

汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数 证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 03 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。本年度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 2024 年 3 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。

本报告期自 2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 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.....	20
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告的基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§ 7 年度财务报表.....	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	24
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告.....	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
8.6 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.....	81
8.7 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.....	81
8.8 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.....	82
8.9 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.....	82
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
8.12 投资组合报告附注.....	82
§ 9 基金份额持有人信息.....	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	83
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
9.4 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.....	84
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	84
§ 10 开放式基金份额变动.....	84
§ 11 重大事件揭示.....	84
11.1 基金份额持有人大会决议.....	84
11.2 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.....	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
11.4 基金投资策略的改变.....	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
11.8 其他重大事件.....	89
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	91
12.1 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.....	91
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	92
§ 13 备查文件目录.....	92
13.1 备查文件目录.....	92
13.2 存放地点.....	92
13.3 查阅方式.....	92

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证 500 增强策略 ETF
场内简称	500 增
基金主代码	560950
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 07 月 19 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	59,483,000.00
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	2023 年 07 月 31 日

注：扩位证券简称：500ETF 增强。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；股票投资策略；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；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799

电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	12,018,920.70
本期利润	11,136,421.99
加权平均基金份额本期利润	0.0682
本期加权平均净值利润率	6.89%
本期基金份额净值增长率	-4.51%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末
期末可供分配利润	-2,684,521.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0451

期末基金资产净值	56,798,478.65
期末基金份额净值	0.9549
3.1.3 累计期末指标	2023 年末
基金份额累计净值增长率	-4.51%

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。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2023 年 07 月 19 日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2023 年 12 月 31 日数据，特此说明。

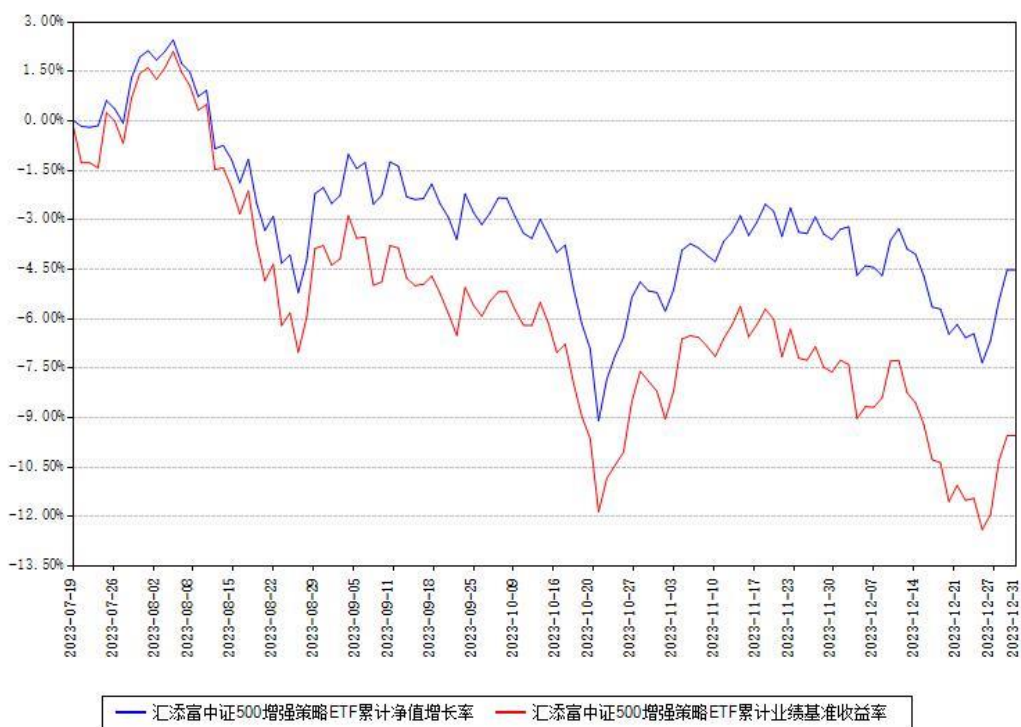
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-2.22%	0.75%	-4.60%	0.86%	2.38%	-0.11%
自基金合同生效日起至今	-4.51%	0.75%	-9.54%	0.87%	5.03%	-0.12%

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

汇添富中证500增强策略ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

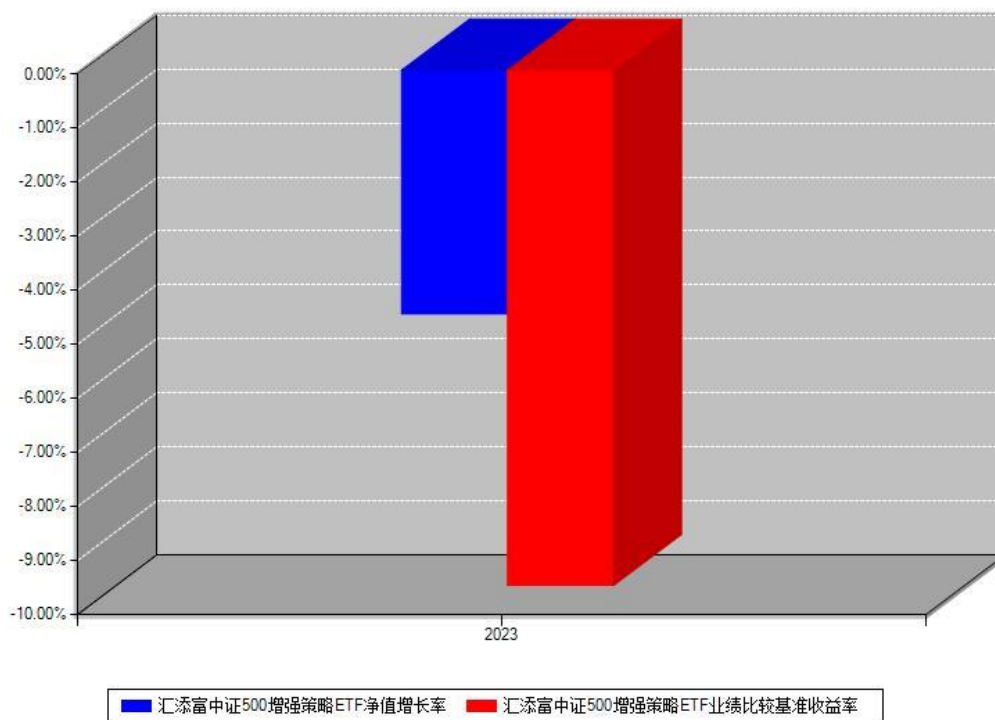


注：本《基金合同》生效之日为2023年07月19日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证500增强策略ETF每年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07月19日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本《基金合同》生效之日为2023年07月19日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

§ 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。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 年，汇添富基金新成立 48 只公募基金，包括 14 只混合型基金，21 只股票型基金，13 只债券型基金。2023 年底，公司公募基金产品总数达 318 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2023 年，汇添富基金坚持以“客户体验”为中心，以“创新”为宗旨，以“服务”为生命力，稳扎稳打实现互联网平台全方位发展。全年大力开拓投顾式销售及服务模式，持续提升自有平台创新能力。全面致力于基于买方视角下的投顾服务转型，提升客户投资的服务体验。通过打通公司投研端和销售端，实现资源共享最大化，为投顾转型提供更加充实的底层能力支持；同时针对客户端，通过投顾专区进行改版升级，优化投顾策略推荐逻辑，融入丰富的投资工具、工具使用场景和丰富的资讯、内容服务，提升客户投资体验，践行公司投顾转型战略目标。

