

汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资 基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
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	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	68
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	68
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	68
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	68

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
7.12 投资组合报告附注.....	68
§ 8 基金份额持有人信息.....	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
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.....	70
§ 9 开放式基金份额变动.....	71
§ 10 重大事件揭示.....	71
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
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.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4 基金投资策略的改变.....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
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.....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8 其他重大事件.....	76
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
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.....	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§ 12 备查文件目录.....	77
12.1 备查文件目录.....	77
12.2 存放地点.....	77
12.3 查阅方式.....	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金	
基金简称	汇添富中证 500 基本面增强指数	
基金主代码	012498	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 09 月 16 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	110,732,017.12	
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 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C
下属分级基金的交易代码	012498	012499
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	85,652,327.14	25,079,689.98

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，通过基本面选股方法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。
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，立足于深入的基本面分析，精选高质量证券组合，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 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>本基金的投资策略还包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、国债期货投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	王小飞
	联系电话	021-28932888	021-60637103
	电子邮箱	service@99fund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	021-60637228
传真		021-28932998	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200010	100033
法定代表人		李文	田国立

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(2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 06 月 30 日)	
	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C
本期已实现收益	-707,657.98	-320,112.21
本期利润	1,959,520.91	501,484.58
加权平均基金份额本	0.0223	0.0196

期利润		
本期加权平均净值利润率	2.50%	2.23%
本期基金份额净值增长率	2.45%	2.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	-10,498,555.12	-3,385,689.02
期末可供分配基金份额利润	-0.1226	-0.1350
期末基金资产净值	75,153,772.02	21,694,000.96
期末基金份额净值	0.8774	0.8650
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-12.26%	-13.50%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 500 基本面增强指数 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	1.65%	0.97%	-0.77%	0.89%	2.42%	0.08%
过去三个月	-3.69%	0.80%	-5.10%	0.78%	1.41%	0.02%
过去六个月	2.45%	0.76%	2.20%	0.75%	0.25%	0.01%
过去一年	-7.49%	0.93%	-6.65%	0.91%	-0.84%	0.02%

自基金合同生效日起至今	-12.26%	1.10%	-19.91%	1.11%	7.65%	-0.01%
汇添富中证 500 基本面增强指数 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	1.59%	0.98%	-0.77%	0.89%	2.36%	0.09%
过去三个月	-3.88%	0.80%	-5.10%	0.78%	1.22%	0.02%
过去六个月	2.05%	0.76%	2.20%	0.75%	-0.15%	0.01%
过去一年	-8.21%	0.93%	-6.65%	0.91%	-1.56%	0.02%
自基金合同生效日起至今	-13.50%	1.10%	-19.91%	1.11%	6.41%	-0.01%

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

汇添富中证500基本面增强指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500基本面增强指数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（2021年09月16日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
顾耀强	本基金的基金经理，增强收益部总监	2021 年 09 月 16 日		19	国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭

					<p>州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，现任增强收益部总监。</p> <p>2009 年 12 月 22 日至今任汇添富策略回报混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>月 18 日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 8 月 24 日至今任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月 20 日至今任汇添富沪深 300 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 2 月 5 日至 2022 年 9 月 22 日任汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 16 日至今任汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

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

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

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 25 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场先扬后抑。年初投资者对经济疫后复苏较为乐观，但二季度随外部环境变化，以及房地产、地方债等结构性问题的反复，投资者又转而对经济的中长期增长前景忧心忡忡。“资产负债表衰退”一度成为热门话题。预期的不稳定性导致市场风格的巨大变化。与经济周期相关的大多数资产先涨后跌，只有人工智能相关主题在持续的产业突破刺激下，从大模型，到算力（芯片、光模块等），再到应用（游戏、智能驾驶、机器人等）等热点纷呈。本基金一季度表现不佳，二季度提高了组合调整的灵活性，追回部分超额。本基金管理人将继续依托公司投研团队的支持，努力优化投资策略，应对市场环境的挑战。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 500 基本面增强指数 A 类份额净值增长率为 2.45%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。本报告期汇添富中证 500 基本面增强指数 C 类份额净值增长率为 2.05%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年市场，我们看法相对乐观。在 7 月底中央重要会议定调“经济恢复是一个波浪式发展、曲折式前进的过程”，并针对性做出“房地产市场供求关系发生重大变化”、“要活跃资本市场，提振投资者信心”等投资者极为关切的重大判断后，我们相信，依托强健的政策执行力，经济基本面将逐步稳定复苏，投资者预期有望较快扭转，中国优质资产亦将迎来估值修复。当然从中长期来看，中国正面临百年不遇的大变局，应对外部环境的挑战，以及内部的结构转型仍任重道远。

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；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。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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 500 基本面增强指数型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,783,082.16	6,076,482.40
结算备付金		805,092.91	1,099,456.32
存出保证金		36,544.69	36,300.49
交易性金融资产	6.4.7.2	92,606,642.71	93,143,043.38
其中：股票投资		91,466,385.79	91,967,508.45
基金投资		-	-
债券投资		1,140,256.92	1,175,534.93
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		1,043,576.22	-
应收股利		-	-
应收申购款		21,672.96	13,909.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		99,296,611.65	100,369,192.38
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,537,069.81	-
应付赎回款		185,814.36	14,513.78
应付管理人报酬		118,773.55	128,509.41

应付托管费		19,795.59	21,418.25
应付销售服务费		14,336.18	15,366.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.55	1.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	573,047.63	536,038.68
负债合计		2,448,838.67	715,847.35
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	110,732,017.12	116,636,615.98
未分配利润	6.4.7.9	-13,884,244.14	-16,983,270.95
净资产合计		96,847,772.98	99,653,345.03
负债和净资产总计		99,296,611.65	100,369,192.38

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 110,732,017.12 份。本基金下属汇添富中证 500 基本面增强指数 A 基金份额净值 0.8774 元，基金份额总额 85,652,327.14 份；本基金下属汇添富中证 500 基本面增强指数 C 基金份额净值 0.8650 元，基金份额总额 25,079,689.98 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		3,617,980.22	-10,932,285.47
1. 利息收入		16,747.73	46,191.37
其中：存款利息收入	6.4.7.10	16,747.73	46,191.37
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		100,257.16	-5,131,197.93
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-775,123.46	-6,484,148.56
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	75,523.36	6,626.19
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	-	348,205.60
股利收益	6.4.7.17	799,857.26	998,118.84

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	3,488,775.68	-5,881,663.10
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	12,199.65	34,384.19
减：二、营业总支出		1,156,974.73	1,265,268.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	750,430.67	836,342.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	125,071.73	139,390.35
3. 销售服务费		89,443.63	97,343.77
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		0.96	1,447.41
8. 其他费用	6.4.7.21	192,027.74	190,745.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,461,005.49	-12,197,554.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,461,005.49	-12,197,554.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,461,005.49	-12,197,554.16

