

# 汇添富上证综合指数证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	14
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 .....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
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 .....	17
§ 5 托管人报告 .....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	17
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	18
6.1 资产负债表 .....	18
6.2 利润表 .....	19
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	20
6.4 报表附注 .....	22
§ 7 投资组合报告 .....	52
7.1 期末基金资产组合情况 .....	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
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 .....	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	73
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 .....	73
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	74
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	74
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	74

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合指数证券投资基金	
基金简称	汇添富上证综合指数	
基金主代码	470007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 07 月 01 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	770,843,339.04	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C
下属分级基金的交易代码	470007	018536
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	769,392,972.89	1,450,366.15

注：本基金于 2023 年 05 月 19 日新增汇添富上证综合指数 C 类份额。

### 2.2 基金产品说明

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

风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。
--------	---------------------------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	李文	陈四清

## 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)	
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C
本期已实现收益	9,067,668.04	7,639.09
本期利润	38,121,852.46	4,385.12

加权平均基金份额本期利润	0.0502	0.0105
本期加权平均净值利润率	4.78%	1.00%
本期基金份额净值增长率	4.80%	-1.41%
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	38,017,188.70	70,458.99
期末可供分配基金份额利润	0.0494	0.0486
期末基金资产净值	807,410,161.59	1,520,825.14
期末基金份额净值	1.049	1.049
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	38.97%	-1.41%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富上证综合指数 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.25%	0.69%	-0.07%	0.68%	1.32%	0.01%
过去三个月	-0.29%	0.78%	-2.04%	0.74%	1.75%	0.04%
过去六个月	4.80%	0.72%	3.49%	0.70%	1.31%	0.02%
过去一	-2.84%	0.81%	-5.45%	0.80%	2.61%	0.01%

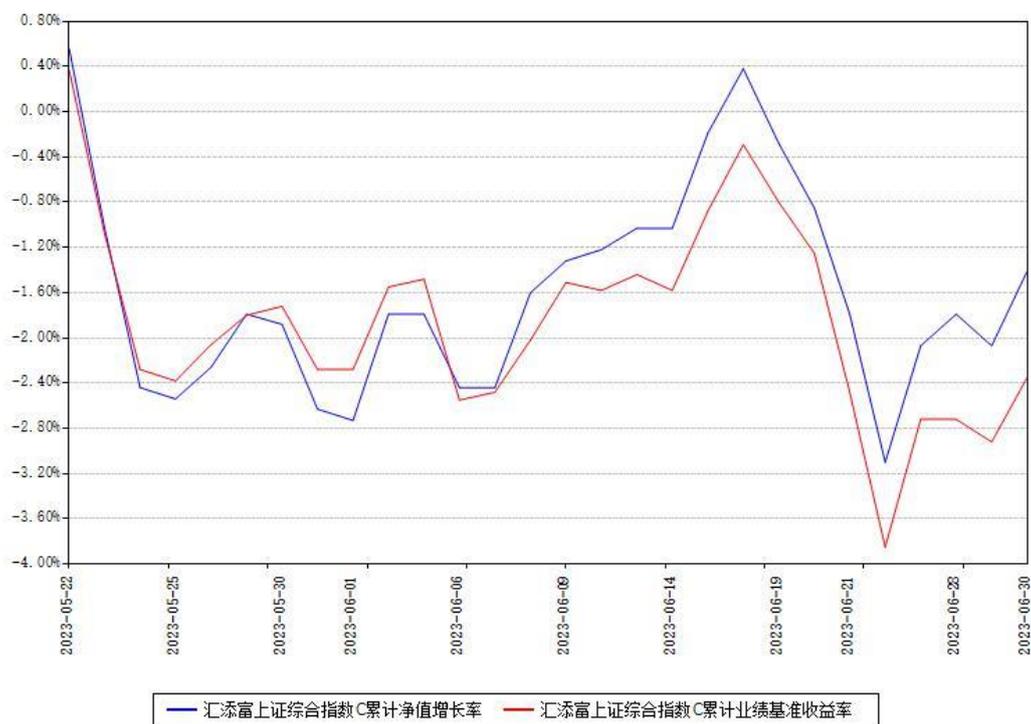
年						
过去三年	16.63%	0.97%	7.16%	0.97%	9.47%	0.00%
自基金合同生效日起至今	38.97%	1.26%	9.61%	1.25%	29.36%	0.01%
汇添富上证综合指数 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.25%	0.67%	-0.07%	0.68%	1.32%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-1.41%	0.73%	-2.35%	0.69%	0.94%	0.04%

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

汇添富上证综合指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



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

本基金于2023年05月19日新增C类份额，新增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		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2010 年 02 月 06 日		17	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11

				<p>月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4</p>
--	--	--	--	---

				<p>月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任</p>
--	--	--	--	--

				<p>中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2022 年 1 月 27 日至今任汇添富中证智能汽车主</p>
--	--	--	--	--

					<p>题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至今任汇添富量化选股混合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

2023 年上半年，资本市场先在经济复苏背景下显现出修复行情，二季度市场整体显著回调。

上半年美联储累计加息三次，将联邦基金目标利率提升至 5.00%-5.25% 区间。3 月议息会议声明文件对未来继续加息的表述有所弱化，5 月暗示后续加息暂缓但年内仍较难降息。市场普遍预期本轮加息周期接近尾声，但转向降息周期仍然需要一定时间。

全球来看，海外通胀回落速度较为缓慢，美元指数二季度阶段性走强，人民币兑美元贬值压力加大。北向资金二季度小幅净流入，较一季度显著放缓。

国内来看，3 月两会召开，仍然坚持以稳增长为中心，加强协同，共同促进高质量发展。经济数据在二季度普遍表现疲软。GDP 增速低于市场预期。6 月官方制造业 PMI 数据 49，较前值小幅企稳，但仍低于 50。1-5 月规模以上工业企业营业收入累计同比增长 0.1%，

利润累计同比下滑 18.8%，相较 1-4 月累计营收增速下滑、累计利润增速降幅有所收窄。国内经济整体仍处于弱复苏阶段，内需修复动力不足、外需增长压力较大，经济发展模式转型阶段存在压力和挑战。在稳增长压力较大的背景下，政策层面有望持续发力。6 月 MLF 下调 10 个基点，随后一年期、五年期 LPR 均下调 10 个基点，有望减轻企业融资成本、居民债务负担压力。