与此同时，积极拥抱第三方互联网基金销售平台，进一步加强与多家互联网巨头的深度合作。围绕客户需求，重构客户中心、资产中心、产品中心、内容中心、活动中心等，全面进行平台运营体系化建设。以开放、转型、服务、共享为目标，搭建以内容中台、营销运营中台、理财师中台、投顾中台等为主要模块的数字中台矩阵。坚持致力于为客户提供全生命周期服务，力争通过金融科技全流程赋能加持，进一步提升客户满意度。

2023 年，汇添富基金继续坚定推进与核心机构客户的合作战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司为机构投资者提供综合解决方案，并深受机构投资者信任。公司不断提升客户服务及产品运营能力，聚焦战略级机构客户，与银行及银行理财公司加快合作，保险规模维持市场领先地位。积极布局多只创新型品种，满足机构投资者专业化需求。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合账户数量持续增加。同时在数字化建设上开展系统平台建设，为客户及团队赋能。

2023 年渠道客户偏好低风险化、渠道运营线上线下一体化趋势愈加明显，公司持续深

化核心渠道战略，始终秉持“客户第一”的价值观，围绕如何提升客户“获得感”，优化客户持有体验开展系列渠道服务和投资者教育工作。积极利用线上化数字营销工具，对客户进行分类经营和分层触达，建立精准的客户画像，提供标准化、体系化、专业化的客户陪伴。积极践行金融科技创新，搭建了一站式投研资讯服务平台，提供紧贴市场的专业投资服务，以及便捷高效的营销辅助工具，赋能渠道客户经理。全年合计开展超 8481 余场“价值投资添富行”线上、线下系列活动。大力开展走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列投资者教育活动，营销培训活动覆盖至各渠道分支机构。

2023 年是券商渠道业务服务深化的一年。为了更好地服务券商渠道客户，公司在 2023 年度组织了超过 2600 场的线上和线下投教、路演活动，主题包括 ETF 大讲堂、走进汇添富、基金经理面对面、投资策略报告会等，覆盖了各重点券商渠道的重点分支机构和营业部，旨在为广大一线投顾赋能的同时，也为广大投资者提供更全面的投资策略交流机会。此外，公司在重点券商渠道积极推广“指能添富”品牌和策略，并结合市场情况，为券商渠道提供相关 ETF 及指数增强产品的配置建议及以客户为中心的解决方案。

2023 年，汇添富基金持续提升客户服务能力，优化客户服务体系，为公司各项业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2023 年，汇添富香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化，并继续发挥显著成效，国际业务总资产管理规模保持稳定。汇添富香港子公司发行汇添富美元货币市场基金，进一步完善海外产品线布局，涵盖境外权益、固收、货币类产品，为投资者全球资产分散化布局进一步打下基础，“汇添富中港策略基金”保持国际权威基金评级机构晨星五星评级。从 2023 年年初开始，继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通，进一步完善个性化客户服务体系，积极引导长期资金入市。

2023 年以来，汇添富积极投身公益慈善，充分发挥公募基金力量，履行社会责任，助力实现“共同富裕”。教育助学方面，连续十五年开展“河流·孩子”公益助学项目，组织党支部开展 9 场公益行活动，约 300 名党员、员工、客户与合作伙伴成为公益志愿者，相继回访了四川美姑、贵州黎平、云南怒江、青海互助、内蒙扎兰屯、宁夏泾源、广西百色、湖北恩施、湖南城步等中西部的添富小学，开展学校调研、梦想课堂、学生走访。在上海成功举办“河流·孩子”十五周年公益音乐会及艺术夏令营，帮助来自大山深处、偏远河畔的孩子们开阔眼界、增长见识、提升素养；举办第十六期“河流·孩子”乡村优秀青年教师培训，

赋能了 80 位乡村优秀青年教师，助力乡村教师掌握先进的教育理念与教学方法。金融慈善方面，积极探索创新公益新模式，在中国基金业协会的指导和支持下，举办第二期、第三期“基业上善”慈善资产管理研修营，三期累计已为 87 家基金会培养了 190 名慈善资产管理专业人才，涵盖的慈善资产规模超过 148 亿元，用专业力量推动我国公益慈善事业的可持续发展。参与中国慈善联合会《慈善组织投资管理指南》团体标准起草，助力慈善资产管理的规范化和高质量发展。爱国拥军方面，携手上海市拥军优属基金会开展“崇敬英雄”公益项目，成为“爱国拥军支持单位”，进一步服务国防建设及拥军优属事业。社区公益方面，携手小东门街道开展南外滩健康直通车项目，参与小东门社区公益发展专项基金，支持本地社区建设，共建更有温度的美好社区。乡村振兴方面，参加云南、青海、内蒙古等地产业、教育和养老助老帮扶等项目，深化东西部协作帮扶，助力乡村振兴。

2024 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基金经理	2023 年 07 月 19 日	-	13	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日

					<p>任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2018年3月23日至今任汇添富沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理。2021年12月2日至今任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022年3月8日至今任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。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</p>
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月 19 日至今任汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 14 日至今任汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。</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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《汇添富基金管

理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 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。

4.3.3 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 45 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

回顾 2023 年, 中国宏观经济整体呈现结构性复苏态势。经济趋势温和回暖, 上半年节后复工复产加快, 出行链持续修复, 工业生产逐步复苏; 下半年宏观调控组合政策发力显效, 局部数据企稳回升, 经济向好的态势得到延续。经济在结构上呈现新旧动能转换态势, 消费和服务业、高端制造等对经济的贡献在上升, 而地产、投资、出口的贡献在下降。政策方向上坚持高质量发展, 宏观调控注重精准, 维持流动性合理充裕, 中央财政加杠杆和提高存量政策有效性等政策思路显现。海外方面, 2023 年前三季度美债收益率和美元指数持续波动

上涨，抑制全球风险资产表现；四季度美债利率见顶下行，美元指数走低，全球风险资产有所提振。

受经济复苏节奏、资金边际流向、投资者预期、人工智能热潮、央企价值重估等因素的影响，全年市场整体震荡下行，行业和风格波动较大，行业板块方面，AI 及中特估相关板块上涨较多，地产链及消费板块跌幅靠前；风格方面，整体仍呈现小盘优于大盘、价值优于成长的特性。量化选股因子方面，质量、低波动、低估值等逆向类因子以及交易类因子仍延续之前的较好表现，与此同时，成长、预期等因子整体表现一般。

报告期内，本基金遵循指数增强基金的投资原则，相对业绩比较基准保持了相对均衡的行业配置和风格配置，在质量、估值、市场面等各类选股因子上保持了相对均衡的暴露，跟踪误差在预期范围内。团队在新因子开发上持续努力，一些创新类因子整体表现出色，对超额收益有所贡献。未来仍需要不断推进对量化选股模型的迭代优化，提升组合精细化管理和对市场风格变动的适应能力。