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	116,636,615.98	-16,983,270.95	99,653,345.03
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	116,636,615.98	-16,983,270.95	99,653,345.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,904,598.86	3,099,026.81	-2,805,572.05

(一)、综合收益总额	-	2,461,005.49	2,461,005.49
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-5,904,598.86	638,021.32	-5,266,577.54
其中: 1. 基金申购款	8,460,459.50	-963,835.39	7,496,624.11
2. 基金赎回款	-14,365,058.36	1,601,856.71	-12,763,201.65
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	110,732,017.12	-13,884,244.14	96,847,772.98
项目	上年度可比期间		
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	130,496,791.31	5,060,332.68	135,557,123.99
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	130,496,791.31	5,060,332.68	135,557,123.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11,313,821.86	-11,375,133.32	-22,688,955.18
(一)、综合收益总额	-	-12,197,554.16	-12,197,554.16
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-11,313,821.86	822,420.84	-10,491,401.02
其中: 1. 基金申购款	14,163,581.66	-1,724,106.54	12,439,475.12
2. 基金赎回款	-25,477,403.52	2,546,527.38	-22,930,876.14
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净	-	-	-

值减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产(基金净值)	119,182,969.45	-6,314,800.64	112,868,168.81

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 500 基本面增强指数型证券投资基金（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[2020]3468 号文《关于准予汇添富中证 500 基本面增强指数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 2021 年 9 月 16 日生效。首次设立基金募集规模为 289,726,227.10 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2021）验字第 60466941_B73 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、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、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与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：本基金股票资产及存托凭证占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日

终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券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。本基金的标的指数为中证 500 指数。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，通过基本面选股方法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。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让

方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

2. 增值税

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

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

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

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	4,783,082.16
等于：本金	4,782,493.26
加：应计利息	588.90
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	4,783,082.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	92,317,529.55	-	91,466,385.79	-851,143.76	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,085,626.00	10,860.95	1,140,256.92	43,769.97
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	1,085,626.00	10,860.95	1,140,256.92	43,769.97
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	93,403,155.55	10,860.95	92,606,642.71	-807,373.79	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.25
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	396,223.52
其中：交易所市场	396,223.52
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	67,315.49
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	50,000.00
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	573,047.63

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 基本面增强指数 A		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	90,376,864.58	90,376,864.58
本期申购	3,335,197.94	3,335,197.94
本期赎回（以“-”号填列）	-8,059,735.38	-8,059,735.38
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	85,652,327.14	85,652,327.14
汇添富中证 500 基本面增强指数 C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,259,751.40	26,259,751.40
本期申购	5,125,261.56	5,125,261.56
本期赎回（以“-”号填列）	-6,305,322.98	-6,305,322.98
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	25,079,689.98	25,079,689.98

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 500 基本面增强指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-9,726,765.33	-3,254,454.23	-12,981,219.56
本期利润	-707,657.98	2,667,178.89	1,959,520.91
本期基金份额交易产生的变动数	472,840.24	50,303.29	523,143.53
其中：基金申购款	-338,317.57	7,681.82	-330,635.75
基金赎回款	811,157.81	42,621.47	853,779.28
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-9,961,583.07	-536,972.05	-10,498,555.12
汇添富中证 500 基本面增强指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-3,051,529.26	-950,522.13	-4,002,051.39
本期利润	-320,112.21	821,596.79	501,484.58
本期基金份额交易产生的变动数	155,255.12	-40,377.33	114,877.79
其中：基金申购款	-588,798.40	-44,401.24	-633,199.64
基金赎回款	744,053.52	4,023.91	748,077.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,216,386.35	-169,302.67	-3,385,689.02

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	9,506.95
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	6,924.20
其他	316.58
合计	16,747.73

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	587,169,459.40
减：卖出股票成本总额	586,421,973.57
减：交易费用	1,522,609.29
买卖股票差价收入	-775,123.46

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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	9,346.12
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	66,177.24
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	75,523.36

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	646,503.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	572,653.00
减：应计利息总额	7,659.53
减：交易费用	13.59
买卖债券差价收入	66,177.24

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	799,857.26
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	799,857.26

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,488,775.68
——股票投资	3,510,914.99
——债券投资	-22,139.31
——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	3,488,775.68

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	12,199.65
替代损益	-
其他	-
合计	12,199.65

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	1,204.88
指数使用费	100,000.00
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	192,027.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	105,430,600.24	9.02	13,071,317.35	4.04

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	100,070.00	12.47

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 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 (%)
东方证券	76,046.65	9.02	27,528.92	6.95
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣

		量的比例 (%)		金总额的比例 (%)
东方证券	9,524.50	4.11	3,564.16	2.74

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	750,430.67	836,342.10
其中：支付销售机构的客户维护费	158,054.01	333,938.05

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 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、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	125,071.73	139,390.35

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 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、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C	合计
东方证券股份有限公司	-	79.55	79.55
汇添富基金管理股份有限公司	-	8,212.38	8,212.38
中国建设银行股份有限公司	-	14,707.33	14,707.33
合计	-	22,999.26	22,999.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C	合计
东方证券股份有限公司	-	85.43	85.43
汇添富基金管理股份有限公司	-	7,309.00	7,309.00
中国建设银行股份有限公司	-	14,930.80	14,930.80
合计	-	22,325.23	22,325.23

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 0.80%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理

人核对一致的财务数据，自动在月初 5 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、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	4,783,082.16	9,506.95	5,420,172.27	11,161.96

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（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司

发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素

的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 3 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1 - 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资产							
银行 存款	4,783,082.1 6	-	-	-	-	-	4,783,082.16
结 算 备 付 金	805,092.91	-	-	-	-	-	805,092.91
存 出 保 证 金	36,544.69	-	-	-	-	-	36,544.69
交 易 性 金 融	224,760.77	3,923.11	911,573.0 4	-	-	91,466,385.7 9	92,606,642.71

资产							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,043,576.22	1,043,576.22
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	21,672.96	21,672.96
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

产							
资产总计	5,849,480.53	3,923.11	911,573.04	-	-	92,531,634.97	99,296,611.65
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	-	-	-	-	-	1,537,069.81	1,537,069.81
应付赎回款	-	-	-	-	-	185,814.36	185,814.36
应	-	-	-	-	-	118,773.55	118,773.55

付 管 理 人 报 酬							
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	19,795.59	19,795.59
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	14,336.18	14,336.18
应 付 投 资 顾 问 费	-	-	-	-	-	-	-
应 交 税 费	-	-	-	-	-	1.55	1.55
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
递 延 所 得 税 负 债	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	573,047.63	573,047.63

