

# 汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金 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：中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券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 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
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 .....	16
§ 5 托管人报告 .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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 .....	17
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 .....	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	17
6.1 资产负债表 .....	17
6.2 利润表 .....	18
6.3 净资产变动表 .....	20
6.4 报表附注 .....	21
§ 7 投资组合报告 .....	45
7.1 期末基金资产组合情况 .....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	60
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 .....	60
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61
§ 8 基金份额持有人信息 .....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	63
§ 9 开放式基金份额变动 .....	63
§ 10 重大事件揭示 .....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§ 12 备查文件目录 .....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富中证 800 指数增强	
基金主代码	017896	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 05 月 19 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	331,262,325.55	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017896	017897
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	96,458,023.46	234,804,302.09

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 800 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.00%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；股票投资策略；港股通标的股票的投资策略；存托凭证的投资策略；债券投资策略；可转债及可交换债投资策略；资产支持证券投资策略；股指期货投资策略；国债期货投资策略；股票期权投资策略；融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，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。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	杨军智
	联系电话	021-28932888	010-60834299
	电子邮箱	service@99fund.com	yjz@citics.com
客户服务电话		400-888-9918	010-60836588
传真		021-28932998	010-60834004
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市朝阳区亮马桥路 48 号 中信证券大厦 5 层
邮政编码		200010	100125
法定代表人		李文	张佑君

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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)	
	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C
本期已实现收益	767,605.96	791,978.15
本期利润	559,694.35	570,778.56
加权平均基金份额本	0.0081	0.0030

期利润		
本期加权平均净值利润率	0.84%	0.32%
本期基金份额净值增长率	1.44%	1.24%
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	-2,634,337.04	-7,404,609.59
期末可供分配基金份额利润	-0.0273	-0.0315
期末基金资产净值	93,823,686.42	227,399,692.50
期末基金份额净值	0.9727	0.9685
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	-2.73%	-3.15%

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

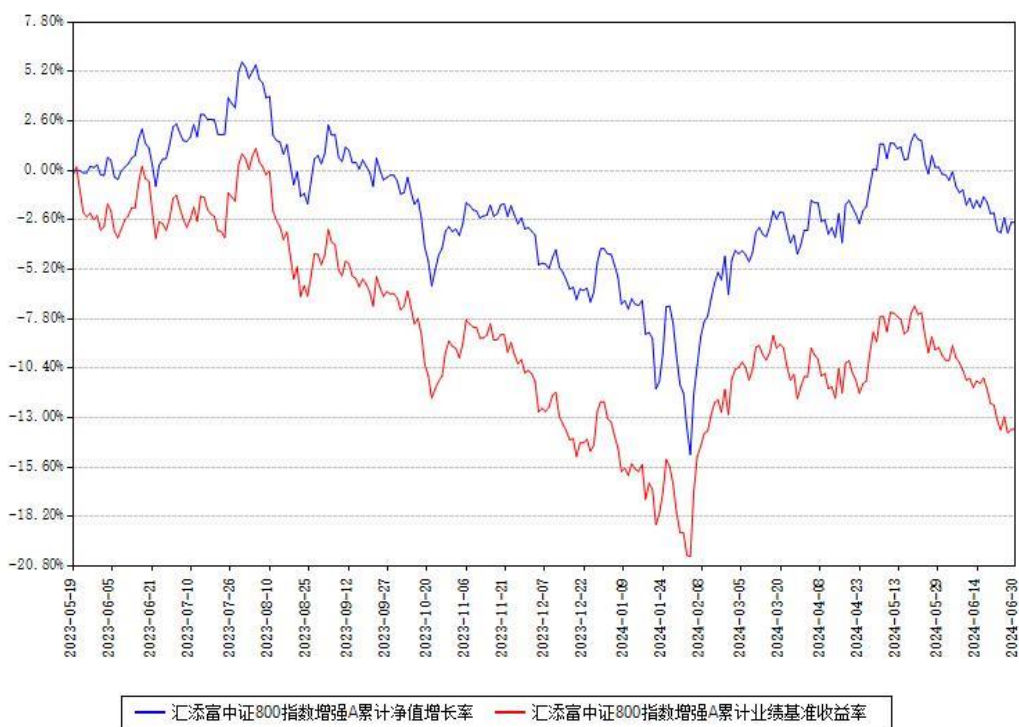
汇添富中证 800 指数增强 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.51%	0.54%	-4.02%	0.54%	1.51%	0.00%
过去三个月	0.43%	0.71%	-3.09%	0.79%	3.52%	-0.08%
过去六个月	1.44%	0.97%	-1.64%	0.98%	3.08%	-0.01%
过去一年	-4.04%	0.83%	-11.35%	0.89%	7.31%	-0.06%

自基金合同生效日起至今	-2.73%	0.81%	-13.60%	0.87%	10.87%	-0.06%
汇添富中证 800 指数增强 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	-2.54%	0.54%	-4.02%	0.54%	1.48%	0.00%
过去三个月	0.34%	0.71%	-3.09%	0.79%	3.43%	-0.08%
过去六个月	1.24%	0.97%	-1.64%	0.98%	2.88%	-0.01%
过去一年	-4.40%	0.83%	-11.35%	0.89%	6.95%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	-3.15%	0.81%	-13.60%	0.87%	10.45%	-0.06%

