.15
157	600177	雅戈尔	202,391	1,441,023.92	0.15
158	601860	紫金银行	575,400	1,438,500.00	0.15
159	600115	中国东航	358,026	1,435,684.26	0.15
160	601222	林洋能源	227,900	1,428,933.00	0.15
161	600843	上工申贝	192,500	1,428,350.00	0.15
162	600039	四川路	181,000	1,428,090.00	0.15

		桥			
163	601577	长沙银行	173,700	1,420,866.00	0.15
164	600985	淮北矿业	84,800	1,419,552.00	0.15
165	600820	隧道股份	214,800	1,402,644.00	0.15
166	600035	楚天高速	325,200	1,395,108.00	0.14
167	600522	中天科技	87,573	1,388,032.05	0.14
168	600033	福建高速	412,300	1,381,205.00	0.14
169	688169	石头科技	3,511	1,378,418.60	0.14
170	603067	振华股份	118,100	1,377,046.00	0.14
171	601808	中海油服	79,797	1,372,508.40	0.14
172	603726	朗迪集团	101,900	1,365,460.00	0.14
173	600348	华阳股份	136,900	1,363,524.00	0.14
174	600803	新奥股份	65,400	1,360,320.00	0.14
175	600908	无锡银行	255,500	1,359,260.00	0.14
176	603236	移远通信	28,900	1,350,497.00	0.14
177	600089	特变电工	97,209	1,348,288.83	0.14
178	603650	彤程新材	45,400	1,341,570.00	0.14
179	601607	上海医药	70,195	1,341,426.45	0.14
180	603367	辰欣药业	96,000	1,338,240.00	0.14
181	600377	宁沪高速	105,910	1,334,466.00	0.14
182	600549	厦门钨业	77,200	1,331,700.00	0.14
183	600600	青岛啤酒	18,251	1,328,125.27	0.14

184	688008	澜起科技	23,233	1,327,998.28	0.14
185	600901	江苏金租	262,300	1,324,615.00	0.14
186	600064	南京高科	217,800	1,322,046.00	0.14
187	600332	白云山	44,877	1,316,242.41	0.14
188	601113	华鼎股份	399,800	1,311,344.00	0.14
189	601866	中远海发	504,800	1,302,384.00	0.14
190	601369	陕鼓动力	161,800	1,297,636.00	0.13
191	603878	武进不锈	198,300	1,296,882.00	0.13
192	600021	上海电力	130,900	1,294,601.00	0.13
193	600132	重庆啤酒	21,300	1,292,910.00	0.13
194	600020	中原高速	363,700	1,287,498.00	0.13
195	600548	深高速	121,000	1,286,230.00	0.13
196	600885	宏发股份	46,374	1,283,632.32	0.13
197	600420	国药现代	120,100	1,282,668.00	0.13
198	600528	中铁工业	174,800	1,279,536.00	0.13
199	601878	浙商证券	119,098	1,276,730.56	0.13
200	600497	驰宏锌锗	238,785	1,275,111.90	0.13
201	603970	中农立华	74,540	1,273,143.20	0.13
202	600979	广安爱众	378,800	1,272,768.00	0.13
203	600566	济川药业	40,100	1,271,571.00	0.13
204	601966	玲珑轮胎	69,217	1,271,516.29	0.13
205	603809	豪能股份	156,412	1,263,808.96	0.13
206	603225	新凤鸣	80,800	1,259,672.00	0.13

