

# 汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 10 月 25 日

§ 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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

|               |                                                                                                          |
|---------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称          | 汇添富中证 1000 指数增强                                                                                          |
| 基金主代码         | 017953                                                                                                   |
| 基金运作方式        | 契约型开放式                                                                                                   |
| 基金合同生效日       | 2023 年 05 月 19 日                                                                                         |
| 报告期末基金份额总额(份) | 319,852,283.40                                                                                           |
| 投资目标          | 本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。                |
| 投资策略          | 本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均 |

|                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                   |
|--------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|
|                    | <p>跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.00%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证的投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转债及可交换债投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略和国债期货投资策略。</p> |                   |
| 业绩比较基准             | 中证 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                   |
| 风险收益特征             | <p>本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                           |                   |
| 基金管理人              | 汇添富基金管理股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                   |
| 基金托管人              | 中国建设银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                   |
| 下属分级基金的基金简称        | 汇添富中证 1000 指数增强 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 汇添富中证 1000 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码        | 017953                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 017954            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 281,723,675.50                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 38,128,607.90     |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

|        |                                          |
|--------|------------------------------------------|
| 主要财务指标 | 报告期(2023 年 07 月 01 日 - 2023 年 09 月 30 日) |
|--------|------------------------------------------|

|                 | 汇添富中证 1000 指数增强<br>A | 汇添富中证 1000 指数增强<br>C |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 880,083.87           | 506,094.05           |
| 2. 本期利润         | -6,461,584.42        | -811,338.37          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0287              | -0.0290              |
| 4. 期末基金资产净值     | 282,842,418.70       | 38,240,793.59        |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0040               | 1.0029               |

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

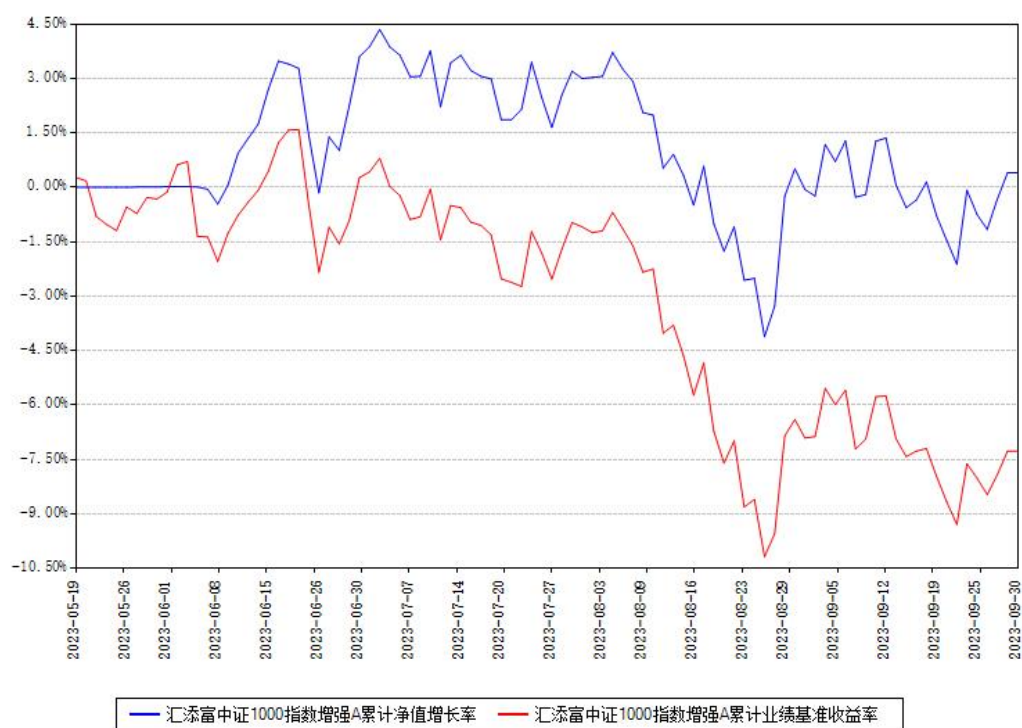
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 汇添富中证 1000 指数增强 A   |              |                     |                    |                           |       |        |
|---------------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 阶段                  | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①—③   | ②—④    |
| 过去三个月               | -3.09%       | 0.92%               | -7.52%             | 0.93%                     | 4.43% | -0.01% |
| 自基金合<br>同生效日<br>起至今 | 0.40%        | 0.86%               | -7.27%             | 0.90%                     | 7.67% | -0.04% |
| 汇添富中证 1000 指数增强 C   |              |                     |                    |                           |       |        |
| 阶段                  | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①—③   | ②—④    |
| 过去三个月               | -3.16%       | 0.92%               | -7.52%             | 0.93%                     | 4.36% | -0.01% |
| 自基金合<br>同生效日<br>起至今 | 0.29%        | 0.86%               | -7.27%             | 0.90%                     | 7.56% | -0.04% |