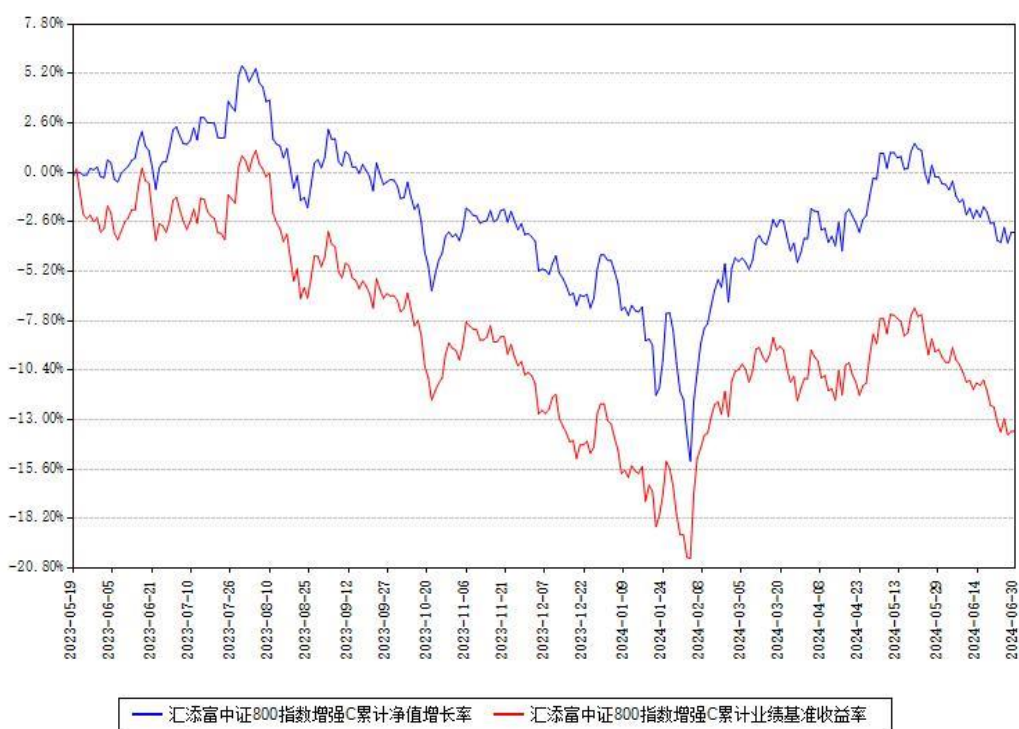
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



汇添富中证800指数增强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800指数增强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（2023年05月19日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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		
许一尊	本基金的基金经理	2023 年 05 月 19 日	-	14	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业

				<p>资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。</p> <p>2015 年 11 月 24 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。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。2021 年 12 月 2 日至今任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至今任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证</p>
--	--	--	--	--

				<p>500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月 19 日至今任汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 14 日至今任汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳元回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 28 日至今任汇添富稳兴回报债券型</p>
--	--	--	--	--

					发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 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

2024 年上半年中国经济经历了由复苏向稳态的转变，整体增速一季度强于二季度。从结构上看，主要显现三个方面的特征，首先是供给端修复强于需求端，生产端持续修复，而需求端增速低于预期；其次是内需与外需的不均衡，出口和制造业链条的增长速度较快，显示出较强的外部需求，然而，国内消费需求的恢复相对缓慢，加之房地产和基建投资增长乏力，对经济形成一定拖累；第三是量价的背离，尽管经济总量显示出良好的恢复态势，但价格水平依然低迷，呈现出渐进式的恢复特征。政策方面，强调高质量发展以及新质生产力的培育，各项经济政策部署加快落地，对经济形成有力支撑，特别是在房地产领域，政策调整从单一的供给端转向了供需两端的协同发力。财政政策方面，推动大规模设备更新和消费品以旧换新工作，启动超长期特别国债发行，积极推进“两重”项目的投资建设；货币政策方面，适时降准降息，通过公开市场操作维持合理充裕的市场流动性，并发挥货币政策工具总量和结构双重功能，推动企业综合融资成本和居民信贷成本稳中有降。

权益市场方面，大盘宽基指数及红利指数相对市场整体超额收益显著，中小市值风格震荡下跌。风格方面整体大盘优于小盘，价值优于成长。选股策略方面，价值、红利、质量、现金流类因子表现较好，短期交易类因子表现一般。整体而言，呈现出长期因子优于短期因子，基本面因子优于市场面因子，传统因子优于使用 AI 等新技术构造的因子的特点。选股因子在大市值风格中表现较好，在资金边际流程的中小市值中表现较差。

本基金对标中证 800 指数，遵循量化组合投资原则，保持均衡的因子配置，并结合风险

控制模型控制组合偏离，实现了一定的超额收益。一月末至二月初，在流动性及市场情绪的影响下，部分风格及选股因子大幅回撤，导致组合相对基准的超额收益出现回撤，后市场风格逐步平稳，超额有所修复。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 800 指数增强 A 类份额净值增长率为 1.44%，同期业绩比较基准收益率为-1.64%。本报告期汇添富中证 800 指数增强 C 类份额净值增长率为 1.24%，同期业绩比较基准收益率为-1.64%。