207	600469	风神股份	214,700	1,253,848.00	0.13
208	601997	贵阳银行	237,500	1,251,625.00	0.13
209	600123	兰花科创	139,260	1,246,377.00	0.13
210	600704	物产中大	286,992	1,245,545.28	0.13
211	600717	天津港	291,500	1,244,705.00	0.13
212	601000	唐山港	264,600	1,243,620.00	0.13
213	600741	华域汽车	75,450	1,235,871.00	0.13
214	603327	福蓉科技	94,210	1,214,366.90	0.13
215	600584	长电科技	38,271	1,213,573.41	0.13
216	601698	中国卫通	86,100	1,213,149.00	0.13
217	688019	安集科技	9,609	1,208,812.20	0.13
218	600057	厦门象屿	177,700	1,208,360.00	0.13
219	688188	上海柏楚电子科技	6,500	1,199,575.00	0.12
220	603611	诺力股份	70,300	1,197,912.00	0.12
221	600598	北大荒	94,895	1,185,238.55	0.12
222	603986	兆易创新	12,380	1,183,775.60	0.12
223	601868	中国能建	558,274	1,183,540.88	0.12
224	600536	中国软件	39,538	1,182,976.96	0.12
225	600210	紫江企业	221,700	1,179,444.00	0.12
226	603707	健友股份	99,196	1,178,448.48	0.12
227	601139	深圳燃气	176,100	1,176,348.00	0.12
228	600755	厦门国贸	163,600	1,173,012.00	0.12
229	601512	中新集	153,800	1,171,956.00	0.12

		团			
230	600742	一汽富维	156,600	1,166,670.00	0.12
231	600529	山东药玻	46,025	1,166,273.50	0.12
232	600623	华谊集团	200,600	1,159,468.00	0.12
233	601518	吉林高速	472,900	1,153,876.00	0.12
234	601311	骆驼股份	143,800	1,153,276.00	0.12
235	603899	晨光股份	36,800	1,151,104.00	0.12
236	601788	光大证券	78,438	1,146,763.56	0.12
237	601811	新华文轩	81,700	1,144,617.00	0.12
238	600380	健康元	102,300	1,142,691.00	0.12
239	603606	东方电缆	23,400	1,142,154.00	0.12
240	600750	江中药业	48,900	1,130,079.00	0.12
241	603321	梅轮电梯	165,400	1,129,682.00	0.12
242	601158	重庆水务	235,264	1,129,267.20	0.12
243	600017	日照港	422,600	1,128,342.00	0.12
244	688268	广东华特气体	21,800	1,125,098.00	0.12
245	603893	瑞芯微	19,000	1,124,230.00	0.12
246	605088	冠盛股份	53,900	1,123,276.00	0.12
247	603579	荣泰健康	72,520	1,121,159.20	0.12
248	603308	应流股份	90,000	1,117,800.00	0.12
249	600909	华安证券	264,850	1,115,018.50	0.12
250	601238	广汽集团	144,056	1,114,993.44	0.12
251	601689	拓普集团	20,762	1,113,050.82	0.12
252	600352	浙江龙	129,522	1,112,593.98	0.12

		盛			
253	600995	南网储能	115,000	1,110,900.00	0.12
254	603228	景旺电子	34,700	1,103,460.00	0.11
255	600176	中国巨石	99,740	1,102,127.00	0.11
256	601677	明泰铝业	95,200	1,100,512.00	0.11
257	600928	西安银行	336,200	1,099,374.00	0.11
258	600499	科达制造	130,400	1,099,272.00	0.11
259	688617	惠泰医疗	2,400	1,094,640.00	0.11
260	600757	长江传媒	135,707	1,093,798.42	0.11
261	601360	三六零	141,600	1,087,488.00	0.11
262	600097	开创国际	131,900	1,085,537.00	0.11
263	601882	海天精工	47,100	1,079,061.00	0.11
264	603368	柳药集团	61,600	1,078,000.00	0.11
265	603658	安图生物	23,300	1,073,431.00	0.11
266	600611	大众交通	382,900	1,068,291.00	0.11
267	600835	上海机电	92,700	1,066,977.00	0.11
268	600308	华泰股份	339,800	1,066,972.00	0.11
269	600621	华鑫股份	86,700	1,062,942.00	0.11
270	600998	九州通	217,634	1,062,053.92	0.11
271	600330	天通股份	154,700	1,051,960.00	0.11
272	601990	南京证券	136,916	1,051,514.88	0.11
273	603369	今世缘	22,700	1,048,740.00	0.11
274	600713	南京医药	248,400	1,048,248.00	0.11
275	601198	东兴证	131,398	1,045,928.08	0.11