二季度市场有所回调，行业主题结构性分化显著。一季度表现强势的计算机、通信等板块在 4 月和 5 月显著回调，6 月开始重新受到市场关注。银行、证券等金融类资产则是 4 月表现强势之后进入回调。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富上证综合指数 A 类份额净值增长率为 4.80%，同期业绩比较基准收益率为 3.49%。本报告期内新增汇添富上证综合指数 C 类份额，自实际有资产之日起至报告期末的净值增长率为-1.41%，同期业绩比较基准收益率为-2.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济呈现弱复苏状态，复苏强度低于年初预期。分项来看，工业制造和投资相对具有韧性，消费和出口较为疲弱。但居民消费倾向有抬升迹象，结合收入提升预期，下半年内需动能有望出现改善。国内政策基调仍以稳增长为主，尽管难有强刺激，但或许可以期待整体托底和结构性的支持政策。

资本市场上半年整体表现为震荡修复。业绩角度来看，A 股整体盈利增速尚未明显改善，结构分化仍然较为显著，但在当前市场整体估值较低的阶段，权益市场整体性机会在增加。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以

上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

报告截止日：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
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	57,615,520.89	56,256,042.83
结算备付金		159,497.84	-
存出保证金		13,272.39	12,746.25
交易性金融资产	6.4.7.2	750,389,823.44	733,676,431.20
其中：股票投资		745,132,121.96	733,676,431.20
基金投资		-	-
债券投资		5,257,701.48	-
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		285,147.52	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,481,953.80	429,792.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		809,945,215.88	790,375,013.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	112.09

应付赎回款		235,563.08	219,936.97
应付管理人报酬		495,243.52	502,127.23
应付托管费		99,048.75	100,425.42
应付销售服务费		189.16	-
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	184,184.64	222,436.47
负债合计		1,014,229.15	1,045,038.18
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	770,843,339.04	788,438,630.11
未分配利润	6.4.7.9	38,087,647.69	891,344.88
净资产合计		808,930,986.73	789,329,974.99
负债和净资产总计		809,945,215.88	790,375,013.17

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 770,843,339.04 份。本基金下属汇添富上证综合指数 A 基金份额净值 1.049 元，基金份额总额 769,392,972.89 份；本基金下属汇添富上证综合指数 C 基金份额净值 1.049 元，基金份额总额 1,450,366.15 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：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
<b>一、营业总收入</b>		<b>41,791,035.96</b>	<b>-31,012,093.67</b>
1. 利息收入		77,580.65	92,234.32
其中：存款利息收入	6.4.7.10	77,580.65	92,234.32
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）		12,489,138.54	10,035,252.61
其中：股票投资收益	6.4.7.11	3,535,802.38	2,121,007.39
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	21,917.26	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-

股利收益	6.4.7.17	8,931,418.90	7,914,245.22
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	29,050,930.45	-41,288,295.73
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	173,386.32	148,715.13
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,664,798.38</b>	<b>3,519,958.11</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,970,585.33	2,850,060.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	594,117.16	570,012.05
3. 销售服务费		193.92	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	99,901.97	99,885.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>38,126,237.58</b>	<b>-34,532,051.78</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>38,126,237.58</b>	<b>-34,532,051.78</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>38,126,237.58</b>	<b>-34,532,051.78</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富上证综合指数证券投资基金

本报告期：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）	788,438,630.11	891,344.88	789,329,974.99
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	788,438,630.11	891,344.88	789,329,974.99
三、本期增减变动额（减少以	-17,595,291.07	37,196,302.81	19,601,011.74

“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	38,126,237.58	38,126,237.58
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-17,595,291.07	-929,934.77	-18,525,225.84
其中: 1. 基金申购款	131,587,469.50	6,966,726.25	138,554,195.75
2. 基金赎回款	-149,182,760.57	-7,896,661.02	-157,079,421.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	770,843,339.04	38,087,647.69	808,930,986.73
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)	676,642,253.45	133,095,151.87	809,737,405.32
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	676,642,253.45	133,095,151.87	809,737,405.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	59,092,118.19	-59,723,303.01	-631,184.82
(一)、综合收益总额	-	-34,532,051.78	-34,532,051.78
(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)	59,092,118.19	1,907,854.50	60,999,972.69
其中: 1. 基金申购款	177,813,676.81	7,950,473.46	185,764,150.27
2. 基金赎回款	-118,721,558.62	-6,042,618.96	-124,764,177.58
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-27,099,105.73	-27,099,105.73

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）	735,734,371.64	73,371,848.86	809,106,220.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

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

本基金的标的指数为上证综合指数。本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股（如一级市场初次发行或增发）、存托凭证等，其中股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 90%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。投资于标的指数成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%（但因法律法规限制原因导致本基金不能投资相关股票而致使本基金不能达到上述比例的情形除外）。今后如果法律法规允许，本基金的股票及存托凭证投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。如以后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具，如股指期货、ETF 等，本基金可以依

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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	57,615,520.89
等于：本金	57,610,343.51
加：应计利息	5,177.38
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	57,615,520.89

#### 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	697,313,897.21	-	745,132,121.96	47,818,224.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	47,821.48	5,257,701.48	15,780.00
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	47,821.48	5,257,701.48	15,780.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	702,507,997.21	47,821.48	750,389,823.44	47,834,004.75

#### 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	571.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	29,865.03
其中：交易所市场	29,865.03
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	94,240.60
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	-
其他	-
合计	184,184.64

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富上证综合指数 A		
项目	本期 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	788,438,630.11	788,438,630.11
本期申购	129,924,424.52	129,924,424.52
本期赎回（以“-”号填列）	-148,970,081.74	-148,970,081.74
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	769,392,972.89	769,392,972.89
汇添富上证综合指数 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	-	-
本期申购	1,663,044.98	1,663,044.98
本期赎回（以“-”号填列）	-212,678.83	-212,678.83
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	1,450,366.15	1,450,366.15

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富上证综合指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	287,494,768.28	-286,603,423.40	891,344.88
本期利润	9,067,668.04	29,054,184.42	38,121,852.46
本期基金份额交易产生的变动数	-6,848,656.98	5,852,648.34	-996,008.64
其中：基金申购款	47,536,493.54	-40,646,559.24	6,889,934.30
基金赎回款	-54,385,150.52	46,499,207.58	-7,885,942.94