#### 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，宏观经济增长进入稳态区域，结构性的修复可能发生，高质量发展仍是主基调。首先，外需的持续性可能面临压力，基建和消费维持弱复苏，而地产政策的持续发力有利于地产投资的企稳，缓解房地产下滑带来的困境；居民消费潜力的释放将为经济回升提供有力支持，能否带动内需的边际修复将成为关键因素；其次，价格水平可能在低位徘徊后温和回升，在一定程度上修复量价的背离。国内政策预计将继续支持经济增长，财政政策将继续通过政府债发行来支撑社融增速，特别是国债和地方债的发行提速，为经济提供进一步支持；货币政策在维持稳健的同时，利率走廊上限和政策利率的调降空间将进一步打开，但总体仍然是稳总量重结构，结构性政策延续精准有效。海外通胀有望逐步得到控制，地区冲突带来的不确定性逐步被市场消化。整体看，A 股市场整体估值处于历史低位，具有较高的性价比和安全边际，向下空间有限。随着经济复苏和市场信心的修复，市场有望迎来较好的投资机会。

行业方面，受益于政策支持和市场需求的增长，与新质生产力、经济复苏、战略安全相关的行业仍可能存在长期投资机会。风格方面，随着经济增长和不确定性降低，投资者信心逐步修复，可能重新关注公司的长期基本面投资价值和成长，成长和价值风格间可能出现再平衡，大盘及小盘之间的波动可能趋缓。选股策略方面，选股因子表现预计将更为均衡和多元。

本基金使用量化选股模型挑选个股，同时保持风格和行业的相对均衡，具有较鲜明的大盘风格。随着经济企稳，经济关联度高，基本面质地优良，估值合理的大中市值公司可能有所表现，给中证 800 增强策略带来较好的投资机会。未来，我们将进一步加大量化模型的研究深度，扩展新技术、新数据在量化投资中的应用，提高信息的发掘和利用效率，提升风险管理和组合精细化管理能力。本基金将继续严格遵守基金合同，追求相对业绩比较基准的较为稳定的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即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；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。



## 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

本报告期，本基金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、基金份额申购赎回价格的计算以及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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由汇添富基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金

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	17,192,092.80	11,955,595.87
结算备付金		31,634.57	31,316.72
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	299,726,227.84	218,412,976.54
其中：股票投资		299,726,227.84	218,412,976.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,770,570.77	6,364,309.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		326,720,525.98	236,764,198.29
<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		-	-
应付赎回款		5,073,110.23	2,753,086.17
应付管理人报酬		245,480.60	197,534.76
应付托管费		24,548.07	19,753.51
应付销售服务费		69,472.80	57,039.70
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	84,535.36	120,000.00
负债合计		5,497,147.06	3,147,414.14
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.8	331,262,325.55	244,078,724.30
未分配利润	6.4.7.9	-10,038,946.63	-10,461,940.15
净资产合计		321,223,378.92	233,616,784.15
负债和净资产总计		326,720,525.98	236,764,198.29

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 331,262,325.55 份。本基金下属汇添富中证 800 指数增强 A 基金份额净值 0.9727 元，基金份额总额 96,458,023.46 份；本基金下属汇添富中证 800 指数增强 C 基金份额净值 0.9685 元，基金份额总额 234,804,302.09 份。

2、本基金合同于 2023 年 05 月 19 日生效，上年度实际报告期间为 2023 年 05 月 19 日至 2023 年 12 月 31 日，特此说明。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金

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 05 月 19 日 (基金合同生效 日) 至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>2,923,678.04</b>	<b>5,633,401.33</b>
1. 利息收入		62,128.24	153,997.58
其中：存款利息收入	6.4.7.10	62,128.24	153,997.58
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）		3,087,202.54	7,678,277.11
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-827,575.51	4,005,106.48
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	3,914,778.05	3,673,170.63
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	-429,111.20	-2,198,873.36
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	203,458.46	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,793,205.13</b>	<b>639,582.14</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,227,574.20	436,731.51
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	122,757.36	43,673.17
3. 销售服务费		358,338.21	136,446.37
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	84,535.36	22,731.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,130,472.91</b>	<b>4,993,819.19</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,130,472.91</b>	<b>4,993,819.19</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>1,130,472.91</b>	<b>4,993,819.19</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金

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	244,078,724.30	-10,461,940.15	233,616,784.15
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	244,078,724.30	-10,461,940.15	233,616,784.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	87,183,601.25	422,993.52	87,606,594.77
（一）、综合收益总额	-	1,130,472.91	1,130,472.91
（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）	87,183,601.25	-707,479.39	86,476,121.86
其中：1. 基金申购款	1,032,181,397.95	-31,337,502.65	1,000,843,895.30
2. 基金赎回款	-944,997,796.70	30,630,023.26	-914,367,773.44
（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	331,262,325.55	-10,038,946.63	321,223,378.92
项目	上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-

二、本期期初净资产	378,056,803.03	-	378,056,803.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	4,993,819.19	4,993,819.19
（一）、综合收益总额	-	4,993,819.19	4,993,819.19
（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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
（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	378,056,803.03	4,993,819.19	383,050,622.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金（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[2023]130 号文《关于准予汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2023 年 5 月 19 日生效。首次设立基金募集规模为 378,056,803.03 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（2023）验字第 60466941\_B27 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，基金托管人为中信证券股份有限公司。

本基金的标的指数为中证 800 指数。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、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（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具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相关规定）。本基金还可根据法律法规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：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其中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。本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，追求基金资产的长期增值。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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	2,116,687.41
等于：本金	2,114,331.74
加：应计利息	2,355.67
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	15,075,405.39
等于：本金	15,074,699.09
加：应计利息	706.30
减：坏账准备	-
合计	17,192,092.80