负债总计	-	-	-	-	-	2,448,838.67	2,448,838.67
利率敏感度缺口	5,849,480.53	3,923.11	911,573.04	-	-	90,082,796.30	96,847,772.98
上年度末 2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,076,482.40	-	-	-	-	-	6,076,482.40
结算备付金	1,099,456.32	-	-	-	-	-	1,099,456.32
存出保证金	36,300.49	-	-	-	-	-	36,300.49
交易性金融资产	133,190.79	430,188.76	612,155.38	-	-	91,967,508.45	93,143,043.38

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	-	-	-	-	-	13,909.79	13,909.79
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资	7,345,430.0	430,188.7	612,155.3	-	-	91,981,418.2	100,369,192.3

产总计	0	6	8			4	8
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	-	-	-	-	-	14,513.78	14,513.78
应付管	-	-	-	-	-	128,509.41	128,509.41

理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	21,418.25	21,418.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,366.18	15,366.18
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1.05	1.05
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	536,038.68	536,038.68
负债	-	-	-	-	-	715,847.35	715,847.35

总计							
利率敏感度缺口	7,345,430.00	430,188.76	612,155.38	-	-	91,265,570.89	99,653,345.03

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	959.68	1,039.46
	基准利率增加 25 个基点	-957.18	-1,035.85

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	91,466,385.79	94.44	91,967,508.45	92.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,140,256.92	1.18	1,175,534.93	1.18
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	92,606,642.71	95.62	93,143,043.38	93.47

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上涨 5%	4,444,140.85	4,656,038.94
中证 500 指数下跌 5%	-4,444,140.85	-4,656,038.94	

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日
第一层次	91,695,069.67
第二层次	911,573.04
第三层次	-
合计	92,606,642.71

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	91,466,385.79	92.11
	其中：股票	91,466,385.79	92.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,140,256.92	1.15
	其中：债券	1,140,256.92	1.15
	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	5,588,175.07	5.63
8	其他各项资产	1,101,793.87	1.11
9	合计	99,296,611.65	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	872,115.00	0.90
B	采矿业	2,716,209.00	2.80
C	制造业	50,488,812.09	52.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	807,000.00	0.83
F	批发和零售业	1,988,182.14	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	2,706,035.00	2.79
H	住宿和餐饮业	259,615.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,235,929.76	4.37
J	金融业	3,838,692.00	3.96
K	房地产业	3,623,737.00	3.74
L	租赁和商务服务业	600,280.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	259,276.00	0.27

N	水利、环境和公共设施管理业	335,523.00	0.35
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	1,825,876.00	1.89
S	综合	-	-
	合计	74,557,281.99	76.98

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	23,465.00	0.02
B	采矿业	45,540.00	0.05
C	制造业	13,070,878.65	13.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	75,070.00	0.08
E	建筑业	58,221.00	0.06
F	批发和零售业	49,743.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	438,001.00	0.45
H	住宿和餐饮业	12,702.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	271,640.90	0.28
J	金融业	144,611.00	0.15
K	房地产业	67,032.00	0.07
L	租赁和商务服务业	40,382.30	0.04
M	科学研究和技术服务业	34,696.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	43,969.60	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,490,987.35	1.54
R	文化、体育和娱乐业	1,033,812.00	1.07
S	综合	8,352.00	0.01
	合计	16,909,103.80	17.46

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	600325	华发股份	192,200	1,893,170.00	1.95
2	000683	远兴能源	256,200	1,842,078.00	1.90
3	000783	长江证券	278,700	1,616,460.00	1.67
4	002673	西部证券	250,400	1,590,040.00	1.64
5	603688	石英股份	13,000	1,479,920.00	1.53
6	000729	燕京啤酒	107,700	1,343,019.00	1.39
7	002739	万达电影	94,300	1,182,522.00	1.22
8	002025	航天电器	16,900	1,078,220.00	1.11
9	600060	海信视像	41,100	1,017,225.00	1.05
10	688072	拓荆科技	2,324	989,954.28	1.02
11	000997	新大陆	50,700	958,230.00	0.99
12	603596	伯特利	11,500	911,490.00	0.94
13	688002	睿创微纳	20,000	896,000.00	0.93
14	603056	德邦股份	56,700	874,314.00	0.90
15	002738	中矿资源	16,940	862,923.60	0.89
16	002299	圣农发展	44,900	859,835.00	0.89
17	603218	日月股份	44,700	848,853.00	0.88
18	600582	天地科技	142,000	827,860.00	0.85
19	300115	长盈精密	69,300	825,363.00	0.85
20	002745	木林森	89,200	820,640.00	0.85
21	688390	固德威电源	4,840	807,602.40	0.83

22	600170	上海建工	300,000	807,000.00	0.83
23	301029	怡合达	17,740	792,623.20	0.82
24	603885	吉祥航空	50,200	774,586.00	0.80
25	002422	科伦药业	25,500	756,840.00	0.78
26	002223	鱼跃医疗	21,000	755,790.00	0.78
27	002600	领益智造	108,400	749,044.00	0.77
28	603228	景旺电子	28,900	741,285.00	0.77
29	000739	普洛药业	40,700	722,018.00	0.75
30	000089	深圳机场	103,600	720,020.00	0.74
31	603650	彤程新材	21,800	715,040.00	0.74
32	000738	航发控制	29,100	710,040.00	0.73
33	002249	大洋电机	120,900	689,130.00	0.71
34	002056	横店东磁	37,600	684,696.00	0.71
35	600481	双良节能	48,000	671,040.00	0.69
36	300146	汤臣倍健	27,700	664,246.00	0.69
37	688029	南微医学科技	8,100	660,636.00	0.68
38	688234	天岳先进	8,900	658,066.00	0.68
39	000630	铜陵有色	224,800	649,672.00	0.67
40	601958	金钼股份	58,200	648,930.00	0.67
41	603225	新凤鸣	58,300	644,215.00	0.67
42	000878	云南铜业	58,100	642,005.00	0.66
43	600038	中直股份	16,000	637,120.00	0.66
44	002563	森马服	100,900	627,598.00	0.65

		饰			
45	000423	东阿阿胶	11,600	620,020.00	0.64
46	603868	飞科电器	9,700	611,973.00	0.63
47	603737	三棵树	8,960	586,163.20	0.61
48	600418	江淮汽车	45,600	574,104.00	0.59
49	300861	美畅股份	13,000	563,810.00	0.58
50	002518	科士达	13,400	536,134.00	0.55
51	601168	西部矿业	49,900	524,449.00	0.54
52	603638	艾迪精密	24,800	508,896.00	0.53
53	001914	招商积余	33,300	501,165.00	0.52
54	601717	郑煤机	39,600	493,020.00	0.51
55	000623	吉林敖东	30,700	492,428.00	0.51
56	002250	联化科技	46,900	490,574.00	0.51
57	002373	千方科技	35,800	488,312.00	0.50
58	002138	顺络电子	20,100	480,591.00	0.50
59	603786	科博达	7,300	479,610.00	0.50
60	600580	卧龙电驱	32,800	479,208.00	0.49
61	600497	驰宏锌锗	94,300	473,386.00	0.49
62	000537	广宇发展	40,200	469,134.00	0.48
63	600699	均胜电子	26,300	463,932.00	0.48
64	002273	水晶光电	38,200	456,108.00	0.47
65	002244	滨江集团	51,700	455,994.00	0.47
66	000012	南玻 A	75,700	451,172.00	0.47
67	600399	抚顺特钢	44,000	448,800.00	0.46