本期已分配利润	-	-	-
本期末	289,713,779.34	-251,696,590.64	38,017,188.70
汇添富上证综合指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	7,639.09	-3,253.97	4,385.12
本期基金份额交易产生的变动数	537,025.01	-470,951.14	66,073.87
其中：基金申购款	615,762.17	-538,970.22	76,791.95
基金赎回款	-78,737.16	68,019.08	-10,718.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	544,664.10	-474,205.11	70,458.99

#### 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	77,266.58
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	199.58
其他	114.49
合计	77,580.65

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	43,606,915.54
减：卖出股票成本总额	39,976,672.74
减：交易费用	94,440.42
买卖股票差价收入	3,535,802.38

#### 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	21,917.26
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	-
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	21,917.26

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.16 衍生工具收益

#### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,931,418.90
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	8,931,418.90

## 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	29,050,930.45
——股票投资	29,035,150.45
——债券投资	15,780.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	29,050,930.45

## 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	173,386.32
替代损益	-
其他	-
合计	173,386.32

## 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	31,240.60
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	154.00
指数使用费	-

持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	99,901.97

#### 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

本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告和实施的利润分配的情况如下：

基金向截止 2023 年 07 月 10 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，汇添富上证综合指数 A 份额每 10 份基金份额派发红利 0.1100 元；汇添富上证综合指数 C 份额每 10 份基金份额派发红利 0.1100 元。

截至财务报表批准日，除上述事项外，本基金无其他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
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人, 基金代销机构

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	-	-	207,900.00	0.22

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 (%)
	-	-	-	-
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 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	147.88	0.22	147.88	0.78

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	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	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	2,970,585.33	2,850,060.09
其中：支付销售机构的客户维护费	1,019,077.30	976,506.06

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	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	594,117.16	570,012.05

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

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

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		
	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C	合计
合计	-	-	-

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

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
工商银行	57,615,520.89	77,266.58	43,758,643.88	91,426.15

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

#### 6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688334	西高院	2023 年 06 月 09 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	
688361	中	2023	6	新	23.60	64.67	665	15,694.00	43,005.55	

	科 飞 测	年 05 月 12 日	个 月	股 流 通 受 限						
688443	智 翔 金 泰	2023 年 06 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	37.88	29.49	1,413	53,524.44	41,669.37	
688458	美 芯 晟 科 技	2023 年 05 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	
688472	阿 特 斯 阳 光 电 力	2023 年 06 月 02 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.10	17.04	2,804	31,124.40	47,780.16	
688523	航 天 环 宇 科 技	2023 年 05 月 26 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	
688562	航 天 软 件 股 份	2023 年 05 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	
688581	安 杰 思 医 学	2023 年 05 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	125.80	118.03	107	13,460.60	12,629.21	
688582	芯 动	2023 年	6 个	新 股	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	

	联科	06月21日	月	流通受限						
688620	安凯微电子	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	
688623	双元科技	2023年05月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	
688629	四川华丰科技	2023年06月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	
688631	莱斯信息	2023年06月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	
601916	浙商银行	2023年06月27日	7个交易日	配股流通受限	2.02	2.64	94,348	190,582.96	249,078.72	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代	证	成功	受	流	认购价	期末估	数量	期末成本总	期末估值总	备

码	券名称	认购日	限期	通受限类型	格	值单价	(单位:张)	额	额	注
					-	-	-	-	-	

#### 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
601298	青岛港	2023年06月28日	重大事項停牌	6.97	2023年07月03日	7.40	102,300	636,359.84	713,031.00	

注：截止 2023 年 6 月 30 日，本基金合计持有\*ST 蓝光（600466.SH）287,400 股。于 2023 年 6 月 6 日，\*ST 蓝光（600466.SH）发布公告，上海证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 6 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。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，依据四川蓝光发展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，将汇添富上证综合指数证券投资基金所持有\*ST 蓝光（600466.SH）按每股 0.00 元人民币估值。

#### 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	57,615,520.8	-	-	-	-	-	57,615,520.89

行存款	9						
结算备付金	159,497.84	-	-	-	-	-	159,497.84
存出保证金	13,272.39	-	-	-	-	-	13,272.39
交易性金融资产	-	-	5,257,701.48	-	-	745,132,121.96	750,389,823.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	285,147.52	285,147.52
应	-	-	-	-	-	-	-

收股利							
应收申购款	-	-	-	-	-	1,481,953.80	1,481,953.80
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	57,788,291.12	-	5,257,701.48	-	-	746,899,223.28	809,945,215.88
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	-	-	-	-	-	235,563.08	235,563.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	495,243.52	495,243.52
应付托管费	-	-	-	-	-	99,048.75	99,048.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	189.16	189.16
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	-	-	-	-	-	184,184.64	184,184.64
负债总计	-	-	-	-	-	1,014,229.15	1,014,229.15
利率敏感度缺口	57,788,291.12	-	5,257,701.48	-	-	745,884,994.13	808,930,986.73
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	56,256,042.83	-	-	-	-	-	56,256,042.83

款							
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	12,746.25	-	-	-	-	-	12,746.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	733,676,431.20	733,676,431.20
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	-	-	-	-	-	429,792.89	429,792.89
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	56,268,789.08	-	-	-	-	734,106,224.09	790,375,013.17
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	-	-	-	-	-	112.09	112.09
应付赎回款	-	-	-	-	-	219,936.97	219,936.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	502,127.23	502,127.23
应付托管费	-	-	-	-	-	100,425.42	100,425.42
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	-	-	-	-	-	222,436.47	222,436.47
负债总计	-	-	-	-	-	1,045,038.18	1,045,038.18
利率敏感度缺口	56,268,789.08	-	-	-	-	733,061,185.91	789,329,974.99

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

	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	7,044.14	-
基准利率增加 25 个基点	-7,025.14	-	

#### 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	745,132,121.96	92.11	733,676,431.20	92.95
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,257,701.48	0.65	-	-
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	750,389,823.44	92.76	733,676,431.20	92.95

##### 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
	上证综合指数上涨 5%	37,863,059.39	36,080,042.87
	上证综合指数下跌 5%	-37,863,059.39	-36,080,042.87

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	743,885,476.51
第二层次	6,219,811.20
第三层次	284,535.73
合计	750,389,823.44