		券			
276	600426	华鲁恒升	39,260	1,045,886.40	0.11
277	601108	财通证券	158,150	1,045,371.50	0.11
278	600061	国投资本	184,713	1,043,628.45	0.11
279	688187	时代电气	21,100	1,041,918.00	0.11
280	603129	春风动力	7,300	1,039,082.00	0.11
281	601877	正泰电器	54,362	1,036,139.72	0.11
282	603010	万盛股份	114,600	1,032,546.00	0.11
283	603260	合盛硅业	22,000	1,027,620.00	0.11
284	603816	顾家家居	31,800	1,026,822.00	0.11
285	600229	城市传媒	148,100	1,020,409.00	0.11
286	688128	中国电器研究院	59,277	1,020,157.17	0.11
287	600395	盘江股份	167,800	1,008,478.00	0.10
288	688018	乐鑫科技	10,173	1,003,871.64	0.10
289	603898	好莱客	136,500	1,003,275.00	0.10
290	600363	联创光电	36,400	1,001,728.00	0.10
291	601016	节能风电	334,300	999,557.00	0.10
292	688200	华峰测控	10,862	996,588.50	0.10
293	600612	老凤祥	17,104	995,281.76	0.10
294	600703	三安光电	84,862	994,582.64	0.10
295	603928	兴业股份	126,670	991,826.10	0.10
296	603053	成都燃气	102,200	987,252.00	0.10
297	601101	昊华能	107,200	985,168.00	0.10

		源			
298	688625	呈和科技	27,027	982,701.72	0.10
299	600109	国金证券	129,970	981,273.50	0.10
300	600372	中航机载	81,809	979,253.73	0.10
301	603198	迎驾贡酒	16,900	971,750.00	0.10
302	601699	潞安环能	53,505	970,045.65	0.10
303	603309	维力医疗	88,000	968,880.00	0.10
304	601963	重庆银行	125,000	968,750.00	0.10
305	603506	南都物业	115,600	968,728.00	0.10
306	600298	安琪酵母	34,600	966,378.00	0.10
307	603605	珀莱雅	8,704	966,056.96	0.10
308	600390	五矿资本	238,380	965,439.00	0.10
309	601799	星宇股份	8,600	963,544.00	0.10
310	600010	包钢股份	687,780	962,892.00	0.10
311	603301	振德医疗	46,100	961,646.00	0.10
312	603025	大豪科技	69,500	960,490.00	0.10
313	601336	新华保险	31,955	959,608.65	0.10
314	603005	晶方科技	46,756	952,887.28	0.10
315	600918	中泰证券	167,900	951,993.00	0.10
316	600711	盛屯矿业	259,300	951,631.00	0.10
317	603806	福斯特	64,604	949,678.80	0.10
318	600765	中航重机	46,500	948,600.00	0.10
319	605358	立昂微	40,900	946,426.00	0.10
320	600643	爱建集	251,000	946,270.00	0.10

		团			
321	688006	浙江杭 可科技	54,200	945,790.00	0.10
322	601100	恒立液 压	20,120	937,189.60	0.10
323	601555	东吴证 券	156,372	922,594.80	0.10
324	600597	光明乳 业	118,496	920,713.92	0.10
325	600740	山西焦 化	234,500	919,240.00	0.10
326	601377	兴业证 券	181,398	917,873.88	0.10
327	688055	昆山龙 腾光电	289,039	916,253.63	0.10
328	600486	扬农化 工	16,160	912,232.00	0.09
329	600012	皖通高 速	64,900	906,653.00	0.09
330	688599	天合光 能	53,400	903,528.00	0.09
331	603297	永新光 学	14,900	901,301.00	0.09
332	600111	北方稀 土	52,187	897,616.40	0.09
333	603187	海容冷 链	76,920	896,887.20	0.09
334	600196	复星医 药	40,391	894,256.74	0.09
335	603681	永冠新 材	70,100	893,775.00	0.09
336	600173	卧龙地 产	238,400	891,616.00	0.09
337	601615	明阳智 能	94,400	891,136.00	0.09
338	600392	盛和资 源	103,200	889,584.00	0.09
339	688028	沃尔德 金刚石	54,000	887,220.00	0.09
340	688777	中控技 术	23,530	887,081.00	0.09
341	600197	伊力特	49,700	885,157.00	0.09
342	600790	轻纺城	274,200	882,924.00	0.09