68	300136	信维通信	22,300	447,784.00	0.46
69	000709	河钢股份	197,500	446,350.00	0.46
70	002203	海亮股份	36,500	438,365.00	0.45
71	688188	上海柏楚电子科技	2,300	433,688.00	0.45
72	601869	长飞光纤	11,400	421,914.00	0.44
73	002683	广东宏大	14,200	418,048.00	0.43
74	600329	达仁堂	9,176	411,910.64	0.43
75	600516	方大炭素	65,900	408,580.00	0.42
76	688208	道通科技	13,427	406,972.37	0.42
77	603317	天味食品	27,300	398,853.00	0.41
78	300395	菲利华	8,100	398,520.00	0.41
79	002078	太阳纸业	37,100	396,599.00	0.41
80	002010	传化智联	74,300	395,276.00	0.41
81	688777	中控技术	6,235	391,433.30	0.40
82	600131	国网信通	19,300	389,667.00	0.40
83	002568	百润股份	10,500	381,675.00	0.39
84	600161	天坛生物	14,000	380,100.00	0.39
85	603927	中科软	9,600	370,176.00	0.38
86	300866	安克创新	4,200	367,500.00	0.38
87	600885	宏发股份	11,500	366,275.00	0.38
88	000937	冀中能源	57,000	363,660.00	0.38
89	600143	金发科技	41,500	362,295.00	0.37
90	600416	湘电股	18,800	358,892.00	0.37

		份			
91	300699	光威复材	11,600	357,860.00	0.37
92	002065	东华软件	50,441	356,113.46	0.37
93	300724	捷佳伟创	3,100	348,285.00	0.36
94	002110	三钢闽光	82,100	346,462.00	0.36
95	603883	老百姓	11,420	340,887.00	0.35
96	600487	亨通光电	23,200	340,112.00	0.35
97	601000	唐山港	95,500	337,115.00	0.35
98	300487	蓝晓科技	5,400	337,068.00	0.35
99	300144	宋城演艺	26,700	331,080.00	0.34
100	002985	北摩高科	7,500	330,900.00	0.34
101	603233	大参林	11,800	330,518.00	0.34
102	000967	盈峰环境	65,400	330,270.00	0.34
103	600398	海澜之家	47,200	324,736.00	0.34
104	600096	云天化	18,900	322,623.00	0.33
105	300017	网宿科技	45,100	320,661.00	0.33
106	688082	盛美上海半导体	2,900	320,160.00	0.33
107	600563	法拉电子	2,300	315,790.00	0.33
108	300251	光线传媒	38,600	312,274.00	0.32
109	002867	周大生	17,400	309,372.00	0.32
110	000031	大悦城	81,900	299,754.00	0.31
111	600655	豫园股份	43,000	294,980.00	0.30
112	600998	九州通	27,753	288,076.14	0.30
113	002221	东华能源	32,000	276,800.00	0.29
114	600985	淮北矿业	23,600	271,872.00	0.28

115	600511	国药股份	6,900	268,065.00	0.28
116	002966	苏州银行	40,900	267,895.00	0.28
117	000400	许继电气	11,600	267,380.00	0.28
118	600637	东方明珠	33,800	264,316.00	0.27
119	600535	天士力	18,200	264,082.00	0.27
120	688516	奥特维科技	1,400	263,760.00	0.27
121	600258	首旅酒店	13,700	259,615.00	0.27
122	000060	中金岭南	54,500	258,875.00	0.27
123	002531	天顺风能	16,700	254,341.00	0.26
124	603127	昭衍新药	6,200	253,580.00	0.26
125	603456	九洲药业	9,200	251,896.00	0.26
126	600765	中航重机	9,300	246,543.00	0.25
127	300438	鹏辉能源	5,100	245,004.00	0.25
128	002439	启明星辰	8,200	244,032.00	0.25
129	600879	航天电子	28,700	243,663.00	0.25
130	002595	豪迈科技	6,400	224,832.00	0.23
131	300009	安科生物	22,100	221,000.00	0.23
132	688006	浙江杭可科技	7,020	213,899.40	0.22
133	601128	常熟银行	31,200	212,784.00	0.22
134	600271	航天信息	15,400	210,826.00	0.22
135	600808	马钢股份	80,500	206,885.00	0.21
136	300058	蓝色光标	21,200	205,004.00	0.21

137	000636	风华高科	13,300	204,022.00	0.21
138	002901	大博医疗	6,200	192,696.00	0.20
139	600755	厦门国贸	24,400	188,856.00	0.20
140	600079	人福医药	6,100	164,334.00	0.17
141	600109	国金证券	7,500	65,025.00	0.07
142	600369	西南证券	17,800	64,970.00	0.07
143	002128	电投能源	1,200	15,864.00	0.02
144	600315	上海家化	500	14,505.00	0.01
145	601966	玲珑轮胎	600	13,332.00	0.01
146	000998	隆平高科	800	12,280.00	0.01
147	002153	石基信息	780	10,920.00	0.01
148	601577	长沙银行	1,100	8,536.00	0.01
149	002195	二三四五	2,900	8,381.00	0.01
150	002423	中粮资本	900	7,200.00	0.01
151	603077	和邦生物	2,900	7,047.00	0.01
152	000629	钒钛股份	1,800	7,038.00	0.01
153	600901	江苏金租	1,400	5,782.00	0.01
154	003035	南网能源	800	5,696.00	0.01
155	603568	伟明环保	300	5,253.00	0.01
156	000932	华菱钢铁	1,100	5,247.00	0.01
157	000402	金融街	1,000	4,520.00	0.00
158	000778	新兴铸管	700	2,856.00	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	688239	贵州航宇科技	31,250	2,185,937.50	2.26
2	688668	鼎通科技	18,396	1,799,128.80	1.86
3	301267	华夏眼科	23,653	1,441,650.35	1.49
4	688630	芯碁微装	14,153	1,189,135.06	1.23
5	688160	步科自动化	12,883	1,075,730.50	1.11
6	688025	杰普特光电	12,096	1,056,585.60	1.09
7	002068	黑猫股份	86,300	1,024,381.00	1.06
8	300364	中文在线	53,600	955,152.00	0.99
9	600199	金种子酒	39,700	942,478.00	0.97
10	603260	合盛硅业	13,200	924,264.00	0.95
11	002166	莱茵生物	69,400	589,900.00	0.61
12	601333	广深铁路	60,000	237,600.00	0.25
13	600918	中泰证券	11,400	78,774.00	0.08
14	000951	中国重汽	2,800	47,180.00	0.05
15	300896	爱美客	100	44,495.00	0.05
16	002912	中新赛克	1,000	44,010.00	0.05
17	688083	中望软件	280	40,569.20	0.04
18	002928	华夏航空	4,400	37,180.00	0.04
19	002051	中工国际	3,100	36,983.00	0.04
20	002233	塔牌集团	4,700	36,284.00	0.04
21	688106	金宏气体	1,300	35,360.00	0.04
22	601111	中国国航	4,000	32,960.00	0.03
23	601003	柳钢股份	8,000	32,320.00	0.03
24	000420	吉林化纤	8,700	32,277.00	0.03
25	603367	辰欣药业	2,100	31,878.00	0.03
26	603027	千禾味业	1,500	31,680.00	0.03
27	002179	中航光电	690	31,291.50	0.03
28	603920	世运电路	1,600	31,248.00	0.03
29	601619	嘉泽新能	6,800	30,940.00	0.03
30	603859	能科科技	600	30,678.00	0.03
31	601137	博威合金	1,900	29,564.00	0.03