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-4.51%。同期业绩比较基准收益率为-9.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，高质量发展仍是时代主题，整体宏观经济以稳为主。调控效果预计在新的一年里逐步显现，三大工程相关的财政准财政支撑有望缓解地产的下滑困境，居民消费潜力仍有释放空间，这些因素有利于巩固经济回升态势。同时，随着海外通胀逐步得到控制，外部流动性有望边际宽松；海外地区冲突造成的不确定性逐步被市场消化；AI 等科技创新有望推动产业革新和提升生产力。总体来看，投资面临的不确定性可能会降低。然而，我们也需要看到一些中长期的挑战：内需的提振需要长期信心的修复，居民端预期和企业端投资需求仍在低位，可能需要较长时间的恢复过程；地产链的风险在短期内逐步化解，但长期受城镇化程度、人口结构和出生率等因素影响；外需仍受到压制，海外主要经济体受到加息周期的滞后影响仍面临一定下行压力。从政策预期来看，财政准财政政策可能成为托底经济的主导力量，同时货币政策提供适度的流动性支持，降准降息存在一定空间，总体仍然是稳总量重结构，强调政策的精准有效。总体来说，机遇大于挑战，我们有理由对市场前景相对乐观。

目前 A 股整体估值仍然处于历史低位，具有较高的估值性价比和安全边际，向下空间有限。随着经济复苏和市场信心修复，市场很可能迎来较好的投资机会。在行业方面，科技创新、经济复苏和战略安全相关行业仍可能存在相对长期的投资机会。在风格方面，随着经济增长和外部不确定性的降低，投资者信心有望修复，可能重新拉长“投资久期”，关注公司的

基本面价值，成长和价值、大盘及小盘风格间可能出现一定的再平衡。选股因子表现也有望更为均衡，除了去年表现较好的质量、估值、交易类因子外，基本面趋势相关的成长、盈利、预期类因子也可能出现超额修复。

汇添富中证 500 增强策略 ETF 使用量化选股模型挑选个股，保持风格和行业的相对均衡，具有较鲜明的中盘风格。中证 500 行业均衡，基本面稳健，包含众多细分行业的龙头公司，未来机构市值下沉的趋势仍有可能持续，中小市值风格内部获取超额收益的空间可能仍然可观，给本基金带来较好的投资机会。我们将进一步加大量化模型的研究深度，扩展新技术、新数据在量化投资中的应用，提高信息的发掘和利用效率，提升风险管理和组合精细化管理能力。汇添富中证 500 增强策略 ETF 将继续严格遵守基金合同，追求相对业绩比较基准的较为稳定的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规法务管理

公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的公司价值观，完善合规管理体系，提升专业能力，优化合规资源配置，不断提升合规管理工作的有效性。公司坚持广泛开展合规培训、强化从业人员合规意识，不断夯实公司合规文化体系基础；持续完善公司制度流程体系、优化合规管理制度机制，通过统一的合规审核标准、动态调整的合规管理指引，有效把控各类业务的合规关键点，防范潜在风险，保障各项业务规范开展；深入细致开展合规审查工作，为各部门提供有效的合规咨询与法务支持，督促强化一线合规执行效果；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；优化从业人员管理机制，加强管理措施，严格执行合规考核问责机制，引导全体员工不断提升合规执业意识，强化公司合规履职保障。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品的设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、

分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报告与监督；通过协调并协助监管机构、第三方独立机构开展各项自查、核查以及审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过对各项检查、审计发现的风险隐患的整改情况进行跟踪检查，持续优化内控管理水平，切实维护基金持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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：《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；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。

4.9 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 托管人对本年度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 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2024)审字第 70015647_B296 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 7 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止

	<p>期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 7 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>

	<p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔺育化 韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2024 年 03 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	1,636,036.16
结算备付金		270,571.24
存出保证金		292,034.10

交易性金融资产	7.4.7.2	55,143,041.73
其中：股票投资		55,143,041.73
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		57,341,683.23
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		343,104.79
应付赎回款		-
应付管理人报酬		37,100.24
应付托管费		4,637.52
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	7.4.7.7	158,362.03
负债合计		543,204.58
净资产：		
实收基金	7.4.7.8	59,483,000.00
未分配利润	7.4.7.9	-2,684,521.35
净资产合计		56,798,478.65
负债和净资产总计		57,341,683.23

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9549 元，基金份额总额 59,483,000.00

份。

2、本基金合同于 2023 年 07 月 19 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2023 年 12 月 31 日数据，特此说明。

7.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 07 月 19 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 07 月 19 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		11,900,505.45
1. 利息收入		340,912.57
其中：存款利息收入	7.4.7.10	340,912.57
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,051,693.61
其中：股票投资收益	7.4.7.11	10,722,445.12
基金投资收益	7.4.7.12	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	329,248.49
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）	7.4.7.18	-882,498.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,390,397.98
减：二、营业总支出		764,083.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	554,338.20
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	69,292.26
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	7.4.7.20	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.21	140,453.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,136,421.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,136,421.99
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		11,136,421.99

注：本基金合同于 2023 年 07 月 19 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	961,483,000.00	-	961,483,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-902,000,000.00	-2,684,521.35	-904,684,521.35
（一）、综合收益总额	-	11,136,421.99	11,136,421.99
（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）	-902,000,000.00	-13,820,943.34	-915,820,943.34
其中：1. 基金申购款	36,000,000.00	-1,650,341.92	34,349,658.08
2. 基金赎回款	-938,000,000.00	-12,170,601.42	-950,170,601.42
（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	59,483,000.00	-2,684,521.35	56,798,478.65

注：本基金合同于 2023 年 07 月 19 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 增强策略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[2022]2598 号文《关于准予汇添富中证 500 增强策略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。基金合同于 2023 年 7 月 19 日生效。首次设立基金募集规模为 961,483,000.00 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（2023）验字第 60466941_B35 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的标的指数为中证 500 指数及其未来可能发生的变更。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基

金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金为股票型指数增强基金,在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,进行积极的组合管理和风险控制,力求实现超越标的指数的业绩表现,追求基金资产的长期增值。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 07 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 07 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金

流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察

输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能

按期归还产生的罚息,实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入;

(8)其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则,在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配采用现金分红;

3、每一基金份额享有同等分配权;

4、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;

5、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人经与基金托管人协商一致可对基金收益分配原则进行调整,无需召开基金份额持有人大会,但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;根据财政部、税务总局公告 2023 年第

39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

2. 增值税

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

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修

订)》及相关地方教育附加的征收规定,凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人,都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

4. 企业所得税

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

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
	2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,636,036.16
等于：本金	1,635,819.87
加：应计利息	216.29
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	1,636,036.16

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	56,025,540.44	-	55,143,041.73	-882,498.71
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	56,025,540.44	-	55,143,041.73	-882,498.71

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

7.4.7.5.2 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。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	18,362.03
其中：交易所市场	18,362.03
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	70,000.00
应付信息披露费	70,000.00
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
其他	-
合计	158,362.03

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	961,483,000.00	961,483,000.00
本期申购	36,000,000.00	36,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-938,000,000.00	-938,000,000.00
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	59,483,000.00	59,483,000.00