###### 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	745,132,121.96	92.00
	其中：股票	745,132,121.96	92.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,257,701.48	0.65
	其中：债券	5,257,701.48	0.65
	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	57,775,018.73	7.13
8	其他各项资产	1,780,373.71	0.22
9	合计	809,945,215.88	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	1,348,815.11	0.17
B	采矿业	72,673,265.50	8.98
C	制造业	311,583,972.06	38.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,595,518.50	3.91
E	建筑业	24,723,961.09	3.06
F	批发和零售业	11,878,067.97	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	33,724,509.57	4.17
H	住宿和餐饮业	1,074,068.02	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,764,756.70	3.19
J	金融业	190,070,032.47	23.50
K	房地产业	12,655,175.69	1.56
L	租赁和商务服务业	6,009,288.90	0.74
M	科学研究和技术服务业	6,027,362.58	0.75
N	水利、环境和公共设施管理业	4,048,980.26	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,122,930.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	5,263,372.84	0.65
S	综合	769,263.92	0.10
	合计	742,333,341.18	91.77

### 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	2,435,440.96	0.30
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	205,426.98	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	157,912.84	0.02

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	2,798,780.78	0.35

### 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	28,962	48,974,742.00	6.05
2	601288	农业银行	9,022,473	31,849,329.69	3.94
3	601988	中国银行	6,996,611	27,356,749.01	3.38
4	601857	中国石油	3,302,257	24,667,859.79	3.05
5	600036	招商银行	434,715	14,241,263.40	1.76
6	601628	中国人寿	395,971	13,843,146.16	1.71
7	600028	中国石化	1,803,677	11,471,385.72	1.42
8	601138	工业富联	446,600	11,254,320.00	1.39
9	601318	中国平安	234,303	10,871,659.20	1.34
10	601088	中国神华	312,815	9,619,061.25	1.19
11	600900	长江电	430,011	9,486,042.66	1.17

		力			
12	600309	万华化学	100,211	8,802,534.24	1.09
13	601939	建设银行	1,350,711	8,455,450.86	1.05
14	600276	恒瑞医药	149,392	7,155,876.80	0.88
15	601166	兴业银行	404,806	6,335,213.90	0.78
16	601658	邮储银行	1,236,868	6,048,284.52	0.75
17	603288	海天味业	118,560	5,554,536.00	0.69
18	600426	华鲁恒升	179,160	5,487,670.80	0.68
19	601012	隆基绿能	189,659	5,437,523.53	0.67
20	601689	拓普集团	67,262	5,428,043.40	0.67
21	600025	华能水电	731,200	5,213,456.00	0.64
22	600809	山西汾酒	26,356	4,877,704.92	0.60
23	600030	中信证券	236,550	4,678,959.00	0.58
24	600031	三一重工	276,894	4,604,747.22	0.57
25	601888	中国中免	41,305	4,565,441.65	0.56
26	601668	中国建筑	792,585	4,549,437.90	0.56
27	601390	中国中铁	591,428	4,483,024.24	0.55
28	600438	通威股份	129,285	4,435,768.35	0.55
29	603259	药明康德	69,720	4,344,253.20	0.54
30	601100	恒立液压	67,220	4,324,262.60	0.53
31	601328	交通银行	741,317	4,299,638.60	0.53
32	601899	紫金矿业	372,442	4,234,665.54	0.52

33	600000	浦发银行	576,292	4,172,354.08	0.52
34	603605	珀莱雅	36,904	4,148,009.60	0.51
35	600436	片仔癀	14,137	4,048,271.32	0.50
36	600887	伊利股份	139,461	3,949,535.52	0.49
37	601998	中信银行	643,572	3,848,560.56	0.48
38	601816	京沪高铁	687,000	3,613,620.00	0.45
39	601021	春秋航空	62,683	3,602,392.01	0.45
40	600406	国电南瑞	153,906	3,555,228.60	0.44
41	601225	陕西煤业	190,581	3,466,668.39	0.43
42	601601	中国太保	131,378	3,413,200.44	0.42
43	603596	伯特利	42,900	3,400,254.00	0.42
44	603799	华友钴业	73,327	3,366,442.57	0.42
45	603993	洛阳钼业	624,039	3,326,127.87	0.41
46	603659	璞泰来	86,490	3,305,647.80	0.41
47	600845	宝信软件	64,633	3,284,002.73	0.41
48	600690	海尔智家	139,600	3,277,808.00	0.41
49	603501	韦尔股份	32,820	3,217,672.80	0.40
50	600760	中航沈飞	71,372	3,211,740.00	0.40
51	601066	中信建投	131,790	3,189,318.00	0.39
52	600104	上汽集团	222,200	3,148,574.00	0.39
53	601766	中国中车	471,761	3,066,446.50	0.38
54	600009	上海机场	65,665	2,982,504.30	0.37
55	600048	保利发展	228,869	2,982,163.07	0.37
56	601633	长城汽	118,325	2,978,240.25	0.37

		车			
57	601319	中国人保	500,000	2,920,000.00	0.36
58	601699	潞安环能	178,005	2,905,041.60	0.36
59	600486	扬农化工	33,200	2,902,344.00	0.36
60	603737	三棵树	43,876	2,870,367.92	0.35
61	600050	中国联通	589,342	2,828,841.60	0.35
62	601333	广深铁路	709,851	2,811,009.96	0.35
63	601868	中国能建	1,163,374	2,722,295.16	0.34
64	600933	爱柯迪	116,600	2,715,614.00	0.34
65	600016	民生银行	707,008	2,651,280.00	0.33
66	600150	中国船舶	80,200	2,639,382.00	0.33
67	600893	航发动力	61,852	2,613,865.52	0.32
68	600570	恒生电子	58,240	2,579,449.60	0.32
69	603833	欧派家居	26,641	2,552,207.80	0.32
70	601000	唐山港	713,600	2,519,008.00	0.31
71	601800	中国交建	224,239	2,446,447.49	0.30
72	600757	长江传媒	281,907	2,424,400.20	0.30
73	600019	宝钢股份	422,855	2,376,445.10	0.29
74	600010	包钢股份	1,326,680	2,374,757.20	0.29
75	688008	澜起科技	41,311	2,372,077.62	0.29
76	603308	应流股份	129,600	2,371,680.00	0.29
77	603369	今世缘	44,600	2,354,880.00	0.29
78	603882	金域医学	31,100	2,348,050.00	0.29
79	600999	招商证券	172,586	2,341,992.02	0.29

