

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 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	5
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
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	21
§ 5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
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	21
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	21
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	21
6.1 资产负债表	21
6.2 利润表	23
6.3 净资产变动表	24
6.4 报表附注	26
§ 7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	87
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	88
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	88
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	88
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	88
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	89
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	89

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	89
7.12 投资组合报告附注	89
§ 8 基金份额持有人信息	90
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	90
8.2 期末上市基金前十名持有人	90
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	91
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	92
§ 9 开放式基金份额变动	92
§ 10 重大事件揭示	92
10.1 基金份额持有人大会决议	92
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.....	92
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	92
10.4 基金投资策略的改变	93
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	93
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.....	93
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	93
10.8 其他重大事件	96
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	97
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.....	97
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	98
§ 12 备查文件目录	98
12.1 备查文件目录	98
12.2 存放地点	98
12.3 查阅方式	98

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 08 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	4,699,437,198.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 16 日

注：扩位证券简称：800ETF。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露	姓名	李鹏	潘琦

负责人	联系电话	021-28932888	0755-22168257
	电子邮箱	service@99fund.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95511-3
传真		021-28932998	0755-82080387
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		200010	518001
法定代表人		鲁伟铭	谢永林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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(2025 年 01 月 01 日 – 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	106,514,441.16
本期利润	84,702,160.90
加权平均基金份额本期利润	0.0168
本期加权平均净值利润率	1.67%
本期基金份额净值增长率	1.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	157,838,221.77
期末可供分配基金份额利润	0.0336
期末基金资产净值	4,857,275,419.77

期末基金份额净值	1.0336
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	15.66%

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

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	3.69%	0.61%	2.96%	0.62%	0.73%	-0.01%
过去三个月	2.22%	1.18%	1.18%	1.18%	1.04%	0.00%
过去六个月	1.98%	1.09%	0.87%	1.09%	1.11%	0.00%
过去一年	18.17%	1.44%	15.20%	1.45%	2.97%	-0.01%
过去三年	-4.66%	1.13%	-11.35%	1.13%	6.69%	0.00%
自基金合同生效起至今	15.66%	1.19%	6.82%	1.20%	8.84%	-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

添富中证800ETF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（2019年10月08日）起6个月，建仓期结束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。

2025 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 363 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穹	本基金的基金经理	2019 年 10 月 08 日	—	11	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2024 年 4 月 19 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10

					月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至 2025 年 5 月 16 日任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2024 年 9 月 29 日任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021
--	--	--	--	--	--

					年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 7 月 29 日至 2024
--	--	--	--	--	--

					年 2 月 7 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至 2024 年 7 月 5 日任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2023 年 6 月 19 日至 2024 年 7 月 9 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接
--	--	--	--	--	---

					基金的基金经 理。2023 年 8 月 23 日至 2025 年 5 月 9 日任汇 添富中证智能汽 车主题交易型开 放式指数证券投 资基金的基金经 理。2023 年 12 月 28 日至今任 汇添富国证港股 通创新药交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024 年 2 月 5 日至今任汇 添富 MSCI 美国 50 交易型开放式 指数证券投资基金（QDII）的基 金经理。2024 年 3 月 1 日至今 任汇添富恒生生 物科技交易型开 放式指数证券投 资基金发起式联 接基金（QDII） 的基金经理。 2024 年 4 月 1 日 至 2025 年 5 月 9 日任汇添富中 证信息技术应用 创新产业交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2024 年 4 月 19 日至今任 汇添富国证港股 通创新药交易型 开放式指数证券 投资基金发起式 联接基金的基金 经理。2024 年 10 月 28 日至今
--	--	--	--	--	--

					任汇添富中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月 18 日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
过蓓蓓	本基金的基金经理, 指数与量化投资部 副总监	2019 年 10 月 08 日	-	14	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 13 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 6 日任中证能源交易型开

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

					券投资基金 (LOF) 的基金 经理。2018 年 10 月 23 日至 2023 年 5 月 22 日任中证银行交 易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2019 年 3 月 26 日至 今任汇添富中证 医药卫生交易型 开放式指数证券 投资基金联接基 金的基金经理。 2019 年 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证 银行交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金的 基金经理。2019 年 10 月 8 日至 今任中证 800 交 易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2021 年 2 月 1 日至今 任汇添富国证生 物医药交易型开 放式指数证券投资 基金的基金经理。 2021 年 6 月 3 日至今任汇 添富中证新能源 汽车产业交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2021 年 9 月 29 日至 2023 年 5 月 18 日任 汇添富中证 800 交易型开放式指 数证券投资基金
--	--	--	--	--	--

					联接基金的基金 经理。2022 年 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日任 汇添富国证生物 医药交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金的 基金经理。2022 年 8 月 15 日至 今任汇添富纳斯 达克生物科技交 易型开放式指数 证券投资基金 （QDII）的基金 经理。2022 年 9 月 26 日至今任 汇添富中证中药 交易型开放式指 数证券投资基金 的基金经理。 2022 年 10 月 20 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富 中证 100 交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2022 年 12 月 2 日至今任 汇添富中证中药 交易型开放式指 数证券投资基金 联接基金 （LOF）的基金 经理。2023 年 3 月 14 日至今任 汇添富纳斯达克 生物科技交易型 开放式指数证券 投资基金发起式 联接基金 （QDII）的基金 经理。2023 年 3 月 30 日至今任
--	--	--	--	--	---

					汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 8 月 2 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）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，力争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 4 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

2025 年上半年的两个季度，A 股市场均是短期大幅下挫之后逐步修复的态势，而港股市场则是一季度显著强于 A 股、二季度与 A 股形态趋同的走势。细分板块方面，科技、创新药等板块是阶段性焦点。

一季度主要关注两会。2025 年经济增速目标依然维持在 5% 左右，但 CPI 目标较上年下调至 2%、财政赤字率目标上调至 4%。一方面会议直面内外部困难，在全球外部环境越发复杂的背景下，科技发展、消费需求、出口贸易等多个领域或将面临压力；另一方面，财政赤字率目标的上调，也有加大逆周期调节力度的意味。

二季度起外部冲击加剧，主要包括关税政策和地缘冲突。4 月初，美国宣布将对贸易伙伴征收对等关税。政策公布之后，多国陆续表态。我国对美国此次关税政策进行了有力回击，调升美国进口商品关税，并加强了稀土的出口管制。资本市场对此次关税反应较为剧烈，全球权益市场普遍下挫。5 月，经过反复拉扯，中美开展经贸会谈并取得一定进展，双方均大幅下调关税，争端得到有效缓和。至 6 月，美国与其他国家或地区的贸易谈判正陆续推进。市场风险偏好逐渐修复。6 月，贸易争端逐渐缓和，但中东地缘冲突引发新一轮冲击。

美国关税政策先大幅冲击市场，后逐渐缓和，但未来不确定性依然存在。尽管我国对美进出口依赖相对有限，依然有必要防范政策进一步发生变化的可能性。

宏观经济方面，二季度整体稳中向好。5 月社零同比增长 6.4%，表现超预期，工业生产增速相对稳健；投资略有下滑。经济温和修复的背景下，上市公司基本面预期表现稳健，A 股主要宽基估值适中。港股头部公司基本面修复预期更强，且整体估值水平更低，性价比较高。

中证 800 指数是 A 股市场代表性宽基指数，覆盖 A 股数千只个股中市值较大、流动性较好的前 800 只股票，风格均衡，是 A 股市场核心资产的代表。而 800ETF 及其联接基金则是这一代表性指数的产品化形式，为投资者提供了整体配置国内权益资产的优质工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 1.98%。同期业绩比较基准收益率为 0.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年整体外部环境出现了多方挑战，美国关税政策对全球的影响存在反复的可能，另有地缘冲突等事件的影响。国内来看，2025 年上半年宏观经济温和修复，预计下半年有望保持韧性。CPI 数据上半年稳步增长，社零数据明显走强，体现出内需修复的韧性。生产端的 PPI 数据则体现出一定压力。但在下半年“反内卷”等政策的推动下，相关价格条件或能有所改善。7 月即将召开的政治局会议有望对下半年经济提供增量政策支持，值得关注。

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：本基金的收益分配采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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

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

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	75,385,247.34	32,338,603.37
结算备付金		54,226,414.10	54,036,579.69
存出保证金		15,578,788.01	16,327,350.18
交易性金融资产	6.4.7.2	4,718,053,417.66	6,093,957,932.04
其中：股票投资		4,718,053,417.66	6,093,957,932.04
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	-	-2,756.16
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		-	40,413,750.91
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,863,243,867.11	6,237,071,460.03
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 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		4,974,962.30	3,843,547.52
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		572,315.20	796,910.28
应付托管费		190,771.72	265,636.78
应付销售服务费		-	-
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	230,398.12	1,053,566.52
负债合计		5,968,447.34	5,959,661.10
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	4,699,437,198.00	6,148,187,198.00
未分配利润	6.4.7.9	157,838,221.77	82,924,600.93
净资产合计		4,857,275,419.77	6,231,111,798.93
负债和净资产总计		4,863,243,867.11	6,237,071,460.03

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0336 元，基金份额总额 4,699,437,198.00 份。