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

2、本基金合同于 2023 年 07 月 19 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 961,483,000.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 0.00 元，以上实收基金（本息）合计人民币 961,483,000.00 元，折合 961,483,000.00 份人民币基金份额。

7.4.7.9 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	12,018,920.70	-882,498.71	11,136,421.99
本期基金份额交易产生的变动数	-12,859,002.29	-961,941.05	-13,820,943.34
其中：基金申购款	186,961.59	-1,837,303.51	-1,650,341.92
基金赎回款	-13,045,963.88	875,362.46	-12,170,601.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-840,081.59	-1,844,439.76	-2,684,521.35

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	233,788.74
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	105,264.81
其他	1,859.02
合计	340,912.57

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,237,808.06
股票投资收益——赎回差价收入	7,484,637.06
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	10,722,445.12

7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	655,220,917.07
减：卖出股票成本总额	650,207,598.51
减：交易费用	1,775,510.50
买卖股票差价收入	3,237,808.06

7.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	950,170,601.42
减：现金支付赎回款总额	533,239,192.42
减：赎回股票成本总额	409,446,771.94

减：交易费用	-
赎回差价收入	7,484,637.06

7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 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。

7.4.7.16.2 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。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年07月19日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	329,248.49
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	329,248.49

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	
	2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
1. 交易性金融资产		-882,498.71
——股票投资		-882,498.71
——债券投资		-
——资产支持证券投资		-
——基金投资		-
——贵金属投资		-
——其他		-
2. 衍生工具		-
——权证投资		-
——期货投资		-
3. 其他		-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税		-
合计		-882,498.71

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
基金赎回费收入		-
替代损益		1,390,397.98
其他		-
合计		1,390,397.98

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
审计费用		70,000.00
信息披露费		70,000.00
证券出借违约金		-
账户维护费		-
银行费用		53.00
指数使用费		-

持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	400.00
上市费	-
或有管理费	-
其他	-
合计	140,453.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	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
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (新加坡) 有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	1,212,686,387.55	69.09

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 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 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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	877,532.27	83.36	5,494.44	29.92

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	554,338.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,179.94
应支付基金管理人的净管理费	551,158.26

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	69,292.26

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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：本基金本报告期末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。

7.4.10.4.2 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：本基金本报告期末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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

7.4.10.6 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 07 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,636,036.16	233,788.74

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个 月- 1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,636,036.16	-	-	-	-	-	1,636,036.16
结算备付金	270,571.24	-	-	-	-	-	270,571.24
存出保证金	292,034.10	-	-	-	-	-	292,034.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,143,041.73	55,143,041.73
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	2,198,641.50	-	-	-	-	55,143,041.73	57,341,683.23

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	-	-	-	-	-	343,104.79	343,104.79
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,100.24	37,100.24
应付托管费	-	-	-	-	-	4,637.52	4,637.52
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	-	-	-	-	-	158,362.03	158,362.03
负债总计	-	-	-	-	-	543,204.58	543,204.58
利率敏感度缺口	2,198,641.50	-	-	-	-	54,599,837.15	56,798,478.65

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	55,143,041.73	97.09
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	55,143,041.73	97.09

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日
	中证 500 指数上涨 5%	2, 375, 362. 23
	中证 500 指数下跌 5%	-2, 375, 362. 23

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	55, 143, 041. 73
第二层次	-
第三层次	-
合计	55, 143, 041. 73

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.4 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。

7.4.14.5 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。

7.4.15 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“4.9 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	55,143,041.73	96.17
	其中：股票	55,143,041.73	96.17
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	1,906,607.40	3.32
8	其他各项资产	292,034.10	0.51
9	合计	57,341,683.23	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	266,357.50	0.47
B	采矿业	1,711,479.50	3.01
C	制造业	29,624,534.17	52.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,354,644.70	2.39
E	建筑业	207,303.00	0.36
F	批发和零售业	1,835,247.80	3.23
G	交通运输、仓储和邮政业	1,375,636.00	2.42
H	住宿和餐饮业	9,372.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,384,721.39	4.20
J	金融业	4,390,956.68	7.73
K	房地产业	732,608.00	1.29
L	租赁和商务服务业	236,874.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	413,440.00	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	329,139.00	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	57,528.00	0.10
Q	卫生和社会工作	372,172.40	0.66
R	文化、体育和娱乐业	634,918.87	1.12
S	综合	466,566.00	0.82
	合计	46,403,499.01	81.70

8.2.2 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	8,104,916.00	14.27

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	312,642.00	0.55
E	建筑业	109,277.00	0.19
F	批发和零售业	16,573.72	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	18,169.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,772.00	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,491.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	73,339.00	0.13
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	70,235.00	0.12
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,128.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	8,739,542.72	15.39

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	601058	赛轮轮胎	34,000	399,500.00	0.70
2	000933	神火股份	23,300	391,440.00	0.69
3	601233	桐昆股份	25,600	387,328.00	0.68
4	600885	宏发股份	13,400	370,376.00	0.65
5	000009	中国宝安	31,500	369,810.00	0.65
6	300296	利亚德	60,800	364,800.00	0.64

7	002185	华天科技	41,900	356,988.00	0.63
8	002138	顺络电子	13,100	353,831.00	0.62
9	300012	华测检测	24,300	345,060.00	0.61
10	000932	华菱钢铁	66,300	341,445.00	0.60
11	000783	长江证券	62,900	338,402.00	0.60
12	002532	天山铝业	55,500	333,555.00	0.59
13	600839	四川长虹	62,700	331,683.00	0.58
14	002600	领益智造	48,700	329,212.00	0.58
15	300285	国瓷材料	13,900	321,368.00	0.57
16	600497	驰宏锌锗	62,200	314,110.00	0.55
17	600066	宇通客车	23,500	311,375.00	0.55
18	002673	西部证券	48,800	310,856.00	0.55
19	601577	长沙银行	44,300	302,126.00	0.53
20	600879	航天电子	38,800	299,148.00	0.53
21	300001	特锐德	14,800	297,480.00	0.52
22	600161	天坛生物	9,400	290,836.00	0.51
23	600060	海信视像	13,900	290,510.00	0.51
24	002422	科伦药业	9,900	287,595.00	0.51
25	601966	玲珑轮胎	14,900	286,527.00	0.50
26	002065	东华软件	46,200	285,054.00	0.50
27	000623	吉林敖东	18,700	283,118.00	0.50
28	002028	思源电气	5,400	281,016.00	0.49