80	601117	中国化学	281,727	2,332,699.56	0.29
81	603444	吉比特	4,700	2,308,217.00	0.29
82	601818	光大银行	751,467	2,307,003.69	0.29
83	600018	上港集团	438,690	2,303,122.50	0.28
84	601919	中远海控	243,848	2,292,171.20	0.28
85	603826	坤彩科技	45,700	2,285,000.00	0.28
86	600007	中国国贸	123,159	2,280,904.68	0.28
87	603986	兆易创新	21,280	2,261,000.00	0.28
88	601799	星宇股份	18,000	2,224,800.00	0.28
89	603338	浙江鼎力	39,193	2,195,199.93	0.27
90	601186	中国铁建	219,859	2,165,611.15	0.27
91	603568	伟明环保	122,270	2,140,947.70	0.26
92	601989	中国重工	441,829	2,129,615.78	0.26
93	600919	江苏银行	287,040	2,109,744.00	0.26
94	601006	大秦铁路	282,644	2,100,044.92	0.26
95	601985	中国核电	295,200	2,081,160.00	0.26
96	600489	中金黄金	201,243	2,078,840.19	0.26
97	688012	中微半导体设备	13,178	2,061,698.10	0.25
98	601211	国泰君安	147,100	2,057,929.00	0.25
99	600885	宏发股份	64,274	2,047,126.90	0.25
100	600131	国网信通	100,100	2,021,019.00	0.25
101	601881	中国银河	171,204	1,987,678.44	0.25

102	600346	恒力石化	137,389	1,968,784.37	0.24
103	600011	华能国际	210,096	1,945,488.96	0.24
104	601688	华泰证券	141,160	1,943,773.20	0.24
105	601808	中海油服	137,897	1,914,010.36	0.24
106	603195	公牛集团	19,684	1,890,845.04	0.23
107	600585	海螺水泥	79,281	1,882,130.94	0.23
108	601139	深圳燃气	254,200	1,853,118.00	0.23
109	601169	北京银行	399,572	1,850,018.36	0.23
110	603786	科博达	28,100	1,846,170.00	0.23
111	603392	万泰生物	27,505	1,836,508.85	0.23
112	600588	用友网络	86,821	1,779,830.50	0.22
113	600188	兖矿能源	58,483	1,749,811.36	0.22
114	600111	北方稀土	72,687	1,743,034.26	0.22
115	600522	中天科技	109,173	1,736,942.43	0.21
116	600989	宝丰能源	137,600	1,735,136.00	0.21
117	600886	国投电力	133,905	1,693,898.25	0.21
118	600547	山东黄金	71,790	1,685,629.20	0.21
119	600085	同仁堂	29,182	1,679,715.92	0.21
120	601669	中国电建	290,883	1,669,668.42	0.21
121	603899	晨光股份	37,300	1,665,072.00	0.21
122	600600	青岛啤酒	16,051	1,663,365.13	0.21
123	600089	特变电工	74,019	1,649,883.51	0.20
124	601377	兴业证	268,498	1,643,207.76	0.20

		券			
125	600373	中文传媒	122,462	1,631,193.84	0.20
126	600546	山煤国际	110,600	1,600,382.00	0.20
127	601336	新华保险	43,155	1,586,809.35	0.20
128	600015	华夏银行	291,981	1,579,617.21	0.20
129	601111	中国国航	190,881	1,572,859.44	0.19
130	601229	上海银行	269,906	1,551,959.50	0.19
131	601360	三六零	123,600	1,549,944.00	0.19
132	600732	爱旭股份	49,980	1,536,885.00	0.19
133	601009	南京银行	190,376	1,523,008.00	0.19
134	600703	三安光电	88,262	1,521,636.88	0.19
135	601698	中国卫通	76,300	1,516,844.00	0.19
136	600266	城建发展	295,810	1,502,714.80	0.19
137	601898	中煤能源	174,787	1,475,202.28	0.18
138	603658	安图生物	28,500	1,474,305.00	0.18
139	600641	万业企业	77,220	1,474,129.80	0.18
140	601238	广汽集团	140,056	1,459,383.52	0.18
141	600660	福耀玻璃	40,330	1,445,830.50	0.18
142	603713	密尔克卫	16,000	1,425,440.00	0.18
143	600795	国电电力	371,228	1,421,803.24	0.18
144	603806	福斯特	37,974	1,412,253.06	0.17
145	600612	老凤祥	20,204	1,411,855.52	0.17
146	601600	中国铝业	253,865	1,393,718.85	0.17
147	603260	合盛硅业	19,800	1,386,396.00	0.17

		业			
148	600606	绿地控股	496,177	1,364,486.75	0.17
149	600170	上海建工	503,551	1,354,552.19	0.17
150	603019	中科曙光	26,600	1,353,940.00	0.17
151	600583	海油工程	230,720	1,349,712.00	0.17
152	600862	中航高科	53,197	1,346,416.07	0.17
153	601618	中国中冶	339,059	1,346,064.23	0.17
154	600926	杭州银行	114,180	1,341,615.00	0.17
155	603083	剑桥科技	21,280	1,338,299.20	0.17
156	600271	航天信息	96,624	1,322,782.56	0.16
157	600745	闻泰科技	27,000	1,320,300.00	0.16
158	600023	浙能电力	257,579	1,305,925.53	0.16
159	600837	海通证券	140,686	1,297,124.92	0.16
160	600674	川投能源	85,300	1,283,765.00	0.16
161	600029	南方航空	211,741	1,276,798.23	0.16
162	600196	复星医药	40,991	1,266,621.90	0.16
163	601788	光大证券	77,338	1,228,900.82	0.15
164	688388	嘉元科技	45,273	1,218,749.16	0.15
165	600529	山东药玻	44,425	1,209,248.50	0.15
166	600510	黑牡丹	197,481	1,198,709.67	0.15
167	601865	福莱特	30,800	1,186,108.00	0.15
168	600323	瀚蓝环境	62,292	1,179,187.56	0.15
169	601877	正泰电器	41,962	1,160,249.30	0.14