6.2 利润表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		90,201,451.33	3,759,262.00
1. 利息收入		536,953.24	2,188,671.18
其中：存款利息收入	6.4.7.10	464,393.83	431,480.56
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		72,559.41	19,546.04
其他利息收入		-	1,737,644.58
2. 投资收益（损失以“-”填列）		108,984,746.80	-123,401,171.43
其中：股票投资收益	6.4.7.11	51,388,879.56	-207,296,201.94
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	115,882.50	80,660.03
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	-1,045,124.50	5,359,966.44
股利收益	6.4.7.17	58,525,109.24	78,454,404.04
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	-21,812,280.26	123,247,102.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填 列）	6.4.7.19	2,492,031.55	1,724,659.47
减：二、营业总支出		5,499,290.43	8,046,220.91

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,770,358.73	5,152,996.78
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,256,786.20	1,717,665.61
3. 销售服务费		-	-
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		8,405.68	39,975.20
8. 其他费用	6.4.7.21	463,739.82	1,135,583.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		84,702,160.90	-4,286,958.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		84,702,160.90	-4,286,958.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		84,702,160.90	-4,286,958.91

6.3 净资产变动表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	6,148,187,198.00	82,924,600.93	6,231,111,798.93
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	6,148,187,198.00	82,924,600.93	6,231,111,798.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,448,750,000.00	74,913,620.84	-1,373,836,379.16
（一）、综合收益总额	-	84,702,160.90	84,702,160.90
（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）	-1,448,750,000.00	-9,788,540.06	-1,458,538,540.06

其中：1. 基金申购款	598,500,000.00	5,806,041.98	604,306,041.98
2. 基金赎回款	-2,047,250,000.00	-15,594,582.04	-2,062,844,582.04
（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	4,699,437,198.00	157,838,221.77	4,857,275,419.77
项目	上年度可比期间 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	8,166,937,198.00	-975,820,862.70	7,191,116,335.30
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	8,166,937,198.00	-975,820,862.70	7,191,116,335.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-726,750,000.00	43,381,292.31	-683,368,707.69
（一）、综合收益总额	-	-4,286,958.91	-4,286,958.91
（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）	-726,750,000.00	47,668,251.22	-679,081,748.78
其中：1. 基金申购款	1,966,500,000.00	-248,668,606.94	1,717,831,393.06
2. 基金赎回款	-2,693,250,000.00	296,336,858.16	-2,396,913,141.84
（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	7,440,187,198.00	-932,439,570.39	6,507,747,627.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]162 号文《关于准予中证 800 交易型开放式指数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。经向中国证监会备案，基金合同于 2019 年 10 月 8 日生效。首次设立基金募集规模为 6,601,437,198.00 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（2019）验字第 60466941_A04 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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、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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 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。

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征增值税试点的通知》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[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[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 2025 年 06 月 30 日
活期存款	75,385,247.34
等于：本金	75,378,539.65
加：应计利息	6,707.69
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	75,385,247.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,506,501,968.31	-	4,718,053,417.66	211,551,449.35
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		4,506,501,968.31	-	4,718,053,417.66	211,551,449.35

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	122,710,080.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	122,710,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	122,710,080.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	28	32,857,440.00	1,190,040.00
IF2507	IF2507	20	23,446,800.00	534,960.00
IF2509	IF2509	60	69,966,000.00	1,835,160.00
合计				3,560,160.00
减：可抵销期货暂收款				3,560,160.00
净额				-

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

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 2025 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	131,219.17
其中：交易所市场	131,219.17
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	59,507.37
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	-
申购款利息	-

应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	230,398.12

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,148,187,198.00	6,148,187,198.00
本期申购	598,500,000.00	598,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,047,250,000.00	-2,047,250,000.00
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	4,699,437,198.00	4,699,437,198.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,247,104,871.66	-1,164,180,270.73	82,924,600.93
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	1,247,104,871.66	-1,164,180,270.73	82,924,600.93
本期利润	106,514,441.16	-21,812,280.26	84,702,160.90
本期基金份额交易产生的变动数	-300,915,923.47	291,127,383.41	-9,788,540.06
其中：基金申购款	127,241,186.88	-121,435,144.90	5,806,041.98
基金赎回款	-428,157,110.35	412,562,528.31	-15,594,582.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,052,703,389.35	-894,865,167.58	157,838,221.77

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	114,779.03
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	347,924.38
其他	1,690.42
合计	464,393.83

注：“其他”包含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 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,799,235.28
股票投资收益——赎回差价收入	39,589,644.28
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	51,388,879.56

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,175,990,097.95
减：卖出股票成本总额	1,163,189,154.32
减：交易费用	1,001,708.35
买卖股票差价收入	11,799,235.28

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	2,062,844,582.04
减：现金支付赎回款总额	840,909,671.04
减：赎回股票成本总额	1,182,345,266.72
减：交易费用	-
赎回差价收入	39,589,644.28

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	87.25
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	115,795.25
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	115,882.50

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,000,825.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	884,900.00
减：应计利息总额	90.04
减：交易费用	40.04
买卖债券差价收入	115,795.25

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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-1,045,124.50
外汇远期投资收益	-
国债期货投资收益	-
外汇期货投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	58,525,109.24
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	58,525,109.24

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-26,226,700.26
——股票投资	-26,226,700.26
——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	4,414,420.00
——权证投资	-
——期货投资	4,414,420.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-21,812,280.26

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,492,031.55
其他	-
合计	2,492,031.55

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	364,114.94
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
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	445.93
合计	463,739.82

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
平安银行股份有限公司 (“平安银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东
汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	542, 481, 366. 37	30. 66	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
东方证券	217, 000, 000. 00	81. 27	-	-

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	95,445.48	30.67	74,902.21	57.08
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)
	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。截至 2024 年 6 月 30 日止，该类佣金协议的服务范围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等。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,770,358.73	5,152,996.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	374,694.50	37,484.62
应支付基金管理人的净管理费	3,395,664.23	5,115,512.16

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,256,786.20	1,717,665.61

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.05\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

单位：人民币元

本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	6,773,697.00	0.81~3.42	1.91	5,245.06	-	-

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	8,200,104.00	0.17	4,190,103.00	0.07
汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	51,626,700.00	1.10	82,195,700.00	1.34

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	75,385,247.34	114,779.03	27,196,594.20	133,638.02

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 889,344.00 股，占本基金净值比例为 0.18%。持有基金托管人平安银行发行的股票 1,647,167.00 股，占本基金净值比例为 0.41%。（于上期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 1,414,044.00 股，占本基金净值比例为 0.17%。持有基金托管人平安银行发行的股票 2,629,567.00 股，占本基金净值比例为 0.41%。）

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（2025 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023 年 08 月 30 日	重大事项停	0.01		-	371,600	952,476.03	3,716.00	

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

注:截止 2025 年 6 月 30 日,本基金合计持有中天 3 (在深圳证券交易所退市时的股票简称为*ST 中天,证券代码为 000540) 371,600 股。根据中天金融集团股份有限公司 (以下简称“公司”) 于 2023 年 6 月 29 日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市暨摘牌的公告》,深圳证券交易所宣布,自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起,该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。

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

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

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 2025 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 2025 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 2025 年 06 月 30 日止,本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	75,385,247.34	-	-	-	-	-	75,385,247.34
结算备付金	54,226,414.10	-	-	-	-	-	54,226,414.10
存出保证金	426,359.21	-	-	-	-	15,152,428.80	15,578,788.01
交易性金融融资	-	-	-	-	-	4,718,053,417.66	4,718,053,417.66

产							
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	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	130,038,020.65	-	-	-	-	4,733,205,846.46	4,863,243,867.11
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	-	-	-	-	-	4,974,962.30	4,974,962.30

应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	572,315.20	572,315.20
应付托管费	-	-	-	-	-	190,771.72	190,771.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	230,398.12	230,398.12
负债总计	-	-	-	-	-	5,968,447.34	5,968,447.34
利率敏感度缺口	130,038,020.65	-	-	-	-	4,727,237,399.12	4,857,275,419.77
上年度末2024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	32,338,603.37	-	-	-	-	-	32,338,603.37
结算	54,036,579.69	-	-	-	-	-	54,036,579.69

备付金							
存出保证金	1,140,034.98	-	-	-	-	15,187,315.20	16,327,350.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	6,093,957,932.04	6,093,957,932.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-2,756.16	-	-	-	-	-	-2,756.16
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	40,413,750.91	40,413,750.91
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	87,512,461.88	-	-	-	-	6,149,558,998.15	6,237,071,460.03
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-

卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 清算 款	-	-	-	-	-	3,843,547.52	3,843,547.52
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	796,910.28	796,910.28
应付 托管 费	-	-	-	-	-	265,636.78	265,636.78
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	1,053,566.52	1,053,566.52
负债 总计	-	-	-	-	-	5,959,661.10	5,959,661.10
利率 敏感 度缺 口	87,512,461.88	-	-	-	-	6,143,599,337.05	6,231,111,798.93

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

行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末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 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 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	4,718,053,417.66	97.13	6,093,957,932.04	97.80
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	4,718,053,417.66	97.13	6,093,957,932.04	97.80

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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证 800 指数 上涨 5%	242,450,863.09	309,655,005.34
	中证 800 指数 下跌 5%	-242,450,863.09	-309,655,005.34

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 2025 年 06 月 30 日
第一层次	4,718,049,701.66
第二层次	-
第三层次	3,716.00
合计	4,718,053,417.66

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 管理人报告-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	4,718,053,417.66	97.01
	其中：股票	4,718,053,417.66	97.01
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	129,611,661.44	2.67
8	其他各项资产	15,578,788.01	0.32
9	合计	4,863,243,867.11	100.00

注：此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”章节的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