29	002152	广电运通	22,900	280,754.00	0.49
30	000050	深天马 A	26,178	278,795.70	0.49
31	000738	航发控制	14,000	278,600.00	0.49
32	601717	郑煤机	21,900	277,035.00	0.49
33	600637	东方明珠	36,774	276,540.48	0.49
34	002064	华峰化学	41,100	275,781.00	0.49
35	002373	千方科技	24,600	275,766.00	0.49
36	000636	风华高科	20,100	274,566.00	0.48
37	600390	五矿资本	58,000	271,440.00	0.48
38	002092	中泰化学	44,100	269,010.00	0.47
39	601216	君正集团	71,900	268,906.00	0.47
40	002056	横店东磁	19,800	268,092.00	0.47
41	002128	电投能源	18,700	266,849.00	0.47
42	300009	安科生物	25,900	264,698.00	0.47
43	603156	养元饮品	12,400	263,624.00	0.46
44	300682	朗新科技	16,069	263,370.91	0.46
45	600498	烽火通信	15,800	262,912.00	0.46
46	600739	辽宁成大	22,300	262,694.00	0.46
47	600380	健康元	21,100	262,273.00	0.46
48	000039	中集集团	34,200	261,630.00	0.46
49	002500	山西证券	48,500	261,415.00	0.46
50	002463	沪电股份	11,800	261,016.00	0.46
51	000060	中金岭	60,300	260,496.00	0.46

		南			
52	000830	鲁西化工	25,900	259,777.00	0.46
53	000729	燕京啤酒	30,100	259,763.00	0.46
54	600352	浙江龙盛	30,900	259,560.00	0.46
55	000513	丽珠集团	7,400	259,074.00	0.46
56	600580	卧龙电驱	22,000	258,060.00	0.45
57	300088	长信科技	38,400	256,896.00	0.45
58	601555	东吴证券	35,000	255,850.00	0.45
59	600282	南钢股份	68,500	253,450.00	0.45
60	603233	大参林	10,146	252,635.40	0.44
61	601231	环旭电子	16,700	252,337.00	0.44
62	002019	亿帆医药	16,900	249,782.00	0.44
63	600867	通化东宝	23,000	249,090.00	0.44
64	002683	广东宏大	12,400	248,992.00	0.44
65	600418	江淮汽车	15,300	247,095.00	0.44
66	000887	中鼎股份	19,900	246,163.00	0.43
67	600511	国药股份	8,600	246,132.00	0.43
68	601000	唐山港	69,820	244,370.00	0.43
69	600582	天地科技	44,500	242,080.00	0.43
70	601958	金钼股份	25,600	241,920.00	0.43
71	002557	洽洽食品	6,900	240,258.00	0.42
72	002653	海思科	10,300	238,445.00	0.42
73	600737	中粮糖业	28,900	238,136.00	0.42
74	601168	西部矿	16,600	236,882.00	0.42

		业			
75	002153	石基信息	24,200	235,708.00	0.41
76	600528	中铁工业	31,500	234,360.00	0.41
77	600765	中航重机	12,200	233,142.00	0.41
78	002690	美亚光电	11,846	232,655.44	0.41
79	600126	杭钢股份	43,600	232,388.00	0.41
80	600177	雅戈尔	35,368	231,660.40	0.41
81	600079	人福医药	9,300	231,198.00	0.41
82	600827	百联股份	24,300	230,607.00	0.41
83	000581	威孚高科	15,300	230,571.00	0.41
84	002025	航天电器	4,800	230,496.00	0.41
85	603228	景旺电子	10,200	230,112.00	0.41
86	000987	越秀资本	38,200	229,964.00	0.40
87	600967	内蒙一机	27,300	225,498.00	0.40
88	600801	华新水泥	18,100	224,983.00	0.40
89	601608	中信重工	57,100	220,406.00	0.39
90	002010	传化智联	47,700	220,374.00	0.39
91	601077	渝农商行	54,000	220,320.00	0.39
92	002925	盈趣科技	11,200	218,064.00	0.38
93	000559	万向钱潮	42,000	217,980.00	0.38
94	000630	铜陵有色	66,400	217,792.00	0.38
95	000401	冀东水泥	33,700	215,343.00	0.38
96	002423	中粮资	32,200	215,096.00	0.38

		本			
97	600848	上海临港	21,200	213,060.00	0.38
98	600663	陆家嘴	24,200	211,750.00	0.37
99	002966	苏州银行	32,600	210,596.00	0.37
100	300244	迪安诊断	8,740	208,099.40	0.37
101	688772	珠海冠宇电池	9,400	206,894.00	0.36
102	000959	首钢股份	58,940	203,932.40	0.36
103	002563	森马服饰	35,200	203,104.00	0.36
104	000423	东阿阿胶	4,100	202,212.00	0.36
105	002608	江苏国信	30,500	200,385.00	0.35
106	600655	豫园股份	32,100	199,341.00	0.35
107	000539	粤电力 A	40,400	197,556.00	0.35
108	001914	招商积余	16,400	196,144.00	0.35
109	601298	青岛港	31,700	195,906.00	0.34
110	600160	巨化股份	11,834	195,142.66	0.34
111	600906	财达证券	25,800	193,500.00	0.34
112	000089	深圳机场	29,900	192,257.00	0.34
113	600109	国金证券	21,101	191,597.08	0.34
114	601139	深圳燃气	27,800	191,542.00	0.34
115	000883	湖北能源	45,200	191,196.00	0.34
116	002511	中顺洁柔	19,100	191,000.00	0.34
117	601098	中南传媒	18,600	189,162.00	0.33
118	000156	华数传媒	25,600	188,672.00	0.33

119	002384	东山精密	10,200	185,436.00	0.33
120	000778	新兴铸管	47,700	182,214.00	0.32
121	000967	盈峰环境	38,100	180,975.00	0.32
122	300017	网宿科技	22,500	176,625.00	0.31
123	600096	云天化	11,300	176,280.00	0.31
124	002439	启明星辰	6,500	175,500.00	0.31
125	002385	大北农	28,100	167,476.00	0.29
126	002294	信立泰	5,100	166,566.00	0.29
127	002273	水晶光电	12,300	166,542.00	0.29
128	002044	美年健康	27,300	164,073.00	0.29
129	600862	中航高科	7,400	163,910.00	0.29
130	002414	高德红外	22,400	163,520.00	0.29
131	603707	健友股份	10,600	159,000.00	0.28
132	001872	招商港口	9,900	158,004.00	0.28
133	688006	浙江杭可科技	6,700	157,316.00	0.28
134	000728	国元证券	22,900	156,407.00	0.28
135	300146	汤臣倍健	9,000	153,270.00	0.27
136	601128	常熟银行	23,900	152,721.00	0.27
137	300037	新宙邦	3,200	151,360.00	0.27
138	002739	万达电影	11,500	149,730.00	0.26
139	688208	道通科技	6,200	147,250.00	0.26
140	002195	岩山科技	47,500	145,825.00	0.26
141	002399	海普瑞	12,400	145,452.00	0.26
142	600315	上海家化	6,800	144,024.00	0.25

143	600873	梅花生物	14,800	141,340.00	0.25
144	600369	西南证券	34,300	140,287.00	0.25
145	603939	益丰药房	3,500	140,140.00	0.25
146	002409	雅克科技	2,500	139,325.00	0.25
147	600549	厦门钨业	8,101	139,175.18	0.25
148	600985	淮北矿业	8,350	138,860.50	0.24
149	600482	中国动力	7,700	138,677.00	0.24
150	600642	申能股份	21,400	137,388.00	0.24
151	002926	华西证券	17,700	137,352.00	0.24
152	000997	新大陆	7,000	137,270.00	0.24
153	002595	豪迈科技	4,600	136,942.00	0.24
154	000400	许继电气	6,100	133,956.00	0.24
155	600166	福田汽车	48,800	133,224.00	0.23
156	000021	深科技	8,200	132,922.00	0.23
157	300699	光威复材	4,960	132,283.20	0.23
158	000878	云南铜业	12,100	131,769.00	0.23
159	603355	莱克电气	5,900	131,570.00	0.23
160	300024	机器人	10,900	129,383.00	0.23
161	601997	贵阳银行	25,040	128,705.60	0.23
162	688819	天能电池集团股份	4,600	128,432.00	0.23
163	002299	圣农发展	7,400	127,132.00	0.22
164	603712	七一二	4,000	126,040.00	0.22
165	603816	顾家家	3,600	126,000.00	0.22