32	002641	公元股份	5,200	29,328.00	0.03
33	000528	柳 工	3,700	29,230.00	0.03
34	600897	厦门空港	1,400	28,966.00	0.03
35	601021	春秋航空	500	28,735.00	0.03
36	600748	上实发展	7,100	28,045.00	0.03
37	603979	金诚信	900	27,990.00	0.03
38	002027	分众传媒	4,100	27,921.00	0.03
39	300855	图南股份	780	27,549.60	0.03
40	000338	潍柴动力	2,200	27,412.00	0.03
41	601163	三角轮胎	1,700	26,979.00	0.03
42	600362	江西铜业	1,400	26,572.00	0.03
43	688018	乐鑫科技	200	25,964.00	0.03
44	002484	江海股份	1,200	25,548.00	0.03
45	600977	中国电影	1,800	25,290.00	0.03
46	300143	盈康生命	2,200	24,948.00	0.03
47	002108	沧州明珠	5,500	24,915.00	0.03
48	000596	古井贡酒	100	24,738.00	0.03
49	000516	国际医学	2,900	24,389.00	0.03
50	002459	晶澳科技	580	24,186.00	0.02
51	600029	南方航空	4,000	24,120.00	0.02
52	603195	公牛集团	248	23,822.88	0.02
53	300236	上海新阳	600	23,790.00	0.02
54	600211	西藏药业	400	23,760.00	0.02
55	300777	中简科技	500	23,630.00	0.02
55	603466	风语筑	1,700	23,630.00	0.02
57	600926	杭州银行	2,000	23,500.00	0.02
58	000534	万泽股份	1,400	23,478.00	0.02
59	002458	益生股份	1,900	23,465.00	0.02
60	002038	双鹭药业	2,300	23,207.00	0.02
61	300332	天壕环境	2,000	22,940.00	0.02
62	300750	宁德时代	100	22,879.00	0.02
63	300109	新开源	900	22,383.00	0.02
64	603899	晨光股份	500	22,320.00	0.02
65	600761	安徽合力	1,100	21,923.00	0.02
66	002270	华明装备	2,000	21,900.00	0.02
67	300450	先导智能	600	21,702.00	0.02
68	603290	斯达半导	100	21,520.00	0.02
69	300811	铂科新材	360	21,398.40	0.02
70	688599	天合光能	501	21,347.61	0.02
71	300316	晶盛机电	300	21,270.00	0.02
72	002832	比音勒芬	600	21,246.00	0.02
73	601669	中国电建	3,700	21,238.00	0.02
74	600572	康恩贝	3,100	21,235.00	0.02

75	002215	诺普信	2,800	21,028.00	0.02
76	603690	至纯科技	600	20,904.00	0.02
77	603032	德新科技	600	20,724.00	0.02
78	002237	恒邦股份	1,900	20,691.00	0.02
79	600007	中国国贸	1,100	20,372.00	0.02
80	300775	三角防务	600	20,268.00	0.02
81	603308	应流股份	1,100	20,130.00	0.02
82	688318	财富趋势	200	19,994.00	0.02
83	600312	平高电气	1,600	19,824.00	0.02
84	600488	津药药业	3,500	19,670.00	0.02
85	601877	正泰电器	700	19,355.00	0.02
86	688711	江苏宏微科技	330	19,252.20	0.02
87	601567	三星医疗	1,500	18,945.00	0.02
88	000811	冰轮环境	1,200	18,912.00	0.02
89	002402	和而泰	1,100	18,678.00	0.02
90	600639	浦东金桥	1,500	18,615.00	0.02
91	600809	山西汾酒	100	18,507.00	0.02
92	000888	峨眉山A	1,600	18,336.00	0.02
93	000157	中联重科	2,700	18,225.00	0.02
94	300014	亿纬锂能	300	18,150.00	0.02
95	688639	华恒生物	200	18,096.00	0.02
96	300443	金雷股份	500	17,725.00	0.02
97	600583	海油工程	3,000	17,550.00	0.02
98	600919	江苏银行	2,300	16,905.00	0.02
99	688366	昊海生物科技	200	16,844.00	0.02
100	603103	横店影视	1,000	16,840.00	0.02
101	002782	可立克	1,100	16,819.00	0.02
102	002959	小熊电器	200	16,700.00	0.02
103	603383	顶点软件	300	16,626.00	0.02
104	002097	山河智能	2,500	16,625.00	0.02
105	002859	洁美科技	600	16,620.00	0.02
106	601933	永辉超市	5,300	16,589.00	0.02
107	300433	蓝思科技	1,400	16,464.00	0.02
108	688568	中科星图公司	200	16,116.00	0.02
109	603297	永新光学	200	15,980.00	0.02
110	300674	宇信科技	900	15,912.00	0.02
111	601519	大智慧	2,200	15,752.00	0.02
112	603997	继峰股份	1,100	15,730.00	0.02
113	600845	宝信软件	300	15,243.00	0.02
114	600323	瀚蓝环境	800	15,144.00	0.02