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	38,029,433.78	0.78
B	采矿业	221,601,304.42	4.56
C	制造业	2,506,077,883.03	51.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	167,418,088.82	3.45
E	建筑业	77,451,440.95	1.59
F	批发和零售业	35,866,447.71	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	145,282,565.84	2.99
H	住宿和餐饮业	3,328,809.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	275,552,011.65	5.67
J	金融业	1,074,120,842.25	22.11
K	房地产业	41,433,985.92	0.85
L	租赁和商务服务业	43,020,776.34	0.89
M	科学研究和技术服务业	45,528,366.55	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	5,211,979.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,550,816.00	0.05
Q	卫生和社会工作	15,639,945.40	0.32
R	文化、体育和娱乐业	16,949,123.00	0.35
S	综合	2,987,747.00	0.06
	合计	4,718,051,566.66	97.13

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-

K	房地产业	3,716.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,716.00	0.00

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	106,515	150,135,022.80	3.09
2	300750	宁德时代	449,540	113,382,978.80	2.33
3	601318	中国平安	1,828,356	101,437,190.88	2.09
4	600036	招商银行	2,102,800	96,623,660.00	1.99
5	601166	兴业银行	2,822,800	65,884,152.00	1.36
6	600900	长江电力	2,076,540	62,586,915.60	1.29
7	000333	美的集团	836,061	60,363,604.20	1.24
8	601899	紫金矿业	2,797,500	54,551,250.00	1.12
9	002594	比亚迪	154,640	51,326,562.40	1.06
10	300059	东方财富	2,147,728	49,676,948.64	1.02

		富			
11	600030	中信证 券	1,657,650	45,784,293.00	0.94
12	601398	工商银 行	5,953,200	45,184,788.00	0.93
13	600276	恒瑞医 药	758,442	39,363,139.80	0.81
14	000858	五 粮 液	328,929	39,109,658.10	0.81
15	601211	国泰海 通	1,919,248	36,772,791.68	0.76
16	601328	交通银 行	4,521,400	36,171,200.00	0.74
17	000651	格力电 器	761,740	34,217,360.80	0.70
18	601288	农业银 行	5,424,300	31,894,884.00	0.66
19	600887	伊利股 份	1,074,200	29,948,696.00	0.62
20	002475	立讯精 密	861,584	29,888,348.96	0.62
21	600919	江苏银 行	2,494,250	29,781,345.00	0.61
22	688981	中芯国 际	336,673	29,684,458.41	0.61
23	603259	药明康 德	423,981	29,487,878.55	0.61
24	601816	京沪高 铁	4,988,600	28,684,450.00	0.59
25	600000	浦发银 行	1,992,538	27,656,427.44	0.57
26	000725	京东方 A	6,237,900	24,889,221.00	0.51
27	002371	北方华 创	55,308	24,457,750.68	0.50
28	300760	迈瑞医 疗	102,900	23,126,775.00	0.48
29	601088	中国神 华	560,840	22,736,453.60	0.47
30	688041	海光信 息	158,657	22,416,647.53	0.46
31	300308	中际旭 创	151,800	22,141,548.00	0.46

32	601601	中国太保	581,400	21,808,314.00	0.45
33	300502	新易盛	168,900	21,453,678.00	0.44
34	688256	寒武纪科技	34,704	20,874,456.00	0.43
35	300124	汇川技术	319,950	20,659,171.50	0.43
36	601728	中国电信	2,638,711	20,450,010.25	0.42
37	601668	中国建筑	3,510,700	20,256,739.00	0.42
38	600016	民生银行	4,216,000	20,026,000.00	0.41
39	002352	顺丰控股	408,444	19,915,729.44	0.41
40	000001	平安银行	1,647,167	19,881,305.69	0.41
41	002714	牧原股份	464,458	19,511,880.58	0.40
42	002230	科大讯飞	392,900	18,812,052.00	0.39
43	601127	赛力斯	137,800	18,509,296.00	0.38
44	603501	豪威集团	143,642	18,335,901.30	0.38
45	600031	三一重工	1,005,500	18,048,725.00	0.37
46	601229	上海银行	1,686,600	17,894,826.00	0.37
47	000063	中兴通讯	548,150	17,809,393.50	0.37
48	603019	中科曙光	249,320	17,552,128.00	0.36
49	600941	中国移动	154,300	17,366,465.00	0.36
50	002415	海康威视	625,900	17,356,207.00	0.36
51	600309	万华化学	318,900	17,303,514.00	0.36
52	601169	北京银行	2,512,000	17,156,960.00	0.35
53	300274	阳光电源	246,880	16,731,057.60	0.34
54	601857	中国石	1,926,600	16,472,430.00	0.34

		油			
55	601919	中远海控	1,071,860	16,120,774.40	0.33
56	688008	澜起科技	194,674	15,963,268.00	0.33
57	600690	海尔智家	637,600	15,799,728.00	0.33
58	600660	福耀玻璃	272,610	15,541,496.10	0.32
59	601012	隆基绿能	1,031,232	15,489,104.64	0.32
60	601688	华泰证券	868,000	15,459,080.00	0.32
61	300498	温氏股份	903,440	15,430,755.20	0.32
62	002142	宁波银行	561,170	15,353,611.20	0.32
63	600406	国电南瑞	681,574	15,274,073.34	0.31
64	600809	山西汾酒	82,960	14,633,314.40	0.30
65	601766	中国中车	2,066,800	14,550,272.00	0.30
66	601138	工业富联	674,400	14,418,672.00	0.30
67	603986	兆易创新	112,468	14,230,576.04	0.29
68	600050	中国联通	2,652,700	14,165,418.00	0.29
69	000338	潍柴动力	920,400	14,155,752.00	0.29
70	000568	泸州老窖	124,402	14,107,186.80	0.29
71	600028	中国石化	2,478,100	13,976,484.00	0.29
72	000100	TCL 科技	3,191,890	13,820,883.70	0.28
73	300476	胜宏科技	102,400	13,760,512.00	0.28
74	601988	中国银行	2,429,400	13,653,228.00	0.28
75	601006	大秦铁路	2,053,404	13,552,466.40	0.28

76	688012	中微半 导体设 备	72,876	13,285,294.80	0.27
77	600926	杭州银 行	778,560	13,095,379.20	0.27
78	601818	光大银 行	3,146,800	13,059,220.00	0.27
79	601985	中国核 电	1,398,600	13,034,952.00	0.27
80	601225	陕西煤 业	659,100	12,681,084.00	0.26
81	600104	上汽集 团	786,200	12,618,510.00	0.26
82	002027	分众传 媒	1,716,300	12,528,990.00	0.26
83	600150	中国船 舶	378,968	12,331,618.72	0.25
84	601628	中国人 寿	283,113	11,661,424.47	0.24
85	601009	南京银 行	998,600	11,603,732.00	0.24
86	600999	招商证 券	628,010	11,046,695.90	0.23
87	603288	海天味 业	283,555	11,033,125.05	0.23
88	688271	联影医 疗	86,032	10,989,727.68	0.23
89	600760	中航沈 飞	186,980	10,960,767.60	0.23
90	605499	东鹏饮 料	34,600	10,866,130.00	0.22
91	000425	徐工机 械	1,395,900	10,846,143.00	0.22
92	601939	建设银 行	1,142,600	10,786,144.00	0.22
93	688111	金山办 公	38,475	10,774,923.75	0.22
94	000625	长安汽 车	843,166	10,758,798.16	0.22
95	000792	盐湖股 份	629,200	10,746,736.00	0.22
96	600111	北方稀 土	429,200	10,687,080.00	0.22
97	600938	中国海	406,700	10,618,937.00	0.22

		油			
98	600436	片仔癀	52,300	10,460,523.00	0.22
99	600905	三峡能源	2,423,571	10,324,412.46	0.21
100	601658	邮储银行	1,881,678	10,292,778.66	0.21
101	600089	特变电工	859,251	10,250,864.43	0.21
102	601888	中国中免	166,442	10,147,968.74	0.21
103	603993	洛阳钼业	1,193,100	10,045,902.00	0.21
104	002050	三花智控	379,880	10,021,234.40	0.21
105	600048	保利发展	1,217,000	9,857,700.00	0.20
106	300015	爱尔眼科	789,149	9,848,579.52	0.20
107	600547	山东黄金	307,300	9,812,089.00	0.20
108	600019	宝钢股份	1,488,300	9,807,897.00	0.20
109	601390	中国中铁	1,747,700	9,804,597.00	0.20
110	300033	同花顺	35,700	9,746,457.00	0.20
111	002463	沪电股份	228,200	9,716,756.00	0.20
112	002241	歌尔股份	415,300	9,684,796.00	0.20
113	600415	小商品城	466,200	9,641,016.00	0.20
114	300014	亿纬锂能	208,383	9,546,025.23	0.20
115	601825	沪农商行	979,400	9,500,180.00	0.20
116	601600	中国铝业	1,343,800	9,460,352.00	0.19
117	601989	中国重工	1,929,200	8,951,488.00	0.18
118	000977	浪潮信息	175,300	8,919,264.00	0.18
119	600585	海螺水泥	406,100	8,718,967.00	0.18