		居			
166	000960	锡业股份	8,700	124,584.00	0.22
167	002078	太阳纸业	10,200	124,134.00	0.22
168	000683	远兴能源	20,900	122,683.00	0.22
169	300383	光环新网	12,600	122,472.00	0.22
170	600299	安迪苏	15,300	122,400.00	0.22
171	600704	物产中大	26,900	119,167.00	0.21
172	603885	吉祥航空	9,900	118,800.00	0.21
173	300558	贝达药业	2,300	118,565.00	0.21
174	600271	航天信息	11,100	118,104.00	0.21
175	002203	海亮股份	10,500	117,075.00	0.21
176	688002	睿创微纳	2,600	114,972.00	0.20
177	600521	华海药业	7,800	114,426.00	0.20
178	603658	安图生物	2,000	114,020.00	0.20
179	600517	国网英大	23,600	112,572.00	0.20
180	600398	海澜之家	14,900	110,558.00	0.19
181	600350	山东高速	15,500	107,570.00	0.19
182	002429	兆驰股份	19,200	107,136.00	0.19
183	601611	中国核建	15,400	106,722.00	0.19
184	002465	海格通信	8,300	106,655.00	0.19
185	300595	欧普康视	4,700	106,126.00	0.19
186	300118	东方日升	6,000	105,900.00	0.19
187	002507	涪陵榨	7,290	104,174.10	0.18

		菜			
188	601108	财通证 券	13,300	103,208.00	0.18
189	000998	隆平高 科	7,200	101,520.00	0.18
190	600566	济川药 业	3,200	100,576.00	0.18
191	000893	亚钾国 际	3,800	99,712.00	0.18
192	600004	白云机 场	10,100	98,778.00	0.17
193	300253	卫宁健 康	13,700	98,503.00	0.17
194	000519	中兵红 箭	7,000	98,280.00	0.17
195	002508	老板电 器	4,500	98,010.00	0.17
196	688567	孚能科 技	6,000	97,860.00	0.17
197	600673	东阳光	13,200	96,756.00	0.17
198	603927	中科软	3,200	95,936.00	0.17
199	601568	北元集 团	20,200	95,748.00	0.17
200	002080	中材科 技	6,000	95,520.00	0.17
201	600927	永安期 货	6,000	94,260.00	0.17
202	000547	航天发 展	11,200	93,744.00	0.17
203	600546	山煤国 际	5,300	92,803.00	0.16
204	603225	新凤鸣	6,500	92,300.00	0.16
205	688538	和辉光 电	37,300	90,639.00	0.16
206	000598	兴蓉环 境	15,900	90,471.00	0.16
207	601179	中国西 电	18,200	89,726.00	0.16
208	600970	中材国 际	9,600	89,664.00	0.16
209	601933	永辉超 市	31,700	89,394.00	0.16
210	002120	韵达股	11,400	85,044.00	0.15

		份			
211	600583	海油工程	14,300	84,942.00	0.15
212	300373	扬杰科技	2,300	84,410.00	0.15
213	600707	彩虹股份	12,500	84,375.00	0.15
214	600032	浙江新能	10,400	83,824.00	0.15
215	600062	华润双鹤	4,500	83,700.00	0.15
216	000970	中科三环	8,000	82,800.00	0.15
217	600959	江苏有线	26,300	82,582.00	0.15
218	300357	我武生物	2,800	81,200.00	0.14
219	002408	齐翔腾达	15,000	79,200.00	0.14
220	000739	普洛药业	5,100	78,489.00	0.14
221	603883	老百姓	2,600	77,714.00	0.14
222	600901	江苏金租	16,000	77,440.00	0.14
223	601991	大唐发电	31,900	77,198.00	0.14
224	603737	三棵树	1,600	76,176.00	0.13
225	002244	滨江集团	10,400	75,608.00	0.13
226	002266	浙富控股	22,150	75,310.00	0.13
227	603456	九洲药业	3,100	75,051.00	0.13
228	601666	平煤股份	6,400	73,984.00	0.13
229	600377	宁沪高速	7,200	73,800.00	0.13
230	600056	中国医药	6,600	73,722.00	0.13
231	002572	索菲亚	4,600	73,370.00	0.13
232	000825	太钢不锈	19,600	73,108.00	0.13
233	300070	碧水源	14,600	72,854.00	0.13

234	002223	鱼跃医疗	2,100	72,618.00	0.13
235	601598	中国外运	13,200	69,168.00	0.12
236	600516	方大炭素	13,100	68,644.00	0.12
237	003035	南网能源	13,000	68,380.00	0.12
238	600399	抚顺特钢	7,000	68,040.00	0.12
239	601665	齐鲁银行	17,300	67,643.00	0.12
240	003022	联泓新科	3,500	64,085.00	0.11
241	000563	陕国投 A	20,600	62,624.00	0.11
242	002867	周大生	4,100	62,238.00	0.11
243	000703	恒逸石化	9,075	60,984.00	0.11
244	603026	胜华新材	1,300	59,618.00	0.10
245	600167	联美控股	10,500	59,535.00	0.10
246	002850	科达利	700	59,122.00	0.10
247	601928	凤凰传媒	6,700	59,027.00	0.10
248	601187	厦门银行	11,500	58,305.00	0.10
249	002607	中公教育	14,100	57,528.00	0.10
250	000629	钒钛股份	17,300	56,744.00	0.10
251	000958	电投产融	14,100	55,554.00	0.10
252	688276	长春百克生物科技	1,000	54,810.00	0.10
253	000930	中粮科技	8,200	54,448.00	0.10
254	603218	日月股份	4,400	54,428.00	0.10
255	603866	桃李面包	7,000	53,620.00	0.09

256	000988	华工科技	1,800	53,568.00	0.09
257	600481	双良节能	6,100	51,606.00	0.09
258	002281	光迅科技	1,800	51,300.00	0.09
259	600968	海油发展	17,800	50,730.00	0.09
260	600597	光明乳业	5,800	50,634.00	0.09
261	688331	荣昌生物	800	49,648.00	0.09
262	600535	天士力	2,700	45,954.00	0.08
263	601158	重庆水务	7,700	43,659.00	0.08
264	300144	宋城演艺	4,401	43,437.87	0.08
265	002353	杰瑞股份	1,519	42,699.09	0.08
266	600998	九州通	5,840	40,938.40	0.07
267	002444	巨星科技	1,800	40,536.00	0.07
268	600598	北大荒	3,150	37,705.50	0.07
269	000975	银泰黄金	2,500	37,500.00	0.07
270	603317	天味食品	2,800	37,212.00	0.07
271	002468	申通快递	4,100	31,939.00	0.06
272	000553	安道麦 A	4,000	27,760.00	0.05
273	600329	达仁堂	800	26,920.00	0.05
274	300395	菲利华	700	25,592.00	0.05
275	688690	纳微科技	900	24,678.00	0.04
276	600021	上海电力	2,900	24,534.00	0.04
277	600909	华安证券	3,800	18,544.00	0.03
278	000027	深圳能源	2,800	18,060.00	0.03
279	600863	内蒙华电	4,400	17,160.00	0.03
280	000785	居然之家	5,000	16,500.00	0.03