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 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	308,570,463.16	-	299,726,227.84	-8,844,235.32
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	308,570,463.16	-	299,726,227.84	-8,844,235.32

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	24,863.02
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	84,535.36

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 800 指数增强 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	60,067,756.37	60,067,756.37
本期申购	190,747,890.71	190,747,890.71
本期赎回（以“-”号填列）	-154,357,623.62	-154,357,623.62
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	96,458,023.46	96,458,023.46
汇添富中证 800 指数增强 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	184,010,967.93	184,010,967.93
本期申购	841,433,507.24	841,433,507.24
本期赎回（以“-”号填列）	-790,640,173.08	-790,640,173.08
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	234,804,302.09	234,804,302.09

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 800 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	233,078.48	-2,704,243.17	-2,471,164.69
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	233,078.48	-2,704,243.17	-2,471,164.69
本期利润	767,605.96	-207,911.61	559,694.35
本期基金份额交易产生的变动数	152,837.17	-875,703.87	-722,866.70
其中：基金申购款	-1,361,091.03	-3,468,704.27	-4,829,795.30
基金赎回款	1,513,928.20	2,593,000.40	4,106,928.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,153,521.61	-3,787,858.65	-2,634,337.04
汇添富中证 800 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	284,731.19	-8,275,506.65	-7,990,775.46
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	284,731.19	-8,275,506.65	-7,990,775.46
本期利润	791,978.15	-221,199.59	570,778.56
本期基金份额交易产生	726,452.01	-711,064.70	15,387.31

的变动数			
其中：基金 申购款	-9,381,796.34	-17,125,911.01	-26,507,707.35
基金赎回款	10,108,248.35	16,414,846.31	26,523,094.66
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	1,803,161.35	-9,207,770.94	-7,404,609.59

#### 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		50,576.95
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		11,233.44
结算备付金利息收入		317.85
其他		-
合计		62,128.24

#### 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		666,548,044.87
减：卖出股票成本总额		666,363,010.71
减：交易费用		1,012,609.67
买卖股票差价收入		-827,575.51

#### 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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 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	3,914,778.05
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	3,914,778.05

#### 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	-429,111.20
——股票投资	-429,111.20
——债券投资	-
——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	-429,111.20
----	-------------

#### 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	203,458.46
替代损益	-
其他	-
合计	203,458.46

#### 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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	-
合计	84,535.36

#### 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
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	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

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 05 月 19 日（基金合同生效日）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（%）
中信证券	770,280,143.02	54.45	391,637,671.50	57.48

#### 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 (%)
中信证券	316,339.39	53.75	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日 (基金合同生效日) 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 (%)
中信证券	167,246.44	57.45	-	-

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 05 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,227,574.20	436,731.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	150,425.00	37,115.36
应支付基金管理人的净管理费	1,077,149.20	399,616.15

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无

需再出具资金划拨指令。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 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

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 05 月 19 日（基 金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	122,757.36	43,673.17

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

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

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C	合计
中信证券股份有限公司	-	222,692.76	222,692.76
东方证券股份有限公司	-	618.96	618.96
汇添富基金管理股份有限公司	-	2,530.04	2,530.04

合计	-	225,841.76	225,841.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C	合计
中信证券股份有限公司	-	79,714.40	79,714.40
汇添富基金管理股份有限公司	-	4.62	4.62
合计	-	79,719.02	79,719.02

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限

费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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固有资金投资本基金。

##### 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 05 月 19 日（基金合同生效日）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
中信证券	8,295,765.52	6,166.05	7,882,449.79	6,745.26

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本

基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	17,192,092.80	-	-	-	-	-	17,192,092.80
结算备付金	31,634.57	-	-	-	-	-	31,634.57
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	299,726,227.84	299,726,227.84
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	-	-	-	-	-	9,770,570.77	9,770,570.77
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,223,727.37	-	-	-	-	309,496,798.61	326,720,525.98
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-

债							
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,073,110.23	5,073,110.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	245,480.60	245,480.60
应付托管费	-	-	-	-	-	24,548.07	24,548.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	69,472.80	69,472.80
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	-	-	-	-	-	84,535.36	84,535.36
负债总计	-	-	-	-	-	5,497,147.06	5,497,147.06
利率敏感	17,223,727.37	-	-	-	-	303,999,651.55	321,223,378.92



度缺口							
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	11,955,595.87	-	-	-	-	-	11,955,595.87
结算备付金	31,316.72	-	-	-	-	-	31,316.72
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	218,412,976.54	218,412,976.54
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	-	-	-	-	-	6,364,309.16	6,364,309.16
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	11,986,912.59	-	-	-	-	224,777,285.70	236,764,198.29
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	-	-	-	-	-	2,753,086.17	2,753,086.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	197,534.76	197,534.76
应付托管费	-	-	-	-	-	19,753.51	19,753.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	57,039.70	57,039.70
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	-	-	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,147,414.14	3,147,414.14
利率敏感度缺口	11,986,912.59	-	-	-	-	221,629,871.56	233,616,784.15

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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	299,726,227.84	93.31	218,412,976.54	93.49
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	299,726,227.84	93.31	218,412,976.54	93.49

	84		54
--	----	--	----

#### 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
	中证 800 指数 上涨 5%	13,702,511.18	8,971,900.65
	中证 800 指数 下跌 5%	-13,702,511.18	-8,971,900.65