115	600425	青松建化	3,400	15,028.00	0.02
116	688100	威胜信息	500	14,905.00	0.02
117	688556	高测科技 股份	280	14,879.20	0.02
118	688091	上海谊众 药业	200	14,726.00	0.02
119	600420	国药现代	1,300	14,677.00	0.02
120	002851	麦格米特	400	14,588.00	0.02
121	002938	鹏鼎控股	600	14,574.00	0.02
122	600004	白云机场	1,000	14,340.00	0.01
123	300036	超图软件	600	14,226.00	0.01
124	000969	安泰科技	1,500	14,205.00	0.01
125	603298	杭叉集团	600	14,130.00	0.01
126	300762	上海瀚讯	1,200	14,124.00	0.01
127	600612	老凤祥	200	13,976.00	0.01
128	600933	爱柯迪	600	13,974.00	0.01
129	688518	联赢激光 股份	500	13,930.00	0.01
130	600011	华能国际	1,500	13,890.00	0.01
131	002236	大华股份	700	13,825.00	0.01
132	000063	中兴通讯	300	13,662.00	0.01
133	300638	广和通	600	13,608.00	0.01
134	000768	中航西飞	500	13,375.00	0.01
135	603283	赛腾股份	300	13,350.00	0.01
136	600570	恒生电子	300	13,287.00	0.01
137	002446	盛路通信	1,400	13,230.00	0.01
138	600458	时代新材	1,100	13,189.00	0.01
139	000922	佳电股份	1,000	13,160.00	0.01
140	600757	长江传媒	1,500	12,900.00	0.01
141	002419	天虹股份	2,200	12,870.00	0.01
142	601100	恒立液压	200	12,866.00	0.01
143	002106	莱宝高科	1,500	12,750.00	0.01
144	603915	国茂股份	600	12,708.00	0.01
145	601908	京运通	2,100	12,705.00	0.01
146	600754	锦江酒店	300	12,702.00	0.01
147	600760	中航沈飞	280	12,600.00	0.01
148	002434	万里扬	1,400	12,530.00	0.01
149	688007	光峰科技	600	12,510.00	0.01
150	605168	三人行	145	12,461.30	0.01
151	002129	TCL 中环	375	12,450.00	0.01
152	002126	银轮股份	700	12,390.00	0.01
153	603327	福蓉科技	1,040	12,355.20	0.01
154	300747	锐科激光	400	12,192.00	0.01

155	002737	葵花药业	500	12,170.00	0.01
156	002668	奥马电器	1,400	12,096.00	0.01
157	300999	金龙鱼	300	11,997.00	0.01
158	603567	珍宝岛	800	11,968.00	0.01
159	603699	纽威股份	800	11,904.00	0.01
160	600035	楚天高速	2,900	11,832.00	0.01
161	002489	浙江永强	2,900	11,745.00	0.01
162	300098	高新兴	3,200	11,680.00	0.01
163	600085	同仁堂	200	11,512.00	0.01
164	002334	英威腾	900	11,466.00	0.01
165	601107	四川成渝	2,800	11,396.00	0.01
166	002074	国轩高科	400	11,048.00	0.01
167	002271	东方雨虹	400	10,904.00	0.01
168	300633	开立医疗	200	10,900.00	0.01
169	300294	博雅生物	300	10,884.00	0.01
170	002320	海峡股份	1,800	10,872.00	0.01
171	600197	伊力特	400	10,868.00	0.01
172	603613	国联股份	290	10,709.70	0.01
173	600552	凯盛科技	900	10,656.00	0.01
174	600771	广誉远	300	10,581.00	0.01
175	000538	云南白药	200	10,496.00	0.01
176	603985	恒润股份	500	10,485.00	0.01
177	000100	TCL 科技	2,640	10,401.60	0.01
178	000860	顺鑫农业	300	10,107.00	0.01
179	603398	沐邦高科	400	9,836.00	0.01
180	300738	奥飞数据	960	9,792.00	0.01
181	002212	天融信	1,000	9,700.00	0.01
182	601066	中信建投	400	9,680.00	0.01
183	300039	上海凯宝	1,400	9,660.00	0.01
184	300041	回天新材	780	9,204.00	0.01
185	002033	丽江股份	800	8,704.00	0.01
186	300130	新国都	300	8,499.00	0.01
187	600603	广汇物流	1,200	8,352.00	0.01
187	601311	骆驼股份	900	8,352.00	0.01
189	300232	洲明科技	900	8,226.00	0.01
190	000906	浙商中拓	900	8,028.00	0.01
191	002895	川恒股份	400	7,880.00	0.01
192	002139	拓邦股份	600	7,830.00	0.01
193	002063	远光软件	900	7,812.00	0.01
194	600459	贵研铂业	500	7,650.00	0.01
195	000539	粤电力 A	1,000	7,300.00	0.01
196	002154	报喜鸟	1,300	7,176.00	0.01
197	600894	广日股份	900	6,777.00	0.01

198	600729	重庆百货	200	6,288.00	0.01
199	000950	重药控股	800	5,384.00	0.01
200	600537	亿晶光电	700	5,348.00	0.01
201	300319	麦捷科技	600	5,136.00	0.01
202	002967	广电计量	200	4,018.00	0.00
203	002284	亚太股份	300	2,691.00	0.00
204	300815	玉禾田	120	1,785.60	0.00
205	002697	红旗连锁	100	584.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601555	东吴证券	6,158,748.45	6.18
2	300364	中文在线	6,109,215.44	6.13
3	301267	华夏眼科	5,922,503.50	5.94
4	002683	广东宏大	5,120,000.00	5.14
5	600699	均胜电子	5,110,486.00	5.13
6	601168	西部矿业	4,766,996.00	4.78
7	300848	美瑞新材	4,595,888.00	4.61
8	002056	横店东磁	4,556,942.00	4.57
9	002738	中矿资源	4,481,324.00	4.50
10	688390	固德威电源	4,228,368.47	4.24
11	300058	蓝色光标	4,211,691.00	4.23
12	300724	捷佳伟创	4,176,100.00	4.19
13	002299	圣农发展	4,056,033.00	4.07
14	688063	派能科技	4,028,754.44	4.04
15	600143	金发科技	4,013,881.00	4.03
16	002595	豪迈科技	3,991,707.00	4.01
17	002192	融捷股份	3,902,922.69	3.92
18	600026	中远海能	3,888,883.00	3.90
19	600208	新湖中宝	3,861,267.00	3.87
20	601128	常熟银行	3,851,567.00	3.86
21	603688	石英股份	3,822,241.00	3.84
22	000009	中国宝安	3,818,563.00	3.83
23	000729	燕京啤酒	3,732,075.00	3.75
24	002966	苏州银行	3,672,314.00	3.69
25	002739	万达电影	3,668,269.00	3.68
26	688009	中国通号	3,581,319.73	3.59
27	002025	航天电器	3,501,076.96	3.51