343	600697	欧亚集团	87,800	882,390.00	0.09
344	603239	浙江仙通	64,300	881,553.00	0.09
345	600456	宝钛股份	34,500	880,785.00	0.09
346	603006	黎明股份	90,500	880,565.00	0.09
347	601666	平煤股份	78,500	879,200.00	0.09
348	600655	豫园股份	170,441	877,771.15	0.09
349	600551	时代出版	123,880	877,070.40	0.09
350	600859	王府井	74,600	875,804.00	0.09
351	600739	辽宁成大	104,200	872,154.00	0.09
352	600987	航民股份	123,400	871,204.00	0.09
353	600060	海信视像	35,201	870,872.74	0.09
354	603599	广信股份	71,700	869,721.00	0.09
355	601696	中银证券	95,500	867,140.00	0.09
356	601928	凤凰传媒	78,900	864,744.00	0.09
357	603989	艾华集团	61,500	864,690.00	0.09
358	600232	金鹰股份	200,600	864,586.00	0.09
359	600508	上海能源	61,100	864,565.00	0.09
360	603037	凯众股份	66,480	863,575.20	0.09
361	688101	三达膜环境技术	75,598	860,305.24	0.09
362	603396	金辰股份	26,300	853,961.00	0.09
363	603678	火炬电子	34,400	849,336.00	0.09
364	603797	联泰环保	271,400	846,768.00	0.09

365	601865	福莱特	42,000	844,200.00	0.09
366	688016	心脉医疗	8,597	842,935.85	0.09
367	600118	中国卫星	37,706	838,204.38	0.09
368	600705	中航产融	376,456	835,732.32	0.09
369	688390	固德威电源	14,880	835,065.60	0.09
370	600079	人福医药	48,296	829,242.32	0.09
371	600782	新钢股份	248,900	826,348.00	0.09
372	603290	斯达半导	9,560	823,211.60	0.09
373	600641	万业企业	70,020	822,735.00	0.09
374	600208	新湖中宝	520,510	822,405.80	0.09
375	603706	东方环宇	56,100	821,865.00	0.09
376	600261	阳光照明	304,200	821,340.00	0.09
377	601991	大唐发电	272,341	819,746.41	0.09
378	603920	世运电路	41,500	819,210.00	0.09
379	600745	闻泰科技	28,700	810,775.00	0.08
380	688099	晶晨半导体	13,620	807,938.40	0.08
381	600588	用友网络	79,821	798,210.00	0.08
382	600141	兴发集团	41,700	795,636.00	0.08
383	600780	通宝能源	134,800	795,320.00	0.08
384	600482	中国动力	40,800	794,784.00	0.08
385	688366	昊海生物科技	12,820	790,737.60	0.08
386	603043	广州酒家	49,400	788,918.00	0.08

387	603886	元祖股份	52,300	787,638.00	0.08
388	600681	百川能源	233,300	786,221.00	0.08
389	603345	安井食品	10,500	780,255.00	0.08
390	600763	通策医疗	14,400	778,320.00	0.08
391	600184	光电股份	91,400	777,814.00	0.08
392	603387	基蛋生物	100,200	777,552.00	0.08
393	603638	艾迪精密	55,420	777,542.60	0.08
394	603938	三孚股份	65,940	774,795.00	0.08
395	603948	建业股份	47,500	773,300.00	0.08
396	688303	大全能源	37,800	770,742.00	0.08
397	603519	立霸股份	68,000	769,080.00	0.08
398	603233	大参林	53,521	765,350.30	0.08
399	600633	浙数文化	86,800	764,708.00	0.08
400	603113	金能科技	139,300	761,971.00	0.08
401	688678	福立旺精密	70,193	760,190.19	0.08
402	688122	西部超导	19,800	758,736.00	0.08
403	603725	天安新材	121,900	756,999.00	0.08
404	688078	龙软科技	32,700	753,081.00	0.08
405	601900	南方传媒	60,500	752,015.00	0.08
406	600460	士兰微	42,900	751,179.00	0.08
407	600195	中牧股份	100,200	750,498.00	0.08
408	600862	中航高科	39,797	747,387.66	0.08
409	603095	越剑智	57,000	747,270.00	0.08