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	299,726,227.84
第二层次	-

第三层次	-
合计	299,726,227.84

#### 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	299,726,227.84	91.74
	其中：股票	299,726,227.84	91.74
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	17,223,727.37	5.27
8	其他各项资产	9,770,570.77	2.99
9	合计	326,720,525.98	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	89,928.00	0.03
B	采矿业	27,003,237.00	8.41
C	制造业	122,875,475.45	38.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,391,587.60	2.30
E	建筑业	2,709,662.00	0.84
F	批发和零售业	2,072,871.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	5,098,078.16	1.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,469,458.00	5.44
J	金融业	60,453,774.00	18.82
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	235,214.00	0.07
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	165,320.00	0.05
S	综合	90,816.00	0.03
	合计	245,655,421.21	76.47

### 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	1,454,292.00	0.45
C	制造业	44,658,844.03	13.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,447,602.00	0.45

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,818,073.00	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	814,420.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	701,503.00	0.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,350,540.00	0.42
L	租赁和商务服务业	258,552.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	569,823.60	0.18
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	997,157.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	54,070,806.63	16.83

### 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	600519	贵州茅台	9,200	13,499,988.00	4.20
2	601318	中国平安	163,600	6,766,496.00	2.11
3	000333	美的集团	95,900	6,185,550.00	1.93
4	300750	宁德时代	33,160	5,969,794.80	1.86
5	601899	紫金矿业	339,600	5,966,772.00	1.86
6	601166	兴业银行	311,100	5,481,582.00	1.71

7	000858	五 粮 液	37,900	4,852,716.00	1.51
8	601328	交通银 行	646,100	4,826,367.00	1.50
9	601088	中国神 华	92,800	4,117,536.00	1.28
10	601288	农业银 行	905,000	3,945,800.00	1.23
11	601857	中国石 油	373,200	3,851,424.00	1.20
12	002415	海康威 视	119,200	3,684,472.00	1.15
13	600028	中国石 化	546,500	3,453,880.00	1.08
14	000063	中兴通 讯	123,200	3,445,904.00	1.07
15	601601	中国太 保	122,600	3,415,636.00	1.06
16	600000	浦发银 行	385,300	3,171,019.00	0.99
17	300760	迈瑞医 疗	10,800	3,141,828.00	0.98
18	600941	中国移 动	28,700	3,085,250.00	0.96
19	601688	华泰证 券	243,300	3,014,487.00	0.94
20	000338	潍柴动 力	185,400	3,010,896.00	0.94
21	601818	光大银 行	935,600	2,965,852.00	0.92
22	601169	北京银 行	503,100	2,938,104.00	0.91
23	688111	金山办 公	11,600	2,639,000.00	0.82
24	601728	中国电 信	427,300	2,627,895.00	0.82
25	600489	中金黄 金	176,400	2,610,720.00	0.81
26	600050	中国联 通	555,100	2,608,970.00	0.81
27	600989	宝丰能 源	144,000	2,495,520.00	0.78
28	601398	工商银 行	427,800	2,438,460.00	0.76



29	000776	广发证 券	193,800	2,358,546.00	0.73
30	688036	传音控 股	30,600	2,342,124.00	0.73
31	300782	卓胜微	28,200	2,192,268.00	0.68
32	000423	东阿阿 胶	34,200	2,140,920.00	0.67
33	601898	中煤能 源	168,100	2,097,888.00	0.65
34	002736	国信证 券	240,600	2,090,814.00	0.65
35	600276	恒瑞医 药	52,840	2,032,226.40	0.63
36	600015	华夏银 行	316,900	2,028,160.00	0.63
37	600900	长江电 力	69,800	2,018,616.00	0.63
38	600025	华能水 电	185,900	2,004,002.00	0.62
39	300832	新产业	29,600	1,996,224.00	0.62
40	600497	驰宏锌 锗	373,700	1,995,558.00	0.62
41	601877	正泰电 器	104,500	1,991,770.00	0.62
42	600036	招商银 行	57,600	1,969,344.00	0.61
43	002595	豪迈科 技	49,300	1,881,781.00	0.59
44	000728	国元证 券	306,700	1,858,602.00	0.58
45	000538	云南白 药	35,900	1,836,285.00	0.57
46	002138	顺络电 子	66,600	1,828,836.00	0.57
47	000725	京东方 A	446,600	1,826,594.00	0.57
48	000001	平安银 行	179,300	1,819,895.00	0.57
49	600582	天地科 技	263,100	1,812,759.00	0.56
50	600873	梅花生 物	180,900	1,812,618.00	0.56
51	600845	宝信软	56,740	1,811,708.20	0.56

		件			
52	601607	上海医药	94,500	1,805,895.00	0.56
53	000598	兴蓉环境	239,600	1,801,792.00	0.56
54	002558	巨人网络	190,700	1,800,208.00	0.56
55	300866	安克创新	25,100	1,787,371.00	0.56
56	600018	上港集团	309,200	1,787,176.00	0.56
57	600332	白云山	60,600	1,777,398.00	0.55
58	600737	中粮糖业	184,513	1,769,479.67	0.55
59	601958	金钼股份	168,200	1,750,962.00	0.55
60	600398	海澜之家	186,000	1,718,640.00	0.54
61	300223	北京君正	30,500	1,690,920.00	0.53
62	002152	广电运通	161,100	1,685,106.00	0.52
63	002555	三七互娱	128,200	1,673,010.00	0.52
64	600535	天士力	125,700	1,581,306.00	0.49
65	600699	均胜电子	105,200	1,559,064.00	0.49
66	601319	中国人保	291,800	1,502,770.00	0.47
67	601717	郑煤机	100,500	1,487,400.00	0.46
68	002563	森马服饰	248,000	1,440,880.00	0.45
69	000887	中鼎股份	115,800	1,417,392.00	0.44
70	600380	健康元	126,700	1,415,239.00	0.44
71	601668	中国建筑	262,300	1,392,813.00	0.43
72	601000	唐山港	293,800	1,380,860.00	0.43
73	600362	江西铜业	58,100	1,375,808.00	0.43
74	600066	宇通客车	53,000	1,367,400.00	0.43
75	002064	华峰化	188,600	1,352,262.00	0.42