120	600893	航发动力	226,195	8,717,555.30	0.18
121	002179	中航光电	215,950	8,715,742.00	0.18
122	601916	浙商银行	2,566,900	8,701,791.00	0.18
123	601838	成都银行	431,684	8,676,848.40	0.18
124	600570	恒生电子	257,610	8,640,239.40	0.18
125	600958	东方证券	889,344	8,608,849.92	0.18
126	600015	华夏银行	1,083,100	8,567,321.00	0.18
127	603799	华友钴业	230,270	8,524,595.40	0.18
128	000538	云南白药	152,760	8,522,480.40	0.18
129	000776	广发证券	500,100	8,406,681.00	0.17
130	601336	新华保险	141,065	8,252,302.50	0.17
131	002311	海大集团	140,600	8,237,754.00	0.17
132	600584	长电科技	243,300	8,196,777.00	0.17
133	000938	紫光股份	337,960	8,107,660.40	0.17
134	000988	华工科技	171,300	8,052,813.00	0.17
135	002028	思源电气	105,500	7,692,005.00	0.16
136	601998	中信银行	901,400	7,661,900.00	0.16
137	000166	申万宏源	1,525,600	7,658,512.00	0.16
138	600438	通威股份	457,200	7,658,100.00	0.16
139	002049	紫光国微	115,180	7,585,754.80	0.16
140	300408	三环集团	226,300	7,558,420.00	0.16
141	300433	蓝思科技	337,800	7,532,940.00	0.16

142	601077	渝农商行	1,051,000	7,504,140.00	0.15
143	000002	万科A	1,159,100	7,441,422.00	0.15
144	600795	国电电力	1,515,800	7,336,472.00	0.15
145	601377	兴业证券	1,170,512	7,245,469.28	0.15
146	600489	中金黄金	493,100	7,214,053.00	0.15
147	601669	中国电建	1,466,100	7,139,907.00	0.15
148	600988	赤峰黄金	282,400	7,026,112.00	0.14
149	601689	拓普集团	148,340	7,009,065.00	0.14
150	601995	中金公司	198,000	7,001,280.00	0.14
151	600010	包钢股份	3,835,100	6,864,829.00	0.14
152	300339	润和软件	134,900	6,856,967.00	0.14
153	002422	科伦药业	190,000	6,824,800.00	0.14
154	600009	上海机场	211,200	6,709,824.00	0.14
155	002966	苏州银行	757,370	6,649,708.60	0.14
156	002304	洋河股份	102,100	6,590,555.00	0.14
157	601100	恒立液压	91,248	6,569,856.00	0.14
158	600160	巨化股份	227,500	6,524,700.00	0.13
159	002460	赣锋锂业	191,380	6,462,902.60	0.13
160	000768	中航西飞	234,100	6,400,294.00	0.13
161	688036	传音控股	79,907	6,368,587.90	0.13
162	300394	天孚通信	79,664	6,360,373.76	0.13
163	601881	中国银河	367,200	6,297,480.00	0.13

164	601186	中国铁建	783,600	6,276,636.00	0.13
165	002252	上海莱士	903,400	6,206,358.00	0.13
166	600183	生益科技	204,820	6,175,323.00	0.13
167	600839	四川长虹	627,900	6,103,188.00	0.13
168	000157	中联重科	843,700	6,099,951.00	0.13
169	601360	三六零	595,800	6,077,160.00	0.13
170	000963	华东医药	149,800	6,045,928.00	0.12
171	600989	宝丰能源	373,600	6,029,904.00	0.12
172	600886	国投电力	406,600	5,993,284.00	0.12
173	002074	国轩高科	183,300	5,949,918.00	0.12
174	601555	东吴证券	677,702	5,929,892.50	0.12
175	601788	光大证券	329,700	5,928,006.00	0.12
176	689009	九号公司	99,093	5,863,332.81	0.12
177	600115	中国东航	1,452,100	5,851,963.00	0.12
178	601058	赛轮轮胎	446,000	5,851,520.00	0.12
179	300442	润泽科技	116,800	5,785,104.00	0.12
180	601162	天风证券	1,165,560	5,746,210.80	0.12
181	000408	藏格矿业	132,400	5,649,508.00	0.12
182	000807	云铝股份	353,500	5,648,930.00	0.12
183	688521	芯原微电子	58,473	5,642,644.50	0.12
184	002466	天齐锂业	176,100	5,642,244.00	0.12
185	002736	国信证券	489,200	5,635,584.00	0.12

186	000661	长春高新	56,347	5,588,495.46	0.12
187	600066	宇通客车	224,059	5,570,106.74	0.11
188	002001	新和成	261,668	5,565,678.36	0.11
189	002517	恺英网络	288,200	5,565,142.00	0.11
190	002340	格林美	869,300	5,520,055.00	0.11
191	601901	方正证券	697,100	5,514,061.00	0.11
192	600426	华鲁恒升	253,760	5,498,979.20	0.11
193	600196	复星医药	216,300	5,426,967.00	0.11
194	002195	岩山科技	962,200	5,417,186.00	0.11
195	600029	南方航空	918,100	5,416,790.00	0.11
196	688169	石头科技	34,499	5,400,818.45	0.11
197	002558	巨人网络	229,000	5,392,950.00	0.11
198	300661	圣邦股份	74,043	5,388,109.11	0.11
199	601800	中国交建	604,300	5,372,227.00	0.11
200	001979	招商蛇口	611,900	5,366,363.00	0.11
201	600011	华能国际	747,800	5,339,292.00	0.11
202	000975	山金国际	281,800	5,337,292.00	0.11
203	002236	大华股份	335,100	5,321,388.00	0.11
204	301236	软通动力	97,100	5,305,544.00	0.11
205	002261	拓维信息	170,500	5,276,975.00	0.11
206	603893	瑞芯微	34,700	5,269,542.00	0.11
207	600674	川投能源	328,319	5,266,236.76	0.11
208	002156	通富微	205,500	5,264,910.00	0.11

		电			
209	601066	中信建投	218,800	5,262,140.00	0.11
210	688126	上海硅产业集团	279,211	5,226,829.92	0.11
211	600346	恒力石化	359,600	5,127,896.00	0.11
212	601878	浙商证券	466,100	5,085,151.00	0.10
213	600487	亨通光电	332,200	5,082,660.00	0.10
214	300251	光线传媒	250,500	5,077,635.00	0.10
215	002797	第一创业	713,100	5,048,748.00	0.10
216	300418	昆仑万维	150,100	5,047,863.00	0.10
217	300207	欣旺达	250,100	5,017,006.00	0.10
218	600157	永泰能源	3,743,400	5,016,156.00	0.10
219	601111	中国国航	635,400	5,013,306.00	0.10
220	002916	深南电路	46,340	4,995,915.40	0.10
221	300803	指南针	61,525	4,962,606.50	0.10
222	002648	卫星化学	284,940	4,938,010.20	0.10
223	600460	士兰微	198,600	4,929,252.00	0.10
224	688777	中控技术	109,682	4,925,818.62	0.10
225	601868	中国能建	2,206,765	4,921,085.95	0.10
226	600372	中航机载	407,937	4,919,720.22	0.10
227	002920	德赛西威	48,100	4,912,453.00	0.10
228	603369	今世缘	126,157	4,911,292.01	0.10
229	000066	中国长城	328,300	4,858,840.00	0.10
230	003816	中国广核	1,328,500	4,835,740.00	0.10
231	688608	恒玄科	13,876	4,828,570.48	0.10

		技			
232	688213	思特威 电子科 技	46,889	4,792,993.58	0.10
233	601117	中国化 学	621,600	4,767,672.00	0.10
234	600096	云天化	215,800	4,741,126.00	0.10
235	300347	泰格医 药	88,400	4,713,488.00	0.10
236	600879	航天电 子	449,800	4,709,406.00	0.10
237	600741	华域汽 车	266,800	4,709,020.00	0.10
238	601319	中国人 保	540,378	4,706,692.38	0.10
239	002465	海格通 信	337,100	4,699,174.00	0.10
240	600536	中国软 件	100,325	4,692,200.25	0.10
241	601168	西部矿 业	281,800	4,686,334.00	0.10
242	002273	水晶光 电	234,300	4,678,971.00	0.10
243	600588	用友网 络	349,107	4,667,560.59	0.10
244	688120	华海清 科	27,562	4,649,709.40	0.10
245	600176	中国巨 石	407,623	4,646,902.20	0.10
246	601021	春秋航 空	83,100	4,624,515.00	0.10
247	300450	先导智 能	185,700	4,614,645.00	0.10
248	002601	龙佰集 团	282,600	4,580,946.00	0.09
249	000786	北新建 材	172,700	4,573,096.00	0.09
250	300782	卓胜微	63,920	4,561,970.40	0.09
251	000831	中国稀 土	125,900	4,547,508.00	0.09
252	601633	长城汽 车	211,362	4,540,055.76	0.09
253	601099	太平洋	1,152,800	4,530,504.00	0.09

254	600219	南山铝业	1,178,700	4,514,421.00	0.09
255	600352	浙江龙盛	442,700	4,497,832.00	0.09
256	002294	信立泰	95,000	4,496,350.00	0.09
257	302132	中航成飞	51,100	4,493,734.00	0.09
258	000933	神火股份	267,800	4,456,192.00	0.09
259	301269	华大九天	35,900	4,447,292.00	0.09
260	688235	百济神州	18,996	4,438,225.44	0.09
261	300017	网宿科技	413,500	4,432,720.00	0.09
262	600482	中国动力	191,500	4,417,905.00	0.09
263	600885	宏发股份	197,808	4,413,096.48	0.09
264	300896	爱美客	25,200	4,405,212.00	0.09
265	600039	四川路桥	441,940	4,375,206.00	0.09
266	002185	华天科技	431,700	4,360,170.00	0.09
267	601108	财通证券	550,580	4,355,087.80	0.09
268	000630	铜陵有色	1,302,200	4,349,348.00	0.09
269	688396	华润微电子	92,078	4,342,398.48	0.09
270	000895	双汇发展	176,202	4,301,090.82	0.09
271	002493	荣盛石化	517,850	4,287,798.00	0.09
272	603296	华勤技术	52,800	4,259,904.00	0.09
273	688002	睿创微纳	60,875	4,244,205.00	0.09
274	002129	TCL 中环	552,250	4,241,280.00	0.09
275	600600	青岛啤酒	60,825	4,224,904.50	0.09
276	300454	深信服	44,200	4,162,756.00	0.09