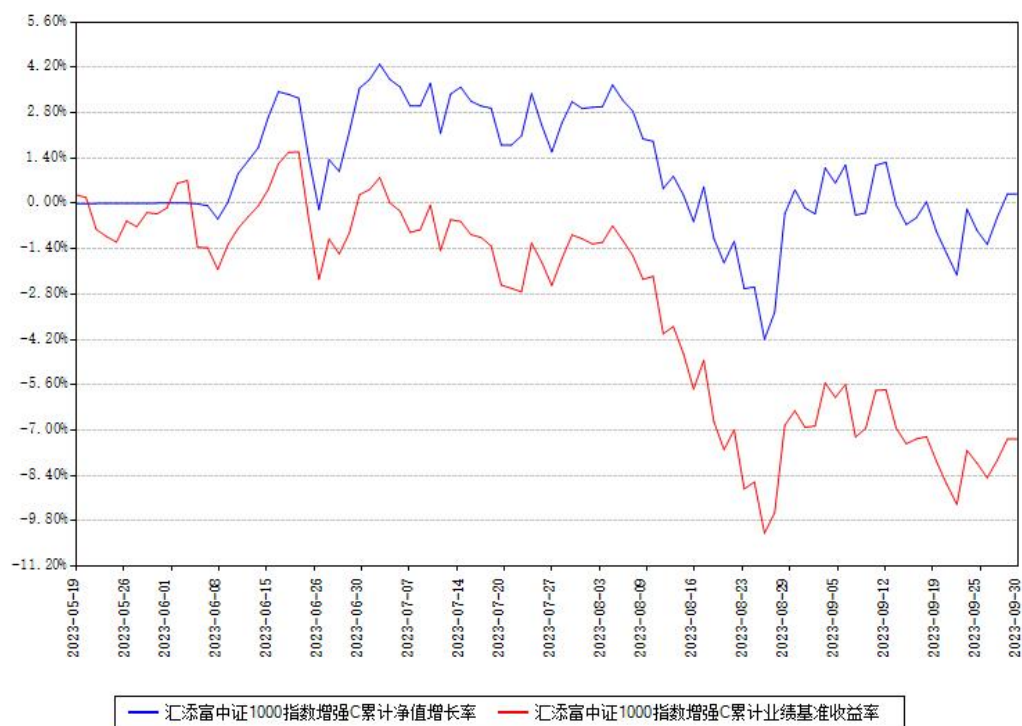
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

## 基准收益率变动的比较

汇添富中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 05 月 19 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

本基金建仓期为自《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限（年） | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----|----------|------------------|------|-----------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          | 任职日期             | 离任日期 |           |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 许一尊 | 本基金的基金经理 | 2023 年 05 月 19 日 | -    | 13        | <p>国籍：中国。</p> <p>学历：上海财经大学经济学硕士。</p> <p>从业资格：证券投资基金从业资格。</p> <p>从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。</p> <p>2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。</p> <p>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。</p> <p>2021 年 12 月 2 日至今任汇添富中证芯片产业</p> |

|     |          |                  |   |   |                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|----------|------------------|---|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |                  |   |   | <p>指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至今任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。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 5 月 19 日至今任汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月 19 日至今任汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> |
| 王星星 | 本基金的基金经理 | 2023 年 06 月 29 日 | - | 8 | <p>国籍：中国。学历：中国人民大学金融工程硕士。</p>                                                                                                                                                                                                                                             |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                             |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>从业资格：<br/>证券投资基金从业资格。<br/>从业经历：<br/>2015 年 8 月至 2023 年 2 月任东方证券股份有限公司证券研究所研究员、高级研究员、高级分析师、业务总监（研究）。<br/>2023 年 2 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。<br/>2023 年 6 月 29 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。</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。

**4.1.1 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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明**

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 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 14 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，中证 1000 指数较大幅度回调，本基金运作平稳，跑赢基准指数。

本基金采用量化指数增强的方式运作，在控制组合相对基准跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。具体操作上，我们采用多因子模型和 AI 量化选股相结合的方式评价个股，在严控组合和基准之间风格和行业偏离的条件下，超配评价较高的个

股、低配评价较低的个股以实现超额收益。个股持仓相对分散，以降低组合对个股的依赖，提升组合超额稳定性，同时对风险事件实时监控，及时剔除风险个股，降低组合尾部风险。

投资管理过程中我们尽量避免对组合持仓的直接干预，将投资观点和思想转化为规则化的量化投资策略，审慎地调整量化策略去间接调整组合持仓，以保证投资管理的可复制性，同时避免情绪波动对组合投资的负面影响。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 1000 指数增强 A 类份额净值增长率为-3.09%，同期业绩比较基准收益率为-7.52%。本报告期汇添富中证 1000 指数增强 C 类份额净值增长率为-3.16%，同期业绩比较基准收益率为-7.52%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 300,410,457.89 | 91.64        |
|    | 其中：股票             | 300,410,457.89 | 91.64        |
| 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      | 21,822,847.39  | 6.66         |
| 8  | 其他资产              | 5,571,610.94   | 1.70         |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 327,804,916.22 | 100.00 |
|---|----|----------------|--------|