		学			
76	603658	安图生物	28,500	1,312,995.00	0.41
77	000559	万向钱潮	294,300	1,312,578.00	0.41
78	002601	龙佰集团	70,200	1,303,614.00	0.41
79	600031	三一重工	76,200	1,257,300.00	0.39
80	300124	汇川技术	24,200	1,241,460.00	0.39
81	688981	中芯国际	25,100	1,157,110.00	0.36
82	300408	三环集团	38,000	1,109,220.00	0.35
83	000933	神火股份	52,800	1,068,144.00	0.33
84	600016	民生银行	273,200	1,035,428.00	0.32
85	603288	海天味业	29,900	1,030,653.00	0.32
86	000157	中联重科	132,200	1,015,296.00	0.32
87	600104	上汽集团	72,700	1,007,622.00	0.31
88	688819	天能电池集团股份	41,714	995,296.04	0.31
89	601919	中远海控	61,300	949,537.00	0.30
90	600999	招商证券	65,200	906,932.00	0.28
91	601229	上海银行	118,200	858,132.00	0.27
92	002273	水晶光电	50,000	849,000.00	0.26
93	002841	视源股份	28,200	832,746.00	0.26
94	000027	深圳能源	113,802	830,754.60	0.26
95	600089	特变电工	59,500	825,265.00	0.26
96	601989	中国重工	164,800	812,464.00	0.25

97	601390	中国中铁	123,500	805,220.00	0.25
98	601699	潞安环能	43,900	795,907.00	0.25
99	601211	国泰君安	58,300	789,965.00	0.25
100	601006	大秦铁路	106,801	764,695.16	0.24
101	601567	三星医疗	21,700	759,500.00	0.24
102	600426	华鲁恒升	28,086	748,211.04	0.23
103	002436	兴森科技	70,400	726,528.00	0.23
104	000967	盈峰环境	161,000	681,030.00	0.21
105	600436	片仔癀	3,200	662,944.00	0.21
106	002371	北方华创	2,000	639,780.00	0.20
107	002472	双环传动	28,700	631,974.00	0.20
108	601628	中国人寿	19,000	589,950.00	0.18
109	601658	邮储银行	114,000	577,980.00	0.18
110	601988	中国银行	121,600	561,792.00	0.17
111	600161	天坛生物	22,520	549,488.00	0.17
112	601186	中国铁建	59,700	511,629.00	0.16
113	600690	海尔智家	18,000	510,840.00	0.16
114	000166	申万宏源	114,100	491,771.00	0.15
115	002410	广联达	50,100	479,958.00	0.15
116	003816	中国广核	103,500	479,205.00	0.15
117	603986	兆易创新	5,000	478,100.00	0.15
118	688008	澜起科技	8,200	468,712.00	0.15
119	601916	浙商银	161,400	445,464.00	0.14

		行			
120	603298	杭叉集团	22,000	432,080.00	0.13
121	002236	大华股份	25,200	389,592.00	0.12
122	601168	西部矿业	20,200	362,590.00	0.11
123	300009	安科生物	41,200	351,848.00	0.11
124	601568	北元集团	87,890	326,071.90	0.10
125	002180	纳思达	11,700	309,114.00	0.10
126	000156	华数传媒	48,700	305,836.00	0.10
127	601555	东吴证券	50,100	295,590.00	0.09
128	600926	杭州银行	21,100	275,355.00	0.09
129	002304	洋河股份	3,400	274,516.00	0.09
130	002185	华天科技	33,022	269,129.30	0.08
131	601108	财通证券	40,700	269,027.00	0.08
132	000963	华东医药	9,600	266,976.00	0.08
133	600219	南山铝业	69,200	263,652.00	0.08
134	300001	特锐德	11,700	235,404.00	0.07
135	600415	小商品城	31,700	235,214.00	0.07
136	603596	伯特利	5,900	229,510.00	0.07
137	600516	方大炭素	47,200	203,432.00	0.06
138	300002	神州泰岳	24,900	202,188.00	0.06
139	600377	宁沪高速	15,600	196,560.00	0.06
140	000738	航发控制	9,600	192,672.00	0.06
141	000783	长江证券	39,100	188,853.00	0.06
142	601077	渝农商	35,900	180,218.00	0.06