277	001965	招商公路	346,500	4,158,000.00	0.09
278	600085	同仁堂	115,300	4,157,718.00	0.09
279	688617	惠泰医疗	13,966	4,147,902.00	0.09
280	601877	正泰电器	182,751	4,142,965.17	0.09
281	601128	常熟银行	561,795	4,140,429.15	0.09
282	600362	江西铜业	176,700	4,140,081.00	0.09
283	688122	西部超导	79,168	4,107,235.84	0.08
284	002600	领益智造	475,900	4,087,981.00	0.08
285	002130	沃尔核材	171,600	4,087,512.00	0.08
286	002709	天赐材料	225,460	4,085,335.20	0.08
287	002281	光迅科技	82,800	4,083,696.00	0.08
288	600079	人福医药	193,500	4,059,630.00	0.08
289	601577	长沙银行	407,400	4,049,556.00	0.08
290	300223	北京君正	58,400	4,041,280.00	0.08
291	002595	豪迈科技	68,200	4,038,804.00	0.08
292	688469	芯联集成	842,632	4,019,354.64	0.08
293	002085	万丰奥威	252,900	4,018,581.00	0.08
294	000423	东阿阿胶	76,700	4,011,410.00	0.08
295	688099	晶晨半导体	56,145	3,986,856.45	0.08
296	603392	万泰生物	65,278	3,981,958.00	0.08
297	300122	智飞生物	201,800	3,953,262.00	0.08
298	300474	景嘉微	54,100	3,949,300.00	0.08
299	000997	新 大	121,700	3,940,646.00	0.08

		陆			
300	688506	百利天恒药业	13,287	3,934,546.44	0.08
301	300058	蓝色光标	598,260	3,924,585.60	0.08
302	300002	神州泰岳	332,400	3,922,320.00	0.08
303	002532	天山铝业	471,500	3,918,165.00	0.08
304	000783	长江证券	564,600	3,912,678.00	0.08
305	002738	中矿资源	121,540	3,908,726.40	0.08
306	300458	全志科技	97,800	3,881,682.00	0.08
307	002180	纳思达	168,700	3,869,978.00	0.08
308	600109	国金证券	441,100	3,868,447.00	0.08
309	600161	天坛生物	201,246	3,861,910.74	0.08
310	603596	伯特利	72,800	3,835,832.00	0.08
311	603129	春风动力	17,700	3,832,050.00	0.08
312	002472	双环传动	114,100	3,821,209.00	0.08
313	002078	太阳纸业	283,500	3,815,910.00	0.08
314	002436	兴森科技	287,900	3,811,796.00	0.08
315	002138	顺络电子	135,200	3,801,824.00	0.08
316	300832	新产业	67,000	3,800,240.00	0.08
317	002410	广联达	280,830	3,765,930.30	0.08
318	601933	永辉超市	767,400	3,760,260.00	0.08
319	002938	鹏鼎控股	117,200	3,753,916.00	0.08
320	600233	圆通速递	291,000	3,750,990.00	0.08
321	000301	东方盛虹	448,400	3,735,172.00	0.08
322	002851	麦格米特	74,300	3,725,402.00	0.08

323	300765	新诺威	71,900	3,716,511.00	0.08
324	300759	康龙化成	151,300	3,712,902.00	0.08
325	600188	兖矿能源	304,446	3,705,107.82	0.08
326	300136	信维通信	164,900	3,693,760.00	0.08
327	300346	南大光电	116,300	3,679,732.00	0.08
328	600143	金发科技	356,800	3,678,608.00	0.08
329	600580	卧龙电驱	184,920	3,655,868.40	0.08
330	601198	东兴证券	327,200	3,648,280.00	0.08
331	000034	神州数码	96,800	3,643,552.00	0.08
332	002065	东华软件	379,500	3,643,200.00	0.08
333	300024	机器人	211,900	3,640,442.00	0.07
334	300054	鼎龙股份	126,700	3,633,756.00	0.07
335	600862	中航高科	139,200	3,630,336.00	0.07
336	603606	东方电缆	70,200	3,630,042.00	0.07
337	688525	佰维存储	53,854	3,629,759.60	0.07
338	002353	杰瑞股份	103,600	3,626,000.00	0.07
339	601618	中国中冶	1,215,800	3,623,084.00	0.07
340	300395	菲利华	70,900	3,622,990.00	0.07
341	600298	安琪酵母	103,000	3,622,510.00	0.07
342	600363	联创光电	62,100	3,622,293.00	0.07
343	300496	中科创达	63,300	3,622,026.00	0.07
344	002223	鱼跃医疗	101,600	3,616,960.00	0.07
345	002850	科达利	31,900	3,610,123.00	0.07
346	000596	古井贡	27,100	3,608,365.00	0.07

		酒			
347	300857	协创数据	41,900	3,605,914.00	0.07
348	000876	新希望	383,700	3,599,106.00	0.07
349	002673	西部证券	456,404	3,596,463.52	0.07
350	600023	浙能电力	678,500	3,596,050.00	0.07
351	600873	梅花生物	336,300	3,595,047.00	0.07
352	002202	金风科技	349,900	3,586,475.00	0.07
353	688072	拓荆科技	23,096	3,550,086.16	0.07
354	688047	龙芯中科	26,498	3,534,568.22	0.07
355	000999	华润三九	112,943	3,532,857.04	0.07
356	601615	明阳智能	306,400	3,520,536.00	0.07
357	688223	晶科能源	675,563	3,506,171.97	0.07
358	000728	国元证券	442,830	3,493,928.70	0.07
359	600875	东方电气	208,200	3,485,268.00	0.07
360	002008	大族激光	142,800	3,480,036.00	0.07
361	300383	光环新网	243,100	3,476,330.00	0.07
362	600845	宝信软件	147,073	3,473,864.26	0.07
363	002624	完美世界	228,950	3,473,171.50	0.07
364	000021	深科技	184,536	3,458,204.64	0.07
365	688578	艾力斯医药科技	37,154	3,456,808.16	0.07
366	300115	长盈精密	160,800	3,441,120.00	0.07
367	603605	珀莱雅	41,400	3,427,506.00	0.07
368	603659	璞泰来	182,150	3,420,777.00	0.07

369	601872	招商轮船	545,960	3,417,709.60	0.07
370	600515	海南机场	963,333	3,410,198.82	0.07
371	603160	汇顶科技	47,800	3,395,234.00	0.07
372	603087	甘李药业	61,900	3,390,882.00	0.07
373	601898	中煤能源	308,500	3,374,990.00	0.07
374	300604	长川科技	75,100	3,372,741.00	0.07
375	600549	厦门钨业	161,200	3,372,304.00	0.07
376	002459	晶澳科技	335,536	3,348,649.28	0.07
377	600895	张江高科	129,323	3,323,601.10	0.07
378	000426	兴业银锡	210,100	3,319,580.00	0.07
379	002155	湖南黄金	185,760	3,315,816.00	0.07
380	300012	华测检测	283,600	3,315,284.00	0.07
381	000733	振华科技	66,200	3,313,310.00	0.07
382	600171	上海贝岭	96,500	3,305,125.00	0.07
383	605117	德业股份	62,122	3,271,344.52	0.07
384	600061	国投资本	434,096	3,264,401.92	0.07
385	300627	华测导航	93,040	3,256,400.00	0.07
386	688220	翱捷科技	41,444	3,245,065.20	0.07
387	688599	天合光能	221,823	3,223,088.19	0.07
388	688180	君实生物	93,200	3,166,936.00	0.07
389	605589	圣泉集团	113,900	3,160,725.00	0.07
390	600027	华电国际	574,700	3,143,609.00	0.06

391	601216	君正集团	568,600	3,138,672.00	0.06
392	600332	白云山	118,800	3,131,568.00	0.06
393	601665	齐鲁银行	494,500	3,125,240.00	0.06
394	300699	光威复材	98,480	3,118,861.60	0.06
395	300037	新宙邦	88,500	3,115,200.00	0.06
396	688361	中科飞测	36,989	3,114,103.91	0.06
397	000750	国海证券	754,990	3,110,558.80	0.06
398	000617	中油资本	425,900	3,109,070.00	0.06
399	600392	盛和资源	235,800	3,105,486.00	0.06
400	002444	巨星科技	121,400	3,096,914.00	0.06
401	000729	燕京啤酒	239,200	3,092,856.00	0.06
402	601997	贵阳银行	495,238	3,090,285.12	0.06
403	000983	山西焦煤	482,700	3,089,280.00	0.06
404	000932	华菱钢铁	700,400	3,081,760.00	0.06
405	601717	郑煤机	184,100	3,059,742.00	0.06
406	600153	建发股份	294,700	3,056,039.00	0.06
407	000519	中兵红箭	139,600	3,055,844.00	0.06
408	300003	乐普医疗	221,588	3,053,482.64	0.06
409	600918	中泰证券	474,600	3,051,678.00	0.06
410	300073	当升科技	69,500	3,048,965.00	0.06
411	000878	云南铜业	237,600	3,022,272.00	0.06
412	601696	中银证券	282,600	3,020,994.00	0.06
413	600060	海信视像	131,200	3,020,224.00	0.06