		家			
281	002939	长城证 券	2,000	16,000.00	0.03
282	600325	华发股 份	2,100	15,141.00	0.03
283	000591	太阳能	2,500	13,950.00	0.02
284	000031	大悦城	4,500	13,365.00	0.02
285	603858	步长制 药	700	11,907.00	0.02
286	600348	华阳股 份	1,200	11,712.00	0.02
287	600131	国网信 通	700	10,605.00	0.02
288	603379	三美股 份	300	10,200.00	0.02
289	600500	中化国 际	2,300	10,166.00	0.02
290	600258	首旅酒 店	600	9,372.00	0.02
291	002008	大族激 光	400	8,288.00	0.01
292	000066	中国长 城	700	7,084.00	0.01
293	002340	格林美	1,200	6,552.00	0.01
294	600153	建发股 份	600	5,778.00	0.01
295	600170	上海建 工	2,450	5,733.00	0.01
296	000898	鞍钢股 份	2,200	5,478.00	0.01
297	600820	隧道股 份	900	5,184.00	0.01
298	000937	冀中能 源	700	4,998.00	0.01
299	300251	光线传 媒	600	4,890.00	0.01
300	600956	新天绿 能	600	4,878.00	0.01
301	000402	金融 街	1,300	4,719.00	0.01
302	000750	国海证 券	1,300	4,602.00	0.01
303	600755	厦门国	600	4,182.00	0.01

		贸			
304	300604	长川科技	100	3,799.00	0.01
305	600008	首创环保	1,230	3,308.70	0.01
306	002131	利欧股份	1,300	2,964.00	0.01
307	600208	新潮中宝	1,300	2,821.00	0.00
308	601162	天风证券	700	2,163.00	0.00
309	002936	郑州银行	700	1,407.00	0.00
310	600435	北方导航	100	1,174.00	0.00

8.3.2 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	300743	天地数码	12,700	176,276.00	0.31
2	603320	迪贝电气	11,000	175,010.00	0.31
3	300808	久量股份	11,200	174,496.00	0.31
4	300701	森霸传感	14,900	171,052.00	0.30
5	300279	和晶科技	25,900	167,573.00	0.30
6	002073	软控股份	25,400	166,878.00	0.29
7	000589	贵州轮胎	27,200	166,464.00	0.29
8	603586	金麒麟	10,300	164,800.00	0.29
9	300076	GQY 视讯	29,800	162,708.00	0.29
10	603331	百达精工	12,100	158,510.00	0.28
11	600101	明星电力	18,700	157,267.00	0.28
12	300543	朗科智能	14,400	157,248.00	0.28
13	300246	宝莱特	15,200	156,560.00	0.28
14	300562	乐心医疗	13,600	155,176.00	0.27
15	605208	永茂泰	15,800	150,100.00	0.26
16	600623	华谊集团	22,500	144,900.00	0.26
17	300615	欣天科技	8,900	140,709.00	0.25
18	300154	瑞凌股份	18,800	139,120.00	0.24
19	300407	凯发电气	14,700	138,768.00	0.24

20	300018	中元股份	22,600	138,086.00	0.24
21	002863	今飞凯达	22,200	137,862.00	0.24
22	600469	风神股份	21,800	134,506.00	0.24
23	300439	美康生物	11,300	131,193.00	0.23
24	300424	航新科技	9,900	129,690.00	0.23
25	300120	经纬辉开	17,400	126,324.00	0.22
26	002730	电光科技	13,300	126,084.00	0.22
27	603933	睿能科技	7,800	121,290.00	0.21
28	300306	远方信息	9,900	119,592.00	0.21
29	002394	联发股份	14,200	118,002.00	0.21
30	300447	全信股份	8,000	116,000.00	0.20
31	300884	狄耐克	8,500	111,180.00	0.20
32	300611	美力科技	9,600	110,304.00	0.19
33	002367	康力电梯	14,300	107,536.00	0.19
34	002817	黄山胶囊	11,800	103,368.00	0.18
35	002381	双箭股份	13,400	101,572.00	0.18
36	002909	集泰股份	13,300	101,479.00	0.18
37	600802	福建水泥	19,500	101,010.00	0.18
38	002815	崇达技术	10,200	97,716.00	0.17
39	300243	瑞丰高材	9,700	94,769.00	0.17
40	002365	永安药业	9,200	89,976.00	0.16
41	300621	维业股份	7,800	89,622.00	0.16
42	603333	尚纬股份	15,600	89,076.00	0.16
43	002090	金智科技	8,700	86,826.00	0.15
44	603683	晶华新材	7,500	84,450.00	0.15
45	300708	聚灿光电	7,000	78,960.00	0.14
46	002724	海洋王	9,400	77,268.00	0.14
47	002842	翔鹭钨业	8,800	76,736.00	0.14
48	605058	澳弘电子	3,300	75,603.00	0.13
49	002674	兴业科技	6,200	75,454.00	0.13
50	002879	长缆科技	4,700	75,294.00	0.13
51	300800	力合科技	5,500	75,185.00	0.13
52	605169	洪通燃气	6,600	74,778.00	0.13
53	002857	三晖电气	4,500	74,250.00	0.13
54	300673	佩蒂股份	5,500	73,150.00	0.13
55	300838	浙江力诺	4,400	71,984.00	0.13
56	600746	江苏索普	9,600	70,272.00	0.12
57	300736	百邦科技	5,500	70,235.00	0.12
58	603017	中衡设计	7,000	70,070.00	0.12
59	601956	东贝集团	11,700	69,849.00	0.12
60	603706	东方环宇	4,200	69,426.00	0.12
61	300843	胜蓝股份	3,000	68,940.00	0.12
62	300717	华信新材	4,100	68,839.00	0.12