170	600741	华域汽车	61,550	1,136,213.00	0.14
171	600176	中国巨石	79,040	1,119,206.40	0.14
172	600487	亨通光电	75,879	1,112,386.14	0.14
173	603889	新澳股份	147,280	1,106,072.80	0.14
174	600584	长电科技	34,671	1,080,695.07	0.13
175	601916	浙商银行	408,843	1,079,345.52	0.13
176	688009	中国通号	185,468	1,075,714.40	0.13
177	600875	东方电气	57,099	1,064,896.35	0.13
178	601727	上海电气	230,792	1,054,719.44	0.13
179	600027	华电国际	154,775	1,035,444.75	0.13
180	601901	方正证券	157,400	1,029,396.00	0.13
181	600115	中国东航	216,126	1,028,759.76	0.13
182	600482	中国动力	43,800	1,026,672.00	0.13
183	603877	太平鸟	39,800	1,006,144.00	0.12
184	600298	安琪酵母	27,500	995,775.00	0.12
185	600132	重庆啤酒	10,800	995,328.00	0.12
186	600640	国脉文化	81,500	978,815.00	0.12
187	600598	北大荒	73,195	975,689.35	0.12
188	600332	白云山	29,877	952,478.76	0.12
189	603018	华设集团	108,696	951,090.00	0.12
190	600038	中直股份	23,506	936,008.92	0.12
191	600233	圆通速递	63,500	924,560.00	0.11
192	601872	招商轮船	155,630	901,097.70	0.11

193	600415	小商品 城	105,273	897,978.69	0.11
194	600061	国投资 本	124,837	888,839.44	0.11
195	603516	淳中科 技	40,140	885,087.00	0.11
196	600918	中泰证 券	128,000	884,480.00	0.11
197	600729	重庆百 货	27,976	879,565.44	0.11
198	600536	中国软 件	18,538	869,061.44	0.11
199	601607	上海医 药	38,695	867,154.95	0.11
200	600161	天坛生 物	31,844	864,564.60	0.11
201	601018	宁波港	252,074	854,530.86	0.11
202	600236	桂冠电 力	153,127	852,917.39	0.11
203	603517	绝味食 品	22,900	850,735.00	0.11
204	601933	永辉超 市	271,417	849,535.21	0.11
205	603290	斯达半 导	3,900	839,280.00	0.10
206	600026	中远海 能	66,000	834,240.00	0.10
207	600460	士兰微	27,200	823,344.00	0.10
208	601838	成都银 行	66,500	811,965.00	0.10
209	603345	安井食 品	5,500	807,400.00	0.10
210	603939	益丰药 房	21,798	806,526.00	0.10
211	601991	大唐发 电	241,541	799,500.71	0.10
212	603160	汇顶科 技	17,204	795,685.00	0.10
213	600362	江西铜 业	41,132	780,685.36	0.10
214	600754	锦江酒 店	18,373	777,912.82	0.10
215	600763	通策医	8,000	774,880.00	0.10

		疗			
216	600079	人福医药	28,596	770,376.24	0.10
217	600377	宁沪高速	78,010	766,838.30	0.09
218	603893	瑞芯微	10,100	735,785.00	0.09
219	601958	金钼股份	64,635	720,680.25	0.09
220	601298	青岛港	102,300	713,031.00	0.09
221	603589	口子窖	14,276	704,520.60	0.09
222	603233	大参林	24,821	695,236.21	0.09
223	600118	中国卫星	24,606	694,135.26	0.09
224	600219	南山铝业	227,549	687,197.98	0.08
225	600737	中粮糖业	84,700	681,835.00	0.08
226	603583	捷昌驱动	31,540	679,371.60	0.08
227	601231	环旭电子	45,378	678,854.88	0.08
228	601555	东吴证券	97,772	678,537.68	0.08
229	601236	红塔证券	90,210	672,064.50	0.08
230	601216	君正集团	163,650	670,965.00	0.08
231	600066	宇通客车	45,399	669,181.26	0.08
232	600183	生益科技	47,053	668,152.60	0.08
233	600642	申能股份	94,880	663,211.20	0.08
234	600511	国药股份	17,020	661,227.00	0.08
235	600705	中航产融	172,256	659,740.48	0.08
236	601878	浙商证券	65,998	652,060.24	0.08
237	600872	中炬高新	17,690	650,815.10	0.08
238	600779	水井坊	11,000	648,890.00	0.08
239	601108	财通证	89,350	646,894.00	0.08

		券			
240	603096	新经典	31,580	642,968.80	0.08
241	603118	共进股份	47,300	628,617.00	0.08
242	603208	江山欧派	17,134	624,020.28	0.08
243	603566	普莱柯	26,800	623,100.00	0.08
244	600383	金地集团	86,400	622,944.00	0.08
245	603000	人民网	21,300	621,960.00	0.08
246	600517	国网英大	108,700	619,590.00	0.08
247	600694	大商股份	34,724	615,656.52	0.08
248	600153	建发股份	56,195	613,087.45	0.08
249	603156	养元饮品	24,800	612,560.00	0.08
250	603868	飞科电器	9,700	611,973.00	0.08
251	600984	建设机械	134,034	605,833.68	0.07
252	600839	四川长虹	119,793	604,954.65	0.07
253	600350	山东高速	94,437	601,563.69	0.07
254	600004	白云机场	41,905	600,917.70	0.07
255	601077	渝农商行	166,678	598,374.02	0.07
256	601966	玲珑轮胎	26,917	598,095.74	0.07
257	600352	浙江龙盛	63,522	593,930.70	0.07
258	600398	海澜之家	85,295	586,829.60	0.07
259	600998	九州通	55,999	581,269.62	0.07
260	603808	歌力思	44,100	579,033.00	0.07
261	600968	海油发展	188,100	577,467.00	0.07
262	600663	陆家嘴	58,202	574,453.74	0.07
263	600177	雅戈尔	89,891	567,212.21	0.07
264	600977	中国电	40,200	564,810.00	0.07

		影			
265	600521	华海药业	30,620	563,714.20	0.07
266	600848	上海临港	47,168	563,657.60	0.07
267	600372	中航电子	36,809	558,760.62	0.07
268	600685	中船防务	18,487	553,685.65	0.07
269	601179	中国西电	100,619	544,348.79	0.07
270	600637	东方明珠	68,969	539,337.58	0.07
271	600808	马钢股份	209,630	538,749.10	0.07
272	603927	中科软	13,840	533,670.40	0.07
273	600578	京能电力	136,411	533,367.01	0.07
274	600967	内蒙一机	52,780	533,078.00	0.07
275	600884	杉杉股份	34,896	528,325.44	0.07
276	601990	南京证券	63,816	522,014.88	0.06
277	600307	酒钢宏兴	332,900	515,995.00	0.06
278	600655	豫园股份	75,141	515,467.26	0.06
279	600109	国金证券	59,170	513,003.90	0.06
280	601158	重庆水务	92,264	512,987.84	0.06
281	603712	七一二	16,800	507,528.00	0.06
282	603355	莱克电气	19,900	505,659.00	0.06
283	600497	驰宏锌锗	100,185	502,928.70	0.06
284	601005	重庆钢铁	359,200	502,880.00	0.06
285	601577	长沙银行	64,500	500,520.00	0.06
286	600380	健康元	39,000	495,690.00	0.06
287	600801	华新水	40,000	494,000.00	0.06