		行			
143	600637	东方明珠	29,110	176,988.80	0.06
144	000661	长春高新	1,800	165,186.00	0.05
145	000708	中信特钢	11,100	150,627.00	0.05
146	600528	中铁工业	19,400	142,008.00	0.04
147	600282	南钢股份	28,000	139,440.00	0.04
148	600674	川投能源	7,200	135,000.00	0.04
149	000563	陕国投 A	48,400	133,100.00	0.04
150	300999	金龙鱼	4,800	131,280.00	0.04
151	002507	涪陵榨菜	10,240	125,440.00	0.04
152	603225	新凤鸣	7,800	121,602.00	0.04
153	600309	万华化学	1,400	113,204.00	0.04
154	300088	长信科技	22,199	104,335.30	0.03
155	000050	深天马 A	14,200	103,376.00	0.03
156	601098	中南传媒	8,300	103,086.00	0.03
157	601881	中国银河	9,200	99,912.00	0.03
158	600416	湘电股份	9,800	97,412.00	0.03
159	600909	华安证券	23,100	97,251.00	0.03
160	002056	横店东磁	7,700	96,019.00	0.03
161	600673	东阳光	12,900	90,816.00	0.03
162	600598	北大荒	7,200	89,928.00	0.03
163	000513	丽珠集团	2,400	89,304.00	0.03
164	603893	瑞芯微	1,500	88,755.00	0.03
165	600886	国投电力	4,600	83,904.00	0.03
166	000932	华菱钢	18,500	81,955.00	0.03

		铁			
167	601238	广汽集团	9,200	71,208.00	0.02
168	601939	建设银行	8,800	65,120.00	0.02
169	300251	光线传媒	7,400	62,234.00	0.02
170	002153	石基信息	10,200	58,446.00	0.02
171	688187	时代电气	1,000	49,380.00	0.02
172	002050	三花智控	2,100	40,068.00	0.01
173	603317	天味食品	3,200	36,512.00	0.01
174	002429	兆驰股份	6,400	30,784.00	0.01
175	000591	太阳能	6,400	30,144.00	0.01
176	600585	海螺水泥	1,100	25,949.00	0.01
177	001872	招商港口	1,000	19,250.00	0.01
178	600956	新天绿能	1,000	8,170.00	0.00

### 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	002533	金杯电工	157,100	1,563,145.00	0.49
2	000045	深纺织 A	190,400	1,527,008.00	0.48
3	002833	弘亚数控	83,100	1,515,744.00	0.47
4	002448	中原内配	263,600	1,513,064.00	0.47
5	002017	东信和平	181,350	1,510,645.50	0.47
6	605066	天正电	270,375	1,505,988.75	0.47

		气			
7	000404	长虹华意	282,400	1,505,192.00	0.47
8	300439	美康生物	163,500	1,497,660.00	0.47
9	603299	苏盐井神	157,600	1,497,200.00	0.47
10	000915	华特达因	49,500	1,492,920.00	0.46
11	603115	海星股份	143,300	1,490,320.00	0.46
12	603187	海容冷链	127,400	1,485,484.00	0.46
13	301028	东亚机械	168,300	1,475,991.00	0.46
14	002763	汇洁股份	221,400	1,467,882.00	0.46
15	000589	贵州轮胎	289,000	1,465,230.00	0.46
16	600300	维维股份	609,600	1,463,040.00	0.46
17	002978	安宁股份	52,200	1,454,292.00	0.45
18	002441	众业达	189,600	1,437,168.00	0.45
19	002303	美盈森	580,700	1,399,487.00	0.44
20	603367	辰欣药业	99,800	1,391,212.00	0.43
21	600007	中国国贸	61,500	1,350,540.00	0.42
22	002662	京威股份	373,202	1,134,534.08	0.35
23	600461	洪城环境	93,400	1,081,572.00	0.34
24	600469	风神股份	176,900	1,033,096.00	0.32
25	603112	华翔股份	91,700	963,767.00	0.30
26	002020	京新药业	86,300	903,561.00	0.28
27	000869	张裕 A	37,900	809,165.00	0.25
28	600717	天津港	176,000	751,520.00	0.23
29	600703	三安光	58,400	684,448.00	0.21



		电			
30	002282	博深股份	101,900	651,141.00	0.20
31	603116	红蜻蜓	144,400	649,800.00	0.20
32	002745	木林森	75,900	611,754.00	0.19
33	600618	氯碱化工	67,900	596,162.00	0.19
34	300259	新天科技	227,900	576,587.00	0.18
35	603686	福龙马	74,780	569,823.60	0.18
36	600229	城市传媒	80,400	553,956.00	0.17
37	002158	汉钟精机	32,800	548,416.00	0.17
38	300638	广和通	31,987	546,977.70	0.17
39	002449	国星光电	71,900	511,928.00	0.16
40	603999	读者传媒	93,700	443,201.00	0.14
41	300441	鲍斯股份	71,800	425,774.00	0.13
42	600488	津药药业	123,200	422,576.00	0.13
43	603611	诺力股份	23,700	403,848.00	0.13
44	002073	软控股份	53,600	396,104.00	0.12
45	600929	雪天盐业	73,700	390,610.00	0.12
46	002093	国脉科技	63,300	384,231.00	0.12
47	002925	盈趣科技	29,900	378,833.00	0.12
48	603339	四方科技	39,900	361,893.00	0.11
49	002635	安洁科技	22,500	347,400.00	0.11
50	601163	三角轮胎	22,800	347,016.00	0.11
51	002367	康力电梯	58,000	334,660.00	0.10
52	002267	陕天然气	44,200	334,152.00	0.10