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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         | —              | —            |
| B  | 采矿业              | 12,119,080.00  | 3.77         |
| C  | 制造业              | 142,178,948.87 | 44.28        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,359,677.00   | 0.73         |
| E  | 建筑业              | 6,337,522.00   | 1.97         |
| F  | 批发和零售业           | 6,766,429.70   | 2.11         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,822,980.00   | 1.19         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 37,041,202.56  | 11.54        |
| J  | 金融业              | 11,139,453.00  | 3.47         |
| K  | 房地产业             | 10,125,582.32  | 3.15         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,696,642.00   | 1.15         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 5,132,608.00   | 1.60         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 3,959,561.00   | 1.23         |
| 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        | 4,294,685.00   | 1.34         |
| S  | 综合               | —              | —            |
|    | 合计               | 248,974,371.45 | 77.54        |

### 5.2.2 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              | 34,734,833.34 | 10.82 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —             | —     |
| E | 建筑业              | 649,980.00    | 0.20  |
| F | 批发和零售业           | 1,463,088.00  | 0.46  |
| 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  | 3,020,066.00  | 0.94  |
| J | 金融业              | 157.60        | 0.00  |
| K | 房地产业             | 3,784,209.00  | 1.18  |
| L | 租赁和商务服务业         | 701,040.00    | 0.22  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 4,509,389.50  | 1.40  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 1,452,105.00  | 0.45  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | —             | —     |
| P | 教育               | —             | —     |
| Q | 卫生和社会工作          | —             | —     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 1,121,218.00  | 0.35  |
| S | 综合               | —             | —     |
|   | 合计               | 51,436,086.44 | 16.02 |

### 5.2.3 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。

### 5.3 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

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值<br>（元） | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|------|---------|-------------|----------------------|
| 1  | 002456 | 欧菲光  | 357,700 | 2,289,280.0 | 0.71                 |

|    |        |       |         |                  |      |
|----|--------|-------|---------|------------------|------|
|    |        |       |         | 0                |      |
| 2  | 300068 | 南都电源  | 147,400 | 2,112,242.0<br>0 | 0.66 |
| 3  | 300457 | 赢合科技  | 88,100  | 2,049,206.0<br>0 | 0.64 |
| 4  | 300229 | 拓尔思   | 104,200 | 2,022,522.0<br>0 | 0.63 |
| 5  | 000032 | 深桑达 A | 89,400  | 2,000,772.0<br>0 | 0.62 |
| 6  | 000035 | 中国天楹  | 354,100 | 1,986,501.0<br>0 | 0.62 |
| 7  | 000762 | 西藏矿业  | 83,400  | 1,979,082.0<br>0 | 0.62 |
| 8  | 600456 | 宝钛股份  | 58,700  | 1,978,190.0<br>0 | 0.62 |
| 9  | 603588 | 高能环境  | 209,900 | 1,973,060.0<br>0 | 0.61 |
| 10 | 600185 | 格力地产  | 270,101 | 1,960,933.2<br>6 | 0.61 |

### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值<br>（元）      | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|------|---------|------------------|----------------------|
| 1  | 000890 | 法尔胜  | 345,800 | 1,524,978.0<br>0 | 0.47                 |
| 2  | 300691 | 联合光电 | 80,400  | 1,523,580.0<br>0 | 0.47                 |

|   |        |      |         |                  |      |
|---|--------|------|---------|------------------|------|
| 3 | 000962 | 东方钨业 | 118,600 | 1,514,522.0<br>0 | 0.47 |
| 4 | 600215 | 派斯林  | 173,100 | 1,512,894.0<br>0 | 0.47 |
| 5 | 300533 | 冰川网络 | 51,400  | 1,511,674.0<br>0 | 0.47 |

#### 5.4 报告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。

#### 5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资股指期货。

#### 5.10 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,深圳市赢合科技股份有限公司、格力地产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。

##### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 98,489.33    |
| 2  | 应收证券清算款 | 4,946,426.46 |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 526,695.15   |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 5,571,610.94 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告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。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                | 汇添富中证 1000 指数增强<br>A | 汇添富中证 1000 指数增强<br>C |
|-------------------|----------------------|----------------------|
| 本报告期期初基金份额总额      | 86,851,739.79        | 26,707,210.44        |
| 本报告期基金总申购份额       | 228,922,092.79       | 28,425,704.63        |
| 减：本报告期基金总赎回份<br>额 | 34,050,157.08        | 17,004,307.17        |
| 本报告期基金拆分变动份额      | —                    | —                    |
| 本报告期末基金份额总额       | 281,723,675.50       | 38,128,607.90        |

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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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              | 2023 年 7 月 20 日至 2023 年 9 月 30 日 | —    | 97,095,834.55 | —    | 97,095,834.55 | 30.36   |

#### 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、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

##### 3、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。

##### 4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

##### 5、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。



## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 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

### 9.3 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 10 月 25 日