		能			
410	600153	建发股份	83,595	746,503.35	0.08
411	600779	水井坊	19,800	745,074.00	0.08
412	600143	金发科技	112,600	744,286.00	0.08
413	601886	江河集团	152,500	744,200.00	0.08
414	603416	信捷电气	26,000	743,080.00	0.08
415	603063	禾望电气	48,300	740,439.00	0.08
416	603596	伯特利	18,880	734,432.00	0.08
417	605287	德才股份	58,300	733,997.00	0.08
418	601908	京运通	290,000	733,700.00	0.08
419	603799	华友钴业	33,127	733,100.51	0.08
420	600586	金晶科技	125,900	730,220.00	0.08
421	600828	茂业商业	307,400	728,538.00	0.08
422	603833	欧派家居	13,541	725,255.96	0.08
423	603987	康德莱	117,600	718,536.00	0.07
424	688029	南微医学科技	11,600	714,096.00	0.07
425	600085	同仁堂	18,682	713,839.22	0.07
426	688621	阳光诺和	16,585	708,179.50	0.07
427	603578	三星新材	57,800	699,380.00	0.07
428	688001	苏州华兴源创科技	30,827	696,073.66	0.07
429	603700	宁水集团	74,200	695,996.00	0.07
430	603444	吉比特	3,900	694,239.00	0.07
431	600168	武汉控股	176,360	691,331.20	0.07
432	688396	华润微电子	18,300	685,152.00	0.07
433	688363	华熙生	12,100	684,497.00	0.07

		物			
434	601188	龙江交通	232,000	684,400.00	0.07
435	600884	杉杉股份	84,096	682,859.52	0.07
436	688386	泛亚微透	24,209	679,304.54	0.07
437	688400	凌云光技术	39,800	663,864.00	0.07
438	600976	健民集团	13,000	656,500.00	0.07
439	600590	泰豪科技	172,300	656,463.00	0.07
440	603515	欧普照明	37,703	653,770.02	0.07
441	688007	光峰科技	39,900	642,390.00	0.07
442	600746	江苏索普	106,800	629,052.00	0.07
443	600570	恒生电子	35,540	627,636.40	0.07
444	688116	天奈科技	27,000	623,160.00	0.06
445	605033	美邦股份	49,900	619,758.00	0.06
446	688521	芯原微电子	23,100	617,925.00	0.06
447	688596	正帆科技	18,700	617,100.00	0.06
448	603728	鸣志电器	15,300	615,519.00	0.06
449	600594	益佰制药	204,900	614,700.00	0.06
450	600058	五矿发展	92,900	613,140.00	0.06
451	603185	弘元绿能	35,500	606,695.00	0.06
452	603238	诺邦股份	60,900	606,564.00	0.06
453	603730	岱美股份	60,760	603,954.40	0.06
454	688628	优利德科技	18,300	599,691.00	0.06

455	600316	洪都航空	35,700	593,691.00	0.06
456	688205	德科立光电子	20,243	583,200.83	0.06
457	603035	常熟汽饰	45,700	579,476.00	0.06
458	688002	睿创微纳	20,565	575,203.05	0.06
459	603517	绝味食品	37,100	571,340.00	0.06
460	600223	福瑞达	79,800	564,186.00	0.06
461	603882	金域医学	20,500	557,395.00	0.06
462	600996	贵广网络	72,100	553,728.00	0.06
463	600826	兰生股份	101,540	546,285.20	0.06
464	600663	陆家嘴	61,002	538,037.64	0.06
465	600567	山鹰国际	358,600	537,900.00	0.06
466	600231	凌钢股份	399,800	531,734.00	0.06
467	688536	思瑞浦股份	5,300	518,393.00	0.05
468	603538	美诺华	45,400	507,118.00	0.05
469	601368	绿城水务	122,000	492,880.00	0.05
470	688185	康希诺生物	11,800	484,862.00	0.05
471	603659	璞泰来	33,990	480,278.70	0.05
472	600546	山煤国际	32,700	478,074.00	0.05
473	600606	绿地控股	354,077	478,003.95	0.05
474	603127	昭衍新药	35,853	475,769.31	0.05
475	688655	迅捷兴科技	45,299	475,639.50	0.05
476	603267	鸿远电子	13,400	456,940.00	0.05
477	600754	锦江酒店	19,873	456,681.54	0.05
478	600732	爱旭股	49,280	445,984.00	0.05