53	002011	盾安环境	31,600	310,628.00	0.10
54	002106	莱宝高科	26,800	292,120.00	0.09
55	002566	益盛药业	47,300	289,476.00	0.09
56	603511	爱慕股份	22,900	281,212.00	0.09
57	300687	赛意信息	19,500	271,440.00	0.08
58	600558	大西洋	73,700	265,320.00	0.08
59	000061	农产品	53,200	258,552.00	0.08
60	600458	时代新材	25,400	256,540.00	0.08
61	002788	鹭燕医药	30,300	238,764.00	0.07
62	000951	中国重汽	16,400	234,848.00	0.07
63	600308	华泰股份	69,200	217,288.00	0.07
64	600433	冠豪高新	77,400	205,110.00	0.06
65	600261	阳光照明	74,700	201,690.00	0.06
66	600750	江中药业	8,000	184,880.00	0.06
67	300718	长盛轴承	10,800	149,256.00	0.05
68	688128	中国电器研究院	8,500	146,285.00	0.05
69	002697	红旗连锁	30,700	142,141.00	0.04
70	603166	福达股份	28,400	139,160.00	0.04
71	603100	川仪股份	5,600	131,656.00	0.04
72	600479	千金药业	12,600	128,142.00	0.04
73	002469	三维化学	21,700	123,690.00	0.04
74	601218	吉鑫科技	33,200	92,628.00	0.03

75	688336	三生国健	3,600	73,260.00	0.02
76	603387	基蛋生物	9,400	72,944.00	0.02
77	601018	宁波港	18,500	62,900.00	0.02
78	605018	长华集团	5,400	48,924.00	0.02
79	002315	焦点科技	1,700	45,832.00	0.01
80	603053	成都燃气	3,300	31,878.00	0.01
81	300154	瑞凌股份	3,100	16,523.00	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	7,972,878.00	3.41
2	601899	紫金矿业	5,870,750.00	2.51
3	300760	迈瑞医疗	5,318,750.00	2.28
4	601601	中国太保	5,271,102.00	2.26
5	601166	兴业银行	5,234,915.00	2.24
6	601688	华泰证券	5,081,749.00	2.18
7	601857	中国石油	5,019,616.00	2.15
8	002736	国信证券	4,928,526.00	2.11
9	601318	中国平安	4,768,622.00	2.04
10	000333	美的集团	4,643,317.00	1.99
11	601169	北京银行	4,404,124.00	1.89
12	000858	五粮液	4,364,963.00	1.87
13	000063	中兴通讯	4,188,861.00	1.79
14	300750	宁德时代	4,138,965.00	1.77
15	600028	中国石化	4,130,683.00	1.77
16	600000	浦发银行	3,993,062.00	1.71
17	600737	中粮糖业	3,959,579.92	1.69
18	000338	潍柴动力	3,937,349.00	1.69
19	601088	中国神华	3,882,761.00	1.66
20	000776	广发证券	3,859,506.00	1.65

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	000651	格力电器	5,392,615.00	2.31
2	600887	伊利股份	4,866,117.00	2.08
3	600875	东方电气	4,817,552.00	2.06
4	000568	泸州老窖	4,290,185.00	1.84
5	002736	国信证券	4,172,823.00	1.79
6	000513	丽珠集团	3,863,816.00	1.65
7	002475	立讯精密	3,788,371.00	1.62
8	601138	工业富联	3,720,265.00	1.59
9	002594	比亚迪	3,672,856.00	1.57
10	600036	招商银行	3,550,791.00	1.52
11	600519	贵州茅台	3,442,387.00	1.47
12	000338	潍柴动力	3,340,912.00	1.43
13	000725	京东方 A	3,092,176.00	1.32
14	600276	恒瑞医药	3,066,552.00	1.31
15	600016	民生银行	3,044,498.00	1.30
16	601688	华泰证券	3,039,484.20	1.30
17	600028	中国石化	3,038,410.00	1.30
18	002185	华天科技	2,928,957.00	1.25
19	002252	上海莱士	2,870,055.10	1.23
20	600309	万华化学	2,858,630.00	1.22

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	748,105,373.21
卖出股票收入（成交）总额	666,548,044.87

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，兴业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国农业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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,770,570.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,770,570.77

### 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 (%)
汇添富中证 800 指数增强 A	1,123	85,893.16	32,533,443.84	33.73	63,924,579.62	66.27
汇添富中证 800 指数增强 C	3,649	64,347.58	6,074,082.85	2.59	228,730,219.24	97.41
合计	4,772	69,417.92	38,607,526.69	11.65	292,654,798.86	88.35

### 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	汇添富中证 800	713,972.34	0.74

从业人员持有本基金	指数增强 A		
	汇添富中证 800 指数增强 C	0.00	0.00
	合计	713,972.34	0.22

### 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	汇添富中证 800 指数增强 A	0
	汇添富中证 800 指数增强 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 800 指数增强 A	10~50
	汇添富中证 800 指数增强 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 05 月 19 日）基金份额总额	82,755,143.11	295,301,659.92
本报告期期初基金份额总额	60,067,756.37	184,010,967.93
本报告期基金总申购份额	190,747,890.71	841,433,507.24
减：本报告期基金总赎回份额	154,357,623.62	790,640,173.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	96,458,023.46	234,804,302.09

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内无其他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

本报告期内本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	



			(%)		(%)	
中信 证券	2	770,280,143.02	54.45	316,339.39	53.75	
中信 证券 华南	3	362,026,680.22	25.59	153,510.89	26.08	
海通 证券	3	282,346,594.84	19.96	118,741.22	20.17	

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 (%)
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券 华南	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/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 1 家证券公司的 1 个交易单元：海通证券（北交所单元）。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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旗下基金 2024 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	2024 年 04 月 22 日
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 05 月 24 日
9	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	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 05 月 24 日

10	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中证 800 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 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