414	601990	南京证券	373,500	3,017,880.00	0.06
415	601233	桐昆股份	284,300	3,013,580.00	0.06
416	300999	金龙鱼	101,800	3,006,154.00	0.06
417	300316	晶盛机电	110,200	2,991,930.00	0.06
418	300628	亿联网络	86,000	2,989,360.00	0.06
419	600673	东阳光	256,900	2,987,747.00	0.06
420	300142	沃森生物	271,100	2,982,100.00	0.06
421	600803	新奥股份	157,600	2,978,640.00	0.06
422	603979	金诚信	63,800	2,962,872.00	0.06
423	601799	星宇股份	23,700	2,962,500.00	0.06
424	002414	高德红外	288,211	2,954,162.75	0.06
425	300001	特锐德	123,200	2,953,104.00	0.06
426	600699	均胜电子	168,500	2,938,640.00	0.06
427	002837	英维克	98,520	2,927,029.20	0.06
428	600369	西南证券	672,800	2,926,680.00	0.06
429	600025	华能水电	306,400	2,926,120.00	0.06
430	002821	凯莱英	32,896	2,903,072.00	0.06
431	002007	华兰生物	185,220	2,902,397.40	0.06
432	300373	扬杰科技	55,900	2,901,210.00	0.06
433	601698	中国卫通	141,600	2,898,552.00	0.06
434	603260	合盛硅业	61,100	2,896,140.00	0.06
435	688052	纳芯微电子	16,536	2,885,366.64	0.06
436	600177	雅戈尔	394,800	2,882,040.00	0.06
437	600521	华海药业	153,600	2,861,568.00	0.06
438	600118	中国卫星	99,700	2,848,429.00	0.06

439	000893	亚钾国际	93,700	2,824,118.00	0.06
440	600398	海澜之家	404,900	2,818,104.00	0.06
441	688065	凯赛生物	59,812	2,817,145.20	0.06
442	601238	广汽集团	375,600	2,813,244.00	0.06
443	002152	广电运通	209,300	2,812,992.00	0.06
444	601059	信达证券	164,400	2,811,240.00	0.06
445	600435	北方导航	180,200	2,809,318.00	0.06
446	688249	晶合集成	138,278	2,802,895.06	0.06
447	688027	科大国盾量子	10,188	2,801,801.88	0.06
448	300748	金力永磁	116,660	2,781,174.40	0.06
449	600704	物产中大	526,900	2,776,763.00	0.06
450	600316	洪都航空	73,500	2,770,950.00	0.06
451	000738	航发控制	133,500	2,770,125.00	0.06
452	000623	吉林敖东	163,300	2,767,935.00	0.06
453	603179	新泉股份	58,800	2,761,836.00	0.06
454	600909	华安证券	473,070	2,757,998.10	0.06
455	300413	芒果超媒	125,800	2,744,956.00	0.06
456	002958	青农商行	757,700	2,735,297.00	0.06
457	002044	美年健康	531,700	2,732,938.00	0.06
458	603345	安井食品	33,900	2,726,238.00	0.06
459	600038	中直股份	70,200	2,724,462.00	0.06
460	600497	驰宏锌锗	515,000	2,724,350.00	0.06

461	600765	中航重机	160,260	2,705,188.80	0.06
462	600018	上港集团	473,600	2,704,256.00	0.06
463	000009	中国宝安	303,900	2,698,632.00	0.06
464	002318	久立特材	115,200	2,694,528.00	0.06
465	002409	雅克科技	49,200	2,690,748.00	0.06
466	600562	国睿科技	84,500	2,660,905.00	0.05
467	600141	兴发集团	129,600	2,660,688.00	0.05
468	603228	景旺电子	63,580	2,660,187.20	0.05
469	002683	广东宏大	77,700	2,637,138.00	0.05
470	600155	华创云信	378,200	2,632,272.00	0.05
471	300724	捷佳伟创	48,400	2,628,120.00	0.05
472	000528	柳工	272,600	2,619,686.00	0.05
473	688385	复旦微电	53,061	2,614,315.47	0.05
474	300919	中伟股份	79,500	2,613,960.00	0.05
475	001696	宗申动力	116,200	2,608,690.00	0.05
476	000400	许继电气	119,600	2,603,692.00	0.05
477	000960	锡业股份	169,000	2,585,700.00	0.05
478	002607	中公教育	833,600	2,550,816.00	0.05
479	688188	上海柏楚电子科技	19,299	2,540,906.34	0.05
480	600637	东方明珠	339,330	2,534,795.10	0.05
481	300623	捷捷微电	85,000	2,533,000.00	0.05
482	600884	杉杉股份	266,800	2,523,928.00	0.05

483	601607	上海医药	141,000	2,521,080.00	0.05
484	300558	贝达药业	43,500	2,520,825.00	0.05
485	600498	烽火通信	119,600	2,515,188.00	0.05
486	600529	山东药玻	113,100	2,504,034.00	0.05
487	603939	益丰药房	102,157	2,499,781.79	0.05
488	000039	中集集团	312,900	2,459,394.00	0.05
489	002841	视源股份	71,000	2,456,600.00	0.05
490	002739	万达电影	214,500	2,451,735.00	0.05
491	600486	扬农化工	42,267	2,451,486.00	0.05
492	002025	航天电器	47,339	2,433,697.99	0.05
493	002653	海思科	57,483	2,426,932.26	0.05
494	000415	渤海租赁	726,400	2,418,912.00	0.05
495	600026	中远海能	233,700	2,414,121.00	0.05
496	301358	湖南裕能	77,100	2,404,749.00	0.05
497	300763	锦浪科技	41,700	2,393,163.00	0.05
498	002926	华西证券	266,400	2,381,616.00	0.05
499	600901	江苏金租	390,980	2,369,338.80	0.05
500	688303	大全能源	110,826	2,362,810.32	0.05
501	002385	大北农	581,200	2,348,048.00	0.05
502	300285	国瓷材料	134,700	2,337,045.00	0.05
503	300679	电连技术	51,400	2,332,532.00	0.05
504	603486	科沃斯	40,000	2,329,200.00	0.05
505	000887	中鼎股份	132,300	2,327,157.00	0.05

506	600132	重庆啤酒	42,200	2,325,220.00	0.05
507	688472	阿特斯阳光电力	252,688	2,312,095.20	0.05
508	002939	长城证券	273,100	2,288,578.00	0.05
509	603806	福斯特	176,516	2,287,647.36	0.05
510	300144	宋城演艺	266,620	2,279,601.00	0.05
511	603195	公牛集团	47,205	2,277,641.25	0.05
512	002568	百润股份	88,800	2,274,168.00	0.05
513	600863	内蒙华电	552,800	2,272,008.00	0.05
514	600820	隧道股份	371,800	2,267,980.00	0.05
515	688582	芯动联科	33,617	2,259,062.40	0.05
516	688009	中国通号	438,774	2,255,298.36	0.05
517	600008	首创环保	744,090	2,247,151.80	0.05
518	000723	美锦能源	519,500	2,244,240.00	0.05
519	688114	华大智造	34,528	2,238,450.24	0.05
520	600390	五矿资本	382,800	2,231,724.00	0.05
521	002312	川发龙鳞	194,000	2,227,120.00	0.05
522	600763	通策医疗	53,796	2,220,698.88	0.05
523	000513	丽珠集团	61,600	2,220,064.00	0.05
524	600516	方大炭素	477,420	2,215,228.80	0.05
525	688538	和辉光电	945,138	2,211,622.92	0.05
526	002064	华峰化学	333,700	2,205,757.00	0.05
527	300487	蓝晓科技	43,850	2,205,655.00	0.05

528	300676	华大基因	44,300	2,204,811.00	0.05
529	002080	中材科技	112,700	2,197,650.00	0.05
530	600998	九州通	427,279	2,196,214.06	0.05
531	603568	伟明环保	114,575	2,186,091.00	0.05
532	000703	恒逸石化	371,410	2,183,890.80	0.04
533	603589	口子窖	62,500	2,175,000.00	0.04
534	600166	福田汽车	801,200	2,171,252.00	0.04
535	600170	上海建工	899,300	2,149,327.00	0.04
536	002262	恩华药业	103,400	2,148,652.00	0.04
537	600208	衢州发展	723,200	2,140,672.00	0.04
538	603816	顾家家居	83,800	2,138,576.00	0.04
539	002500	山西证券	366,080	2,137,907.20	0.04
540	601179	中国西电	347,900	2,136,106.00	0.04
541	601699	潞安环能	201,800	2,128,990.00	0.04
542	605358	立昂微	90,800	2,115,640.00	0.04
543	000683	博源化工	440,400	2,109,516.00	0.04
544	600312	平高电气	136,700	2,103,813.00	0.04
545	601155	新城控股	153,500	2,099,880.00	0.04
546	600021	上海电力	238,330	2,094,920.70	0.04
547	002203	海亮股份	201,700	2,081,544.00	0.04
548	603338	浙江鼎力	43,840	2,078,016.00	0.04
549	002432	九安医疗	56,700	2,065,581.00	0.04
550	688728	格科微有限公	134,028	2,064,031.20	0.04