		份			
479	688005	容百科技	18,500	430,680.00	0.04
480	600783	鲁信创投	45,700	426,381.00	0.04
481	688178	万德斯环保	40,200	414,462.00	0.04
482	688107	安路科技	16,100	409,262.00	0.04
483	600829	人民同泰	71,900	403,359.00	0.04
484	688369	致远互联	24,800	390,104.00	0.04
485	601828	美凯龙	150,966	384,963.30	0.04
486	603000	人民网	19,200	383,808.00	0.04
487	688258	江苏卓易信息科技	11,200	374,080.00	0.04
488	605123	派克新材	6,600	370,788.00	0.04
489	688071	华依科技集团	17,100	370,557.00	0.04
490	688711	江苏宏微科技	20,400	327,624.00	0.03
491	600399	抚顺特钢	56,200	316,406.00	0.03
492	688311	盟升电子	14,100	288,909.00	0.03
493	688202	美迪西生物医药	10,000	260,500.00	0.03
494	688063	派能科技	6,420	254,938.20	0.03
495	688598	金博碳素股份	8,800	249,040.00	0.03
496	688619	罗普特科技	32,000	224,960.00	0.02

7.3.2 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	688563	航空材料股份	588	31,093.44	0.00
2	688548	广钢气体股份	3,293	30,065.09	0.00
3	688549	中巨芯科技	4,294	28,984.50	0.00
4	603296	华勤技术	487	26,897.01	0.00
5	688582	芯动联科	648	18,247.68	0.00
6	688591	泰凌微	681	13,313.55	0.00
7	688627	精智达技术	222	10,305.24	0.00
8	688610	埃科光电	275	9,248.25	0.00
9	688719	爱科赛博	272	7,091.04	0.00
10	688693	锆威特	178	6,393.76	0.00
11	688573	信宇人	285	6,093.30	0.00
12	603275	上海众辰科技	193	5,790.00	0.00
13	688716	中研股份	267	5,660.40	0.00
14	603193	润本生物技术股份	303	5,572.17	0.00
15	688657	浩辰软件	148	5,470.08	0.00
16	688671	碧兴物联	226	4,684.98	0.00
17	688450	光格科技	167	4,064.78	0.00
18	603270	金帝精密科技股份	195	3,868.80	0.00
19	603273	天元智能	178	3,266.30	0.00
20	603075	热威科技股份	182	3,212.30	0.00
21	603276	恒兴新材料科技	174	2,425.56	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	6,390,894.00	0.73
2	600519	贵州茅台	5,496,842.00	0.63
3	601857	中国石油	4,123,002.00	0.47

4	601988	中国银行	3,932,942.00	0.45
5	601939	建设银行	1,699,309.00	0.19
6	600036	招商银行	1,625,628.00	0.19
7	601088	中国神华	1,568,193.00	0.18
8	600900	长江电力	1,545,007.00	0.18
9	601628	中国人寿	1,491,976.00	0.17
10	600028	中国石化	1,367,343.00	0.16
11	601728	中国电信	1,219,438.00	0.14
12	601318	中国平安	1,086,903.00	0.12
13	601138	工业富联	949,789.00	0.11
14	601658	邮储银行	913,126.00	0.10
15	601166	兴业银行	826,200.00	0.09
16	601899	紫金矿业	824,570.00	0.09
17	601668	中国建筑	760,906.00	0.09
18	600309	万华化学	728,733.00	0.08
19	600030	中信证券	711,305.00	0.08
20	600809	山西汾酒	643,943.00	0.07