28	603596	伯特利	3,496,041.00	3.51
29	603127	昭衍新药	3,454,249.05	3.47
30	600580	卧龙电驱	3,418,707.00	3.43
31	600415	小商品城	3,406,795.94	3.42
32	601717	郑煤机	3,392,047.70	3.40
33	300308	中际旭创	3,371,051.00	3.38
34	300146	汤臣倍健	3,322,944.00	3.33
35	600563	法拉电子	3,304,527.00	3.32
36	000623	吉林敖东	3,271,874.70	3.28
37	600901	江苏金租	3,253,466.00	3.26
38	600060	海信视像	3,244,829.63	3.26
39	688002	睿创微纳	3,188,161.50	3.20
40	002010	传化智联	3,166,731.00	3.18
41	688208	道通科技	3,089,274.58	3.10
42	002203	海亮股份	3,081,071.00	3.09
43	600066	宇通客车	3,012,330.00	3.02
44	600298	安琪酵母	2,992,515.00	3.00
45	600325	华发股份	2,969,670.00	2.98
46	600702	舍得酒业	2,966,334.00	2.98
47	300567	精测电子	2,928,858.00	2.94
48	002244	滨江集团	2,884,287.00	2.89
49	000878	云南铜业	2,882,863.00	2.89
50	603650	彤程新材	2,880,042.34	2.89
51	000012	南玻A	2,875,190.00	2.89
52	600038	中直股份	2,864,069.00	2.87
53	603883	老百姓	2,859,545.27	2.87
54	002422	科伦药业	2,847,791.00	2.86
55	600271	航天信息	2,778,427.00	2.79
56	603317	天味食品	2,768,076.40	2.78
57	600998	九州通	2,708,577.74	2.72
58	600170	上海建工	2,706,951.00	2.72
59	300115	长盈精密	2,655,226.00	2.66
60	600801	华新水泥	2,639,786.04	2.65
61	000739	普洛药业	2,591,832.00	2.60
62	002273	水晶光电	2,567,968.00	2.58
63	600827	百联股份	2,540,620.00	2.55
64	688567	孚能科技	2,518,545.60	2.53
65	603444	吉比特	2,442,200.46	2.45
66	603613	国联股份	2,434,803.00	2.44
67	000997	新大陆	2,428,454.95	2.44
68	603056	德邦股份	2,420,986.00	2.43
69	600765	中航重机	2,399,164.00	2.41
70	603228	景旺电子	2,390,688.00	2.40

71	600166	福田汽车	2,371,063.00	2.38
72	300136	信维通信	2,341,502.00	2.35
73	601958	金钼股份	2,325,855.00	2.33
74	300888	稳健医疗	2,293,881.44	2.30
75	000709	河钢股份	2,229,415.00	2.24
76	002673	西部证券	2,203,014.00	2.21
77	300009	安科生物	2,195,666.60	2.20
78	002444	巨星科技	2,185,155.37	2.19
79	600372	中航电子	2,179,262.00	2.19
80	002384	东山精密	2,170,118.00	2.18
81	603939	益丰药房	2,149,133.00	2.16
82	002690	美亚光电	2,144,436.00	2.15
83	600549	厦门钨业	2,124,486.00	2.13
84	600399	抚顺特钢	2,112,162.00	2.12
85	600282	南钢股份	2,112,106.00	2.12
86	688261	东微半导体	2,106,721.88	2.11
87	002850	科达利	2,094,305.00	2.10
88	600398	海澜之家	2,076,715.00	2.08
89	300861	美畅股份	2,066,824.00	2.07
90	300442	润泽科技	2,059,777.00	2.07
91	001914	招商积余	2,050,111.98	2.06
92	300856	科思股份	2,048,598.00	2.06
93	000860	顺鑫农业	2,037,522.00	2.04
94	300866	安克创新	2,035,690.00	2.04
95	000683	远兴能源	2,021,576.00	2.03
96	600511	国药股份	2,020,225.00	2.03
97	600109	国金证券	2,016,053.00	2.02
98	688301	奕瑞科技股 份	2,007,535.22	2.01

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	601555	东吴证券	6,756,963.00	6.78
2	688390	固德威电源	6,008,664.42	6.03
3	600026	中远海能	5,107,247.56	5.13
4	600901	江苏金租	5,079,148.00	5.10
5	300308	中际旭创	5,053,867.00	5.07

6	300364	中文在线	4,983,074.00	5.00
7	600415	小商品城	4,765,991.00	4.78
8	688063	派能科技	4,726,838.07	4.74
9	600699	均胜电子	4,687,818.48	4.70
10	002683	广东宏大	4,671,483.00	4.69
11	300848	美瑞新材	4,584,567.00	4.60
12	601128	常熟银行	4,428,068.00	4.44
13	300058	蓝色光标	4,427,118.00	4.44
14	300724	捷佳伟创	4,369,523.00	4.38
15	601168	西部矿业	4,356,325.08	4.37
16	002192	融捷股份	4,211,409.00	4.23
17	601717	郑煤机	4,206,246.00	4.22
18	600765	中航重机	4,171,949.45	4.19
19	002738	中矿资源	4,167,993.80	4.18
20	603317	天味食品	4,111,196.52	4.13
21	002595	豪迈科技	4,104,911.98	4.12
22	600208	新湖中宝	3,965,972.00	3.98
23	002273	水晶光电	3,905,511.00	3.92
24	301267	华夏眼科	3,856,375.50	3.87
25	603688	石英股份	3,824,128.00	3.84
26	002299	圣农发展	3,823,814.00	3.84
27	300017	网宿科技	3,799,014.00	3.81
28	000009	中国宝安	3,789,832.00	3.80
29	600563	法拉电子	3,786,666.00	3.80
30	688009	中国通号	3,738,117.93	3.75
31	002056	横店东磁	3,700,540.08	3.71
32	600143	金发科技	3,600,586.00	3.61
33	603127	昭衍新药	3,574,257.14	3.59
34	000012	南玻A	3,438,276.85	3.45
35	300856	科思股份	3,418,021.00	3.43
36	600580	卧龙电驱	3,408,093.00	3.42
37	002966	苏州银行	3,405,096.50	3.42
38	603613	国联股份	3,369,535.00	3.38
39	600282	南钢股份	3,357,533.00	3.37
40	600298	安琪酵母	3,356,116.75	3.37
41	000623	吉林敖东	3,250,402.00	3.26
42	600066	宇通客车	3,228,182.00	3.24
43	000878	云南铜业	3,169,220.00	3.18
44	000729	燕京啤酒	3,165,406.00	3.18
45	600060	海信视像	3,107,980.00	3.12
46	300832	新产业	3,063,875.00	3.07
47	002384	东山精密	3,040,579.00	3.05
48	002831	裕同科技	3,029,294.62	3.04