		司			
551	600985	淮北矿业	181,900	2,062,746.00	0.04
552	002244	滨江集团	209,800	2,045,550.00	0.04
553	603379	三美股份	42,400	2,040,288.00	0.04
554	600126	杭钢股份	226,100	2,034,900.00	0.04
555	000591	太阳能	463,400	2,034,326.00	0.04
556	600380	健康元	184,300	2,032,829.00	0.04
557	000708	中信特钢	172,600	2,029,776.00	0.04
558	600583	海油工程	371,600	2,028,936.00	0.04
559	000060	中金岭南	442,500	2,026,650.00	0.04
560	600348	华阳股份	304,200	2,025,972.00	0.04
561	000403	派林生物	111,600	2,023,308.00	0.04
562	601000	唐山港	497,600	2,020,256.00	0.04
563	000921	海信家电	78,600	2,020,020.00	0.04
564	603885	吉祥航空	149,300	2,011,071.00	0.04
565	601236	红塔证券	236,560	2,003,663.20	0.04
566	000629	钒钛股份	779,900	1,996,544.00	0.04
567	600872	中炬高新	104,400	1,983,600.00	0.04
568	000830	鲁西化工	192,400	1,981,720.00	0.04
569	601991	大唐发电	623,700	1,977,129.00	0.04
570	002603	以岭药业	140,000	1,974,000.00	0.04
571	300146	汤臣倍健	174,800	1,964,752.00	0.04
572	002984	森麒麟	104,700	1,963,125.00	0.04
573	600816	建元信托	663,700	1,957,915.00	0.04

574	600535	天士力	124,900	1,954,685.00	0.04
575	002439	启明星辰	121,700	1,945,983.00	0.04
576	601865	福莱特	127,506	1,939,366.26	0.04
577	600095	湘财股份	192,600	1,931,778.00	0.04
578	000062	深圳华强	71,800	1,928,548.00	0.04
579	002056	横店东磁	135,900	1,922,985.00	0.04
580	002423	中粮资本	157,200	1,922,556.00	0.04
581	600499	科达制造	194,900	1,910,020.00	0.04
582	600685	中船防务	70,200	1,908,738.00	0.04
583	603000	人民网	94,200	1,903,782.00	0.04
584	300390	天华新能	99,580	1,898,990.60	0.04
585	600970	中材国际	221,100	1,897,038.00	0.04
586	601016	节能风电	656,050	1,895,984.50	0.04
587	601880	辽港股份	1,263,500	1,895,250.00	0.04
588	603927	中科软	97,344	1,882,632.96	0.04
589	000636	风华高科	136,196	1,871,333.04	0.04
590	601611	中国核建	203,400	1,869,246.00	0.04
591	600511	国药股份	64,100	1,869,156.00	0.04
592	300212	易华录	85,820	1,867,443.20	0.04
593	603737	三棵树	50,532	1,862,104.20	0.04
594	601136	首创证券	93,600	1,860,768.00	0.04
595	601456	国联民生	179,300	1,855,755.00	0.04
596	603298	杭叉集团	88,500	1,854,075.00	0.04
597	000958	电投产融	271,000	1,853,640.00	0.04
598	601666	平煤股	249,900	1,851,759.00	0.04

		份			
599	000563	陕国投 A	517,200	1,846,404.00	0.04
600	300677	英科医疗	77,940	1,845,619.20	0.04
601	603077	和邦生物	1,053,600	1,843,800.00	0.04
602	000155	川能动力	187,100	1,837,322.00	0.04
603	600483	福能股份	189,800	1,829,672.00	0.04
604	600004	白云机场	200,600	1,825,460.00	0.04
605	603899	晨光股份	62,900	1,823,471.00	0.04
606	600655	豫园股份	328,400	1,822,620.00	0.04
607	600859	王府井	131,072	1,820,590.08	0.04
608	600131	国网信通	102,800	1,819,560.00	0.04
609	000598	兴蓉环境	252,300	1,819,083.00	0.04
610	600325	华发股份	372,000	1,811,640.00	0.04
611	002773	康弘药业	62,500	1,810,625.00	0.04
612	603156	养元饮品	85,432	1,807,741.12	0.04
613	601966	玲珑轮胎	122,100	1,791,207.00	0.04
614	601958	金钼股份	163,400	1,787,596.00	0.04
615	600378	昊华科技	65,700	1,778,499.00	0.04
616	300529	健帆生物	82,000	1,768,740.00	0.04
617	600663	陆家嘴	199,600	1,768,456.00	0.04
618	000050	深天马 A	206,200	1,756,824.00	0.04
619	002756	永兴材料	55,310	1,756,092.50	0.04
620	000987	越秀资本	254,805	1,747,962.30	0.04

621	600282	南钢股份	415,600	1,745,520.00	0.04
622	600271	航天信息	188,700	1,743,588.00	0.04
623	000951	中国重汽	98,600	1,733,388.00	0.04
624	002507	涪陵榨菜	135,520	1,733,300.80	0.04
625	600754	锦江酒店	77,000	1,727,880.00	0.04
626	600598	北大荒	119,500	1,723,190.00	0.04
627	601918	新集能源	265,800	1,717,068.00	0.04
628	600737	中粮糖业	181,700	1,717,065.00	0.04
629	300601	康泰生物	112,620	1,710,697.80	0.04
630	600739	辽宁成大	155,500	1,710,500.00	0.04
631	002429	兆驰股份	389,700	1,706,886.00	0.04
632	601001	晋控煤业	139,400	1,703,468.00	0.04
633	000559	万向钱潮	222,600	1,702,890.00	0.04
634	603833	欧派家居	30,120	1,700,274.00	0.04
635	600764	中国海防	49,400	1,679,600.00	0.03
636	600566	济川药业	63,607	1,674,772.31	0.03
637	300888	稳健医疗	40,580	1,667,838.00	0.03
638	600582	天地科技	278,200	1,666,418.00	0.03
639	601866	中远海发	674,000	1,664,780.00	0.03
640	601333	广深铁路	575,600	1,663,484.00	0.03
641	603688	石英股份	47,200	1,662,384.00	0.03
642	300070	碧水源	368,800	1,659,600.00	0.03
643	688772	珠海冠	115,349	1,648,337.21	0.03

		宇电池			
644	600329	达仁堂	49,400	1,647,984.00	0.03
645	002120	韵达股份	245,670	1,645,989.00	0.03
646	603341	龙旗科技	40,500	1,645,515.00	0.03
647	601231	环旭电子	111,200	1,626,856.00	0.03
648	300735	光弘科技	64,800	1,626,480.00	0.03
649	600867	通化东宝	198,204	1,625,272.80	0.03
650	002430	杭氧股份	83,278	1,617,258.76	0.03
651	600258	首旅酒店	113,300	1,600,929.00	0.03
652	600707	彩虹股份	246,700	1,593,682.00	0.03
653	003031	中瓷电子	29,800	1,585,658.00	0.03
654	601098	中南传媒	120,600	1,582,272.00	0.03
655	600995	南网储能	161,600	1,580,448.00	0.03
656	601212	白银有色	500,200	1,565,626.00	0.03
657	000032	深桑达A	77,300	1,563,779.00	0.03
658	002508	老板电器	81,800	1,555,018.00	0.03
659	000027	深圳能源	241,900	1,543,322.00	0.03
660	603529	爱玛科技	44,400	1,527,360.00	0.03
661	600578	京能电力	337,100	1,513,579.00	0.03
662	603858	步长制药	93,000	1,510,320.00	0.03
663	000709	河钢股份	697,500	1,506,600.00	0.03
664	002299	圣农发展	104,800	1,497,592.00	0.03
665	600906	财达证	219,300	1,495,626.00	0.03

		券			
666	601399	国机重 装	496,100	1,488,300.00	0.03
667	002831	裕同科 技	63,500	1,487,170.00	0.03
668	600848	上海临 港	163,300	1,481,131.00	0.03
669	000883	湖北能 源	328,300	1,480,633.00	0.03
670	600517	国网英 大	289,600	1,476,960.00	0.03
671	000967	盈峰环 境	211,400	1,469,230.00	0.03
672	002670	国盛金 控	97,400	1,465,870.00	0.03
673	600546	山煤国 际	166,600	1,454,418.00	0.03
674	600959	江苏有 线	421,300	1,449,272.00	0.03
675	601928	凤凰传 媒	127,600	1,425,292.00	0.03
676	601156	东航物 流	107,800	1,411,102.00	0.03
677	600968	海油发 展	344,100	1,403,928.00	0.03
678	600808	马钢股 份	405,600	1,399,320.00	0.03
679	300595	欧普康 视	90,860	1,387,432.20	0.03
680	600528	中铁工 业	187,600	1,384,488.00	0.03
681	002572	索菲亚	98,400	1,378,584.00	0.03
682	000825	太钢不 锈	382,000	1,371,380.00	0.03
683	601808	中海油 服	99,600	1,370,496.00	0.03
684	000739	普洛药 业	97,600	1,366,400.00	0.03
685	002266	浙富控 股	443,600	1,366,288.00	0.03
686	601636	旗滨集 团	272,400	1,364,724.00	0.03
687	601118	海南橡	288,900	1,363,608.00	0.03