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	2,599,977.00	0.30
2	600519	贵州茅台	2,364,355.00	0.27
3	601988	中国银行	1,850,274.00	0.21
4	601857	中国石油	1,612,540.00	0.18
5	600036	招商银行	748,135.00	0.09
6	601088	中国神华	719,823.00	0.08
7	601628	中国人寿	714,359.00	0.08
8	601939	建设银行	707,761.00	0.08
9	600900	长江电力	694,239.00	0.08
10	600297	广汇汽车	685,446.89	0.08
11	600028	中国石化	669,812.00	0.08
12	600360	ST 华微	534,717.00	0.06
13	601318	中国平安	522,877.00	0.06
14	601728	中国电信	517,609.00	0.06
15	601138	工业富联	446,814.00	0.05
16	601658	邮储银行	424,148.00	0.05
17	601166	兴业银行	379,005.00	0.04
18	601899	紫金矿业	328,514.00	0.04

19	600809	山西汾酒	326,279.00	0.04
20	600030	中信证券	320,005.00	0.04

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	119,799,881.30
卖出股票收入（成交）总额	52,224,021.80

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受

到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	39,253.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,983,056.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,022,310.62

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
汇添	46,562	19,082.68	5,186,503.64	0.58	883,341,169.49	99.42

富上证综合指数 A						
汇添富上证综合指数 C	4,210	16,481.39	0.00	0.00	69,386,655.21	100.00
合计	50,772	18,866.98	5,186,503.64	0.54	952,727,824.70	99.46

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富上证综合指数 A	148,793.51	0.02
	汇添富上证综合指数 C	27,239.29	0.04
	合计	176,032.80	0.02

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富上证综合指数 A	0
	汇添富上证综合指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富上证综合指数 A	0
	汇添富上证综合指数 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C
基金合同生效日 (2009 年 07 月 01 日) 基金份额总额	9,097,758,651.47	-
本报告期期初基金份 额总额	865,474,870.80	27,149,434.26
本报告期基金总申购 份额	191,898,140.40	221,895,315.31
减：本报告期基金总 赎回份额	168,845,338.07	179,658,094.36
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	888,527,673.13	69,386,655.21

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	2	51,693,807.38	30.05	38,040.88	30.05	
国海证券	2	47,695,008.39	27.73	35,097.84	27.73	
瑞银证券	2	34,057,632.18	19.80	25,063.11	19.80	
东吴证券	1	14,788,396.78	8.60	10,882.91	8.60	
海通证券	1	9,032,959.18	5.25	6,647.69	5.25	
东方证券	6	6,681,642.27	3.88	4,916.76	3.88	
国信证券	2	3,049,342.57	1.77	2,244.35	1.77	
中信建投	1	2,967,573.00	1.73	2,184.32	1.73	

证券						
申万宏源证券	1	2,057,541.35	1.20	1,514.35	1.20	
财通证券	2	-	-	-	-	
长城证券	2	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国联证券	2	-	-	-	-	
国泰君安	1	-	-	-	-	
恒泰证券	2	-	-	-	-	
华安证券	1	-	-	-	-	
摩根大通证券	2	-	-	-	-	
平安证券	1	-	-	-	-	
太平洋证券	2	-	-	-	-	
信达证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信证券	2	-	-	-	-	

中银国际	1	-	-	-	-	
------	---	---	---	---	---	--

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	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 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司,租用其交易单元。

(2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控

制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)

(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门决定。

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

## 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 4 家证券公司的 7 个交易单元：财通证券（上交所单元，深交所单元）、国联证券（上交所单元，深交所单元）、摩根大通证券（上交所单元，深交所单元）、华安证券（上交所单元）；不再租用 1 家证券公司的 1 个交易单元：华西证券（上交所单元）。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2024 年 01 月 02 日
2	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京增财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	2024 年 01 月 17 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 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	2024 年 01 月 22 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 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	2024 年 03 月 29 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息资料的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 03 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富投资管理有限公司股东变更的公告	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	2024 年 04 月 16 日
7	汇添富基金管理股份有限公司	上交所, 上证报, 公司	2024 年 04 月 22 日

	旗下基金 2024 年第一季度报告	网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 07 日
9	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京中期时代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	2024 年 06 月 13 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富上证综合指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富上证综合指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](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 08 月 30 日