		泥			
288	600871	石化油服	249,200	493,416.00	0.06
289	601233	桐昆股份	37,200	492,900.00	0.06
290	600704	物产中大	99,492	491,490.48	0.06
291	600569	安阳钢铁	246,800	491,132.00	0.06
292	603587	地素时尚	33,100	484,584.00	0.06
293	600498	烽火通信	23,748	483,746.76	0.06
294	601696	中银证券	44,900	478,634.00	0.06
295	603087	甘李药业	12,420	478,170.00	0.06
296	603456	九洲药业	17,400	476,412.00	0.06
297	600100	同方股份	58,422	474,386.64	0.06
298	600369	西南证券	129,478	472,594.70	0.06
299	688002	睿创微纳	10,544	472,371.20	0.06
300	600516	方大炭素	76,010	471,262.00	0.06
301	601615	明阳智能	27,900	470,952.00	0.06
302	601636	旗滨集团	54,500	469,790.00	0.06
303	603228	景旺电子	18,200	466,830.00	0.06
304	601997	贵阳银行	90,400	466,464.00	0.06
305	600699	均胜电子	26,420	466,048.80	0.06
306	600390	五矿资本	86,580	465,800.40	0.06
307	603858	步长制药	22,600	465,334.00	0.06
308	600535	天士力	31,930	463,304.30	0.06
309	600315	上海家	15,801	458,387.01	0.06

		化			
310	601198	东兴证 券	55,398	444,291.96	0.05
311	600688	上海石 化	142,594	443,467.34	0.05
312	600143	金发科 技	50,300	439,119.00	0.05
313	603027	千禾味 业	20,728	437,775.36	0.05
314	600867	通化东 宝	41,647	434,794.68	0.05
315	600988	赤峰黄 金	32,300	434,758.00	0.05
316	603707	健友股 份	32,196	434,646.00	0.05
317	600827	百联股 份	32,385	432,987.45	0.05
318	601106	中国一 重	128,600	432,096.00	0.05
319	600895	张江高 科	31,009	431,645.28	0.05
320	603127	昭衍新 药	10,552	431,576.80	0.05
321	600299	安迪苏	54,000	430,380.00	0.05
322	600909	华安证 券	91,950	429,406.50	0.05
323	600673	东阳光	59,452	428,648.92	0.05
324	600764	中国海 防	15,700	427,354.00	0.05
325	688088	虹软科 技	9,939	424,892.25	0.05
326	600208	新湖中 宝	163,510	405,504.80	0.05
327	603214	爱婴室	24,600	400,242.00	0.05
328	603199	九华旅 游	11,500	397,325.00	0.05
329	603708	家家悦	31,200	391,248.00	0.05
330	600095	湘财股 份	49,800	388,440.00	0.05
331	600819	耀皮玻 璃	79,000	387,890.00	0.05
332	600562	国睿科 技	23,700	383,940.00	0.05

333	601212	白银有色	139,500	379,440.00	0.05
334	600556	天下秀	52,700	373,643.00	0.05
335	601118	海南橡胶	83,287	373,125.76	0.05
336	603883	老百姓	12,438	371,274.30	0.05
337	603638	艾迪精密	17,920	367,718.40	0.05
338	601162	天风证券	122,700	365,646.00	0.05
339	603363	傲农生物	39,560	362,765.20	0.04
340	600733	北汽蓝谷	65,400	351,852.00	0.04
341	601992	金隅集团	160,043	348,893.74	0.04
342	603515	欧普照明	17,103	347,190.90	0.04
343	600449	宁夏建材	22,100	343,876.00	0.04
344	603866	桃李面包	33,978	343,857.36	0.04
345	688029	南微医学科技	4,200	342,552.00	0.04
346	600675	中华企业	115,895	341,890.25	0.04
347	600770	综艺股份	60,500	340,615.00	0.04
348	600956	新天绿能	38,900	339,208.00	0.04
349	601099	太平洋	130,637	337,043.46	0.04
350	600054	黄山旅游	25,900	331,520.00	0.04
351	600297	广汇汽车	155,901	324,274.08	0.04
352	600859	王府井	16,300	322,577.00	0.04
353	603317	天味食品	21,952	320,718.72	0.04
354	603005	晶方科技	15,756	318,271.20	0.04
355	600167	联美控股	45,070	314,137.90	0.04
356	603983	丸美股	9,700	313,795.00	0.04

		份			
357	603839	安正时尚	41,200	309,824.00	0.04
358	603060	国检集团	28,723	300,442.58	0.04
359	601007	金陵饭店	34,760	296,155.20	0.04
360	600928	西安银行	82,500	290,400.00	0.04
361	600667	太极实业	39,900	289,674.00	0.04
362	600126	杭钢股份	66,650	289,261.00	0.04
363	600883	博闻科技	37,600	285,384.00	0.04
364	600211	西藏药业	4,800	285,120.00	0.04
365	601828	美凯龙	59,266	283,884.14	0.04
366	600185	格力地产	40,300	276,458.00	0.03
367	688019	安集科技	1,638	269,991.54	0.03
368	600597	光明乳业	25,896	269,318.40	0.03
369	600138	中青旅	20,942	261,984.42	0.03
370	601778	晶科科技	52,649	260,086.06	0.03
371	603719	良品铺子	9,700	242,597.00	0.03
372	600624	复旦复华	38,000	237,120.00	0.03
373	603579	荣泰健康	11,300	236,396.00	0.03
374	688016	心脉医疗	1,300	233,844.00	0.03
375	600336	澳柯玛	39,682	228,568.32	0.03
376	600881	亚泰集团	105,865	223,375.15	0.03
377	600201	生物股份	23,246	221,069.46	0.03
378	600621	华鑫股份	20,700	220,041.00	0.03
379	600155	华创云	35,300	219,566.00	0.03