		胶			
688	603225	新凤鸣	127,800	1,361,070.00	0.03
689	301301	川宁生物	112,800	1,358,112.00	0.03
690	603565	中谷物流	141,400	1,350,370.00	0.03
691	601608	中信重工	308,800	1,349,456.00	0.03
692	600871	石化油服	688,400	1,342,380.00	0.03
693	600977	中国电影	124,200	1,331,424.00	0.03
694	603650	彤程新材	41,300	1,327,795.00	0.03
695	000543	皖能电力	189,600	1,327,200.00	0.03
696	600062	华润双鹤	70,900	1,322,994.00	0.03
697	600801	华新水泥	111,600	1,321,344.00	0.03
698	000785	居然智家	427,300	1,303,265.00	0.03
699	600056	中国医药	125,967	1,302,498.78	0.03
700	601598	中国外运	263,700	1,300,041.00	0.03
701	688387	中信科移动	230,015	1,299,584.75	0.03
702	000582	北部湾港	156,400	1,290,300.00	0.03
703	600377	宁沪高速	84,000	1,288,560.00	0.03
704	601106	中国一重	457,894	1,282,103.20	0.03
705	603233	大参林	77,120	1,257,056.00	0.03
706	601965	中国汽研	68,400	1,214,100.00	0.02
707	600925	苏能股份	231,000	1,208,130.00	0.02
708	600373	中文传媒	117,300	1,204,671.00	0.02
709	002153	石基信息	136,757	1,184,315.62	0.02

710	600606	绿地控股	715,900	1,166,917.00	0.02
711	000429	粤高速 A	87,400	1,165,042.00	0.02
712	000537	中绿电	138,600	1,158,696.00	0.02
713	000800	一汽解放	166,700	1,143,562.00	0.02
714	600098	广州发展	179,500	1,121,875.00	0.02
715	001286	陕西能源	128,500	1,117,950.00	0.02
716	601568	北元集团	268,640	1,114,856.00	0.02
717	002372	伟星新材	107,200	1,110,592.00	0.02
718	600361	创新新材	278,100	1,109,619.00	0.02
719	688425	铁建重工	270,516	1,103,705.28	0.02
720	003022	联泓新科	68,100	1,078,023.00	0.02
721	600688	上海石化	369,300	1,052,505.00	0.02
722	000937	冀中能源	179,200	1,030,400.00	0.02
723	601019	山东出版	103,900	983,933.00	0.02
724	001391	国货航	143,600	966,428.00	0.02
725	000898	鞍钢股份	404,600	938,672.00	0.02
726	601139	深圳燃气	147,200	936,192.00	0.02
727	002608	江苏国信	127,500	934,575.00	0.02
728	600339	中油工程	281,900	921,813.00	0.02
729	603707	健友股份	82,127	915,716.05	0.02
730	000959	首钢股份	267,300	908,820.00	0.02
731	600032	浙江新能	119,400	902,664.00	0.02
732	600720	中交设	115,000	888,950.00	0.02

		计			
733	003035	南网能源	191,700	879,903.00	0.02
734	600928	西安银行	220,900	865,928.00	0.02
735	600295	鄂尔多斯	98,700	859,677.00	0.02
736	601228	广州港	259,600	838,508.00	0.02
737	301267	华厦眼科	43,700	837,729.00	0.02
738	002461	珠江啤酒	73,900	834,331.00	0.02
739	603556	海兴电力	31,500	802,305.00	0.02
740	600927	永安期货	49,800	737,538.00	0.02
741	601061	中信金属	90,000	711,900.00	0.01
742	002563	森马服饰	134,200	705,892.00	0.01
743	000539	粤电力 A	151,900	689,626.00	0.01
744	600007	中国国贸	33,400	687,372.00	0.01
745	600299	安迪苏	68,500	661,025.00	0.01
746	002945	华林证券	45,300	650,961.00	0.01
747	300140	节能环保	103,900	641,063.00	0.01
748	603826	坤彩科技	32,500	636,025.00	0.01
749	601921	浙版传媒	76,000	612,560.00	0.01
750	001213	中铁特货	150,500	611,030.00	0.01
751	601158	重庆水务	97,300	451,472.00	0.01
752	600956	新天绿能	54,500	420,740.00	0.01

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	400174	中天 3	371,600	3,716.00	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	601211	国泰海通	23,606,023.24	0.38
2	300750	宁德时代	20,595,920.00	0.33
3	002594	比亚迪	13,735,412.55	0.22
4	002371	北方华创	11,964,862.00	0.19
5	000333	美的集团	10,085,394.69	0.16
6	601825	沪农商行	9,426,275.00	0.15
7	601166	兴业银行	8,450,637.00	0.14
8	601058	赛轮轮胎	7,879,614.00	0.13
9	601077	渝农商行	7,396,467.00	0.12
10	300059	东方财富	6,895,715.00	0.11
11	002230	科大讯飞	5,720,900.40	0.09
12	688608	恒玄科技	5,310,426.14	0.09
13	000651	格力电器	5,180,224.00	0.08
14	000858	五粮液	5,111,704.00	0.08
15	688235	百济神州	4,888,747.75	0.08
16	002475	立讯精密	4,728,330.00	0.08
17	601328	交通银行	4,553,548.00	0.07
18	000933	神火股份	4,549,803.00	0.07
19	300308	中际旭创	4,422,984.00	0.07
20	688617	惠泰医疗	3,998,289.97	0.06

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	300750	宁德时代	56,211,193.98	0.90
2	002594	比亚迪	29,429,203.10	0.47
3	000333	美的集团	28,487,060.40	0.46
4	300059	东方财富	22,386,931.78	0.36
5	600837	海通证券	21,843,066.24	0.35
6	000858	五粮液	18,872,309.00	0.30
7	002371	北方华创	18,561,429.34	0.30
8	002475	立讯精密	15,603,548.00	0.25
9	000651	格力电器	15,504,163.00	0.25
10	002625	光启技术	14,979,796.00	0.24
11	300124	汇川技术	14,633,882.28	0.23
12	000725	京东方 A	12,296,004.00	0.20
13	600418	江淮汽车	12,143,907.00	0.19
14	300760	迈瑞医疗	11,039,755.00	0.18
15	002384	东山精密	10,174,750.88	0.16
16	000063	中兴通讯	10,023,822.89	0.16
17	300308	中际旭创	9,534,062.00	0.15
18	300274	阳光电源	9,090,507.00	0.15
19	000001	平安银行	8,589,628.71	0.14
20	688256	寒武纪科技	8,336,715.56	0.13

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	636,806,284.77
卖出股票收入（成交）总额	1,175,990,097.95

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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，招商银行股份有限公司、兴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	15,578,788.01
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,578,788.01

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

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限 情况说明
1	400174	中天 3	3,716.00	0.00	重大事项 停牌

§ 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

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		平安银行股份有限公司-汇添富中证 800 交易型开放式 指数证券投资基金 联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
5,507	853,357.04	4,518,100,338.00	96.14	181,336,860.00	3.86	51,626,700.00	1.10

注: 机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中央汇金资产管理有限责任公司	1,307,627,911.00	27.83

2	中国人寿保险股份有限公司	512,398,742.00	10.90
3	大家人寿保险股份有限公司—传统产品	263,805,300.00	5.61
4	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—传统险—汇添富国寿股份均衡股票传统可供出	263,344,800.00	5.60
5	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—传统险—汇添富国寿股份成长股票传统可供出	214,744,200.00	4.57
6	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—分红险—汇添富基金国寿股份成长股票型组合	213,135,100.00	4.54
7	友邦人寿保险有限公司—传统	174,016,400.00	3.70
8	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	140,056,000.00	2.98
9	友邦人寿保险有限公司—分红	138,328,600.00	2.94
10	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—分红险—汇添富基金国寿股份均衡股票型组合	133,783,900.00	2.85
11	平安银行股份有限公司—汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	51,626,700.00	1.10

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 10 月 08 日）基金份额总额	6,601,437,198.00
本报告期期初基金份额总额	6,148,187,198.00
本报告期基金总申购份额	598,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,047,250,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,699,437,198.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
华泰证券	2	1,059,174,333.95	59.87	186,320.85	59.87	
东方证券	2	542,481,366.37	30.66	95,445.48	30.67	
国泰海通	2	96,499,277.74	5.45	16,974.31	5.45	
兴业证券	1	70,955,272.18	4.01	12,486.34	4.01	
广发证券	3	—	—	—	—	
平安证券	2	—	—	—	—	
申万宏源证券	2	—	—	—	—	
银河	2	—	—	—	—	

证券						
招商 证券	2	-	-	-	-	
中泰 证券	1	-	-	-	-	
中信 建投 证券	1	-	-	-	-	
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 (%)
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	217,000,000.00	81.27	-	-	-	-
国泰 海通	1,000,825.33	100.00	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	50,000,000.00	18.73	-	-	-	-
广	-	-	-	-	-	-	-	-

发 证 券								
平 安 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申 万 宏 源 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银 河 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招 商 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中 泰 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中 信 建 投 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中 信 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/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：

本基金本报告期内退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：广发证券（深交所单元）。

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 2024 年第四季度报告	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报	2025 年 01 月 22 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西南证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国盛证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 12 日
4	关于汇添富基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数许可使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上证报, 上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 20 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新法律文件	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所	2025 年 03 月 20 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新产品资料概要	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日
7	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, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 21 日

8	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 上证报	2025 年 03 月 31 日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年年报	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 31 日
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 22 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报, 上交所, 深交所	2025 年 04 月 30 日
12	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)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	2025 年 06 月 16 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 23 日
14	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行（中国）有限公司合作关系的公告	上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

机构	1	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	1,307,627,911.00	-	-	1,307,627,911.00	27.83
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。							

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、中国证监会批准中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内中证 800 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

2025 年 08 月 29 日