49	600998	九州通	3,008,943.00	3.02
50	002244	滨江集团	3,002,763.96	3.01
51	300888	稳健医疗	2,995,790.40	3.01
52	300136	信维通信	2,967,203.00	2.98
53	300009	安科生物	2,927,335.00	2.94
54	688002	睿创微纳	2,927,262.01	2.94
55	002497	雅化集团	2,836,150.36	2.85
56	002353	杰瑞股份	2,830,214.00	2.84
57	300115	长盈精密	2,829,900.89	2.84
58	601869	长飞光纤	2,821,198.00	2.83
59	600967	内蒙一机	2,820,801.00	2.83
60	002422	科伦药业	2,811,582.00	2.82
61	603444	吉比特	2,777,836.00	2.79
62	600702	舍得酒业	2,756,334.00	2.77
63	603883	老百姓	2,755,632.54	2.77
64	002010	传化智联	2,752,669.00	2.76
65	600549	厦门钨业	2,745,213.00	2.75
66	300567	精测电子	2,738,315.00	2.75
67	600521	华海药业	2,729,880.00	2.74
68	002203	海亮股份	2,677,407.00	2.69
69	600027	华电国际	2,670,952.00	2.68
70	603379	三美股份	2,655,929.00	2.67
71	600372	中航电子	2,641,976.70	2.65
72	600827	百联股份	2,641,608.00	2.65
73	600801	华新水泥	2,638,017.00	2.65
74	300146	汤臣倍健	2,617,682.00	2.63
75	603596	伯特利	2,597,038.00	2.61
76	600271	航天信息	2,567,328.00	2.58
77	000887	中鼎股份	2,535,714.00	2.54
78	002124	天邦食品	2,513,911.00	2.52
79	688779	长远锂科	2,511,284.81	2.52
80	600598	北大荒	2,499,898.91	2.51
81	688208	道通科技	2,490,785.14	2.50
82	300866	安克创新	2,470,218.99	2.48
83	688567	孚能科技	2,467,964.56	2.48
84	002025	航天电器	2,454,413.00	2.46
85	300070	碧水源	2,434,644.00	2.44
86	688301	奕瑞科技股份	2,390,048.20	2.40
87	600566	济川药业	2,386,825.00	2.40
88	600166	福田汽车	2,364,773.00	2.37
89	603228	景旺电子	2,346,866.00	2.36
90	002739	万达电影	2,304,004.00	2.31

91	603000	人民网	2,277,097.00	2.29
92	001914	招商积余	2,259,568.00	2.27
93	688122	西部超导	2,246,074.29	2.25
94	600038	中直股份	2,175,909.00	2.18
95	002444	巨星科技	2,165,131.99	2.17
96	603650	彤程新材	2,146,110.00	2.15
97	000860	顺鑫农业	2,145,251.00	2.15
98	002250	联化科技	2,137,882.00	2.15
99	000513	丽珠集团	2,128,138.00	2.14
100	603939	益丰药房	2,122,765.00	2.13
101	002468	申通快递	2,117,315.00	2.12
102	002850	科达利	2,114,819.00	2.12
103	002399	海普瑞	2,089,854.40	2.10
104	600021	上海电力	2,086,867.00	2.09
105	300442	润泽科技	2,072,118.00	2.08

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	582,409,935.92
卖出股票收入（成交）总额	587,169,459.40

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	911,573.04	0.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	228,683.88	0.24
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,140,256.92	1.18

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019688	22 国债 23	4,000	404,477.04	0.42
2	019663	21 国债 15	3,000	306,043.40	0.32
3	019703	23 国债 10	2,000	201,052.60	0.21
4	127064	杭氧转债	347	53,541.30	0.06
5	110089	兴发转债	480	52,264.14	0.05

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

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处

罚的情况。

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	36,544.69
2	应收清算款	1,043,576.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,672.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,101,793.87

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127064	杭氧转债	53,541.30	0.06
2	110089	兴发转债	52,264.14	0.05
3	113652	伟 22 转债	48,060.36	0.05
4	123158	宙邦转债	29,849.05	0.03
5	113633	科沃转债	18,841.68	0.02
6	118008	海优转债	11,283.70	0.01
7	110091	合力转债	10,920.54	0.01

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 500 基本面增强指数 A	2,125	40,306.98	0.00	0.00	85,652,327.14	100.00
汇添富中证 500 基本面增强指数 C	2,475	10,133.21	0.00	0.00	25,079,689.98	100.00
合计	4,600	24,072.18	0.00	0.00	110,732,017.12	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	658,718.90	0.77
	汇添富中证 500 基本面增强指数 C	9.72	0.00
	合计	658,728.62	0.59

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 500 基本面增强指数 A	0
	汇添富中证 500 基本面增强指数 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	50~100
	汇添富中证 500 基本面增强指数 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 基本面增强指数 A	汇添富中证 500 基本面增强指数 C
基金合同生效日 (2021 年 09 月 16 日) 基金份额总额	166,454,950.83	123,271,276.27
本报告期期初基金份额总额	90,376,864.58	26,259,751.40
本报告期基金总申购份额	3,335,197.94	5,125,261.56
减：本报告期基金总赎回份额	8,059,735.38	6,305,322.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	85,652,327.14	25,079,689.98

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，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形。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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 (%)	
西部证券	2	163,047,117.73	13.94	117,604.08	13.94	
中信建投证券	4	148,401,318.97	12.69	107,040.43	12.69	
东吴证券	3	137,379,251.75	11.75	99,089.88	11.75	
方正证券	2	105,662,114.56	9.04	76,213.65	9.04	
东方	2	105,430,600.24	9.02	76,046.65	9.02	

证券						
中泰证券	2	88,205,609.08	7.54	63,619.93	7.54	
国金证券	2	81,076,371.59	6.93	58,481.90	6.93	
太平洋证券	1	62,275,275.37	5.33	44,919.10	5.33	
西南证券	1	53,798,837.29	4.60	38,804.80	4.60	
海通证券	4	46,592,058.56	3.98	33,607.82	3.98	
浙商证券	1	45,745,485.35	3.91	32,996.31	3.91	
上海证券	2	42,982,126.76	3.68	31,002.94	3.68	
申万宏源证券	3	41,853,443.57	3.58	30,189.59	3.58	
华兴证券	2	21,079,432.36	1.80	15,205.38	1.80	
华泰证券	2	19,171,316.28	1.64	13,827.72	1.64	
野村东方国际	2	6,575,973.54	0.56	4,742.82	0.56	
安信证券	2	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
川财证券	2	-	-	-	-	
东北证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
开源证券	2	-	-	-	-	
天风证券	2	-	-	-	-	
粤开证券	1	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	

中信 证券	3	-	-	-	-	
----------	---	---	---	---	---	--

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 (%)
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	460,421.31	54.90	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	199,370.00	23.77	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	178,878.05	21.33	-	-	-	-	-	-
申万	-	-	-	-	-	-	-	-

宏源 证券								
华兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村 东方 国际	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 3 家证券公司的 5 个交易单元：开源证券（深交所单元，上交所单元）、长江证券（深交所单元，上交所单元）、广发证券（深交所单元）；不再租用 1 家证券公司的 1 个交易单元：太平洋证券（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	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
2	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日

§ 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 500 基本面增强指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 基本面增强指数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 500 基本面增强指数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 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日