		信			
380	600682	南京新百	27,000	216,270.00	0.03
381	601128	常熟银行	30,805	210,090.10	0.03
382	600812	华北制药	32,300	180,557.00	0.02
383	603718	海利生物	14,000	132,020.00	0.02
384	605299	舒华体育	738	9,372.60	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	688361	中科飞测	6,642	539,156.32	0.07
2	688472	阿特斯阳光电力	28,032	510,966.24	0.06
3	688443	智翔金泰	14,124	434,566.38	0.05
4	688458	美芯晟科技	2,206	210,955.41	0.03
5	688562	航天软件股份	7,254	195,390.66	0.02
6	688623	双元科技	1,776	162,256.88	0.02
7	688629	四川华丰科技	7,073	160,957.02	0.02
8	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.02
9	688620	安凯微电子	10,157	135,209.66	0.02
10	688581	安杰思医学	1,062	129,607.16	0.02
11	688523	航天环宇科技	4,717	125,405.25	0.02
12	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
13	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
14	600466	*ST 蓝光	287,400	-	-

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	1,019,597.00	0.13
2	601288	农业银行	983,711.00	0.12
3	601988	中国银行	872,644.00	0.11
4	601857	中国石油	751,144.00	0.10
5	688443	智翔金泰	535,017.12	0.07
6	601628	中国人寿	474,539.00	0.06
7	600036	招商银行	441,322.00	0.06
8	601318	中国平安	352,654.00	0.04
9	600028	中国石化	347,634.00	0.04
10	688472	阿特斯阳光电力	311,155.20	0.04
11	600900	长江电力	296,989.00	0.04
12	601088	中国神华	287,604.00	0.04
13	601939	建设银行	270,417.00	0.03
14	600309	万华化学	236,061.00	0.03
15	688623	双元科技	223,562.88	0.03
16	601916	浙商银行	218,560.96	0.03
17	600276	恒瑞医药	214,301.00	0.03
18	601138	工业富联	212,434.00	0.03
19	601166	兴业银行	207,168.00	0.03
20	601658	邮储银行	200,748.00	0.03

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	600519	贵州茅台	2,322,393.20	0.29
2	601288	农业银行	2,012,687.00	0.25
3	601988	中国银行	1,711,011.00	0.22
4	601857	中国石油	1,446,093.00	0.18
5	600036	招商银行	1,097,494.00	0.14
6	601628	中国人寿	964,865.00	0.12
7	601318	中国平安	740,685.00	0.09
8	600028	中国石化	690,996.00	0.09
9	600900	长江电力	624,094.00	0.08

10	601088	中国神华	594,419.00	0.08
11	601939	建设银行	568,721.00	0.07
12	600309	万华化学	552,790.00	0.07
13	601012	隆基绿能	509,041.00	0.06
14	603288	海天味业	478,634.30	0.06
15	601166	兴业银行	472,919.00	0.06
16	601658	邮储银行	432,236.00	0.05
17	601138	工业富联	416,181.00	0.05
18	600276	恒瑞医药	415,252.00	0.05
19	601888	中国中免	400,359.00	0.05
20	600426	华鲁恒升	400,272.00	0.05

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	22,397,213.05
卖出股票收入（成交）总额	43,606,915.54

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	5,257,701.48	0.65
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	5,257,701.48	0.65

### 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	019694	23 国债 01	52,000	5,257,701.48	0.65

### 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：本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司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	13,272.39
2	应收清算款	285,147.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,481,953.80

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,780,373.71

#### 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	688472	阿特斯阳光电力	47,780.16	0.01	新股流通受限
2	688361	中科飞测	43,005.55	0.01	新股流通受限
3	688443	智翔金泰	41,669.37	0.01	新股流通受限
4	688458	美芯晟科技	20,057.96	0.00	新股流通受限
5	688562	航天软件股份	16,197.06	0.00	新股流通受限

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
汇添	46,629	16,500.31	11,161,857.11	1.45	758,231,115.78	98.55

富上证综合指数 A						
汇添富上证综合指数 C	242	5,993.25	0.00	0.00	1,450,366.15	100.00
合计	46,871	16,446.06	11,161,857.11	1.45	759,681,481.93	98.55

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富上证综合指数 A	59,946.84	0.01
	汇添富上证综合指数 C	939.85	0.06
	合计	60,886.69	0.01

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	汇添富上证综合指数 A	0
	汇添富上证综合指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富上证综合指数 A	0
	汇添富上证综合指数 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富上证综合指数 A	汇添富上证综合指数 C
基金合同生效日 (2009 年 07 月 01 日) 基金份额总额	9,097,758,651.47	-
本报告期期初基金份 额总额	788,438,630.11	-
本报告期基金总申购 份额	129,924,424.52	1,663,044.98
减：本报告期基金总 赎回份额	148,970,081.74	212,678.83
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	769,392,972.89	1,450,366.15

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国海证券	2	19,342,946.48	30.44	13,950.61	30.44	
华泰证券	2	15,041,942.30	23.67	10,849.31	23.68	
国信证券	2	9,608,298.08	15.12	6,930.26	15.12	
东吴证券	1	5,881,785.55	9.26	4,242.43	9.26	
长江证券	1	3,881,511.24	6.11	2,799.53	6.11	
瑞银证券	2	3,835,233.24	6.04	2,766.19	6.04	
申万宏源证券	1	3,318,210.96	5.22	2,393.09	5.22	
中信	1	1,598,435.86	2.52	1,152.90	2.52	

建投 证券						
兴业 证券	1	741,363.56	1.17	534.93	1.17	
中银 国际	1	285,455.44	0.45	205.90	0.45	
长城 证券	2	-	-	-	-	
东北 证券	2	-	-	-	-	
东方 证券	4	-	-	-	-	
东兴 证券	1	-	-	-	-	
广发 证券	1	-	-	-	-	
国泰 君安	1	-	-	-	-	
海通 证券	1	-	-	-	-	
恒泰 证券	2	-	-	-	-	
华西 证券	1	-	-	-	-	
平安 证券	1	-	-	-	-	
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	
信达 证券	1	-	-	-	-	
银河 证券	1	-	-	-	-	
中金 公司	2	-	-	-	-	
中泰 证券	1	-	-	-	-	
中信 证券	2	-	-	-	-	

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 (%)
国海证券	1,198,380.00	23.07	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3,995,720.00	76.93	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰	-	-	-	-	-	-	-	-

君安								
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 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，同一基金管理机构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：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 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
5	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富上证综合指数证券投资基金增设基金份额并修改法律文件的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
6	汇添富上证综合指数证券投资基金 C 类份额开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
7	汇添富上证综合指数证券投资基金更新法律文件	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日