63	300960	通业科技	3,100	68,758.00	0.12
64	300412	迦南科技	11,900	67,711.00	0.12
65	603700	宁水集团	4,700	67,069.00	0.12
66	603838	四通股份	9,300	66,960.00	0.12
67	300535	达威股份	3,800	66,538.00	0.12
68	603339	四方科技	5,500	65,395.00	0.12
69	603500	祥和实业	5,200	63,700.00	0.11
70	603303	得邦照明	4,900	62,965.00	0.11
71	603798	康普顿	6,500	62,855.00	0.11
72	003018	金富科技	5,900	62,835.00	0.11
73	300016	北陆药业	8,300	59,096.00	0.10
74	300358	楚天科技	5,500	58,850.00	0.10
75	300907	康平科技	2,600	57,694.00	0.10
76	603790	雅运股份	4,100	57,441.00	0.10
77	300414	中光防雷	5,900	56,817.00	0.10
78	002297	博云新材	6,200	49,414.00	0.09
79	603390	通达电气	4,300	43,215.00	0.08
80	603937	丽岛新材	3,200	40,544.00	0.07
81	603041	美思德	2,300	30,958.00	0.05
82	603012	创力集团	5,000	29,550.00	0.05
83	300753	爱朋医疗	1,700	29,189.00	0.05
84	002774	快意电梯	3,300	27,390.00	0.05
85	003036	泰坦股份	1,700	21,080.00	0.04
86	601218	吉鑫科技	5,000	20,000.00	0.04
87	300771	智莱科技	1,600	17,392.00	0.03
88	300963	中洲特材	1,300	17,056.00	0.03
89	600539	狮头股份	2,300	16,491.00	0.03
90	600480	凌云股份	1,800	16,398.00	0.03
91	605066	天正电气	1,700	15,606.00	0.03
92	603321	梅轮电梯	1,600	13,664.00	0.02
93	002811	郑中设计	1,300	12,805.00	0.02
94	002633	申科股份	1,000	11,690.00	0.02
95	000973	佛塑科技	2,100	10,269.00	0.02
96	300281	金明精机	1,600	9,584.00	0.02
97	300577	开润股份	600	8,802.00	0.02
98	300182	捷成股份	1,600	8,128.00	0.01
99	603089	正裕工业	700	8,036.00	0.01
100	603980	吉华集团	1,700	7,939.00	0.01
101	002492	恒基达鑫	1,200	7,188.00	0.01
102	600356	恒丰纸业	900	7,182.00	0.01
103	603686	福龙马	700	7,161.00	0.01
104	300632	光莆股份	500	6,310.00	0.01
105	603900	莱绅通灵	900	6,012.00	0.01

106	002578	闽发铝业	1,300	5,824.00	0.01
107	601018	宁波港	1,600	5,696.00	0.01
108	000682	东方电子	700	5,635.00	0.01
109	002357	富临运业	700	5,285.00	0.01
110	002360	同德化工	700	5,110.00	0.01
111	002286	保龄宝	600	4,872.00	0.01
112	300441	鲍斯股份	700	4,823.00	0.01
113	300195	长荣股份	700	4,760.00	0.01
114	002164	宁波东力	700	4,725.00	0.01
115	600782	新钢股份	1,300	4,537.00	0.01
116	600735	新华锦	700	4,515.00	0.01
117	300241	瑞丰光电	800	4,504.00	0.01
118	300329	海伦钢琴	600	4,470.00	0.01
119	002347	泰尔股份	700	4,445.00	0.01
120	000565	渝三峡A	700	4,417.00	0.01
121	000702	正虹科技	700	4,389.00	0.01
122	600051	宁波联合	600	4,332.00	0.01
123	600784	鲁银投资	700	4,305.00	0.01
124	600235	民丰特纸	700	4,298.00	0.01
125	300741	华宝股份	200	4,282.00	0.01
126	300107	建新股份	800	4,264.00	0.01
127	600232	金鹰股份	700	4,242.00	0.01
128	600667	太极实业	600	4,218.00	0.01
129	000619	海螺新材	600	4,152.00	0.01
130	600556	天下秀	700	4,137.00	0.01
131	605001	威奥股份	600	4,014.00	0.01
132	000417	合肥百货	800	3,992.00	0.01
133	600526	菲达环保	800	3,952.00	0.01
134	600409	三友化工	700	3,843.00	0.01
135	603817	海峡环保	600	3,828.00	0.01
136	601368	绿城水务	700	3,745.00	0.01
137	600507	方大特钢	800	3,688.00	0.01
138	300221	银禧科技	600	3,600.00	0.01
139	600027	华电国际	700	3,598.00	0.01
140	002278	神开股份	600	3,522.00	0.01
141	002249	大洋电机	700	3,479.00	0.01
142	002676	顺威股份	700	3,318.00	0.01
143	603183	建研院	700	3,269.00	0.01
144	000952	广济药业	400	3,196.00	0.01
145	002160	常铝股份	700	2,933.00	0.01
146	600558	大西洋	700	2,849.00	0.01
147	002084	海鸥住工	700	2,786.00	0.00
148	603928	兴业股份	200	2,674.00	0.00

149	002081	金螳螂	700	2,632.00	0.00
150	002802	洪汇新材	200	2,562.00	0.00
151	002110	三钢闽光	600	2,430.00	0.00
152	600297	广汇汽车	1,301	2,237.72	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	9,699,780.60	17.08
2	300003	乐普医疗	9,275,456.00	16.33
3	000783	长江证券	8,611,491.00	15.16
4	002028	思源电气	7,412,142.00	13.05
5	600885	宏发股份	7,321,631.00	12.89
6	601997	贵阳银行	7,274,635.80	12.81
7	002384	东山精密	7,226,525.00	12.72
8	601233	桐昆股份	7,134,765.00	12.56
9	600879	航天电子	7,056,099.00	12.42
10	002273	水晶光电	7,034,920.00	12.39
11	600489	中金黄金	6,933,738.00	12.21
12	300285	国瓷材料	6,889,343.00	12.13
13	601108	财通证券	6,878,993.00	12.11
14	000623	吉林敖东	6,826,001.00	12.02
15	002065	东华软件	6,770,678.00	11.92
16	000009	中国宝安	6,761,483.00	11.90
17	300136	信维通信	6,716,428.60	11.83
18	600109	国金证券	6,688,432.11	11.78
19	600580	卧龙电驱	6,547,376.00	11.53
20	600909	华安证券	6,505,704.00	11.45
21	600637	东方明珠	6,399,741.52	11.27
22	000630	铜陵有色	6,383,132.00	11.24
23	601555	东吴证券	6,368,482.00	11.21
24	601168	西部矿业	6,358,890.00	11.20
25	002340	格林美	6,292,069.00	11.08
26	600487	亨通光电	6,262,413.00	11.03
27	000738	航发控制	6,216,466.00	10.94
28	000739	普洛药业	6,192,729.90	10.90
29	002138	顺络电子	6,162,968.00	10.85
30	002500	山西证券	6,160,132.00	10.85

31	300296	利亚德	6,158,615.00	10.84
32	002745	木林森	5,996,616.00	10.56
33	002056	横店东磁	5,888,641.00	10.37
34	000987	越秀资本	5,880,178.00	10.35
35	002422	科伦药业	5,760,021.00	10.14
36	600380	健康元	5,737,978.21	10.10
37	002249	大洋电机	5,703,729.00	10.04
38	002444	巨星科技	5,681,137.00	10.00
39	000559	万向钱潮	5,607,404.00	9.87
40	600739	辽宁成大	5,565,412.00	9.80
41	600369	西南证券	5,554,392.00	9.78
42	600967	内蒙一机	5,508,880.00	9.70
43	300012	华测检测	5,386,435.00	9.48
44	000636	风华高科	5,344,350.00	9.41
45	600998	九州通	5,339,277.55	9.40
46	600143	金发科技	5,316,543.00	9.36
47	600352	浙江龙盛	5,299,080.00	9.33
48	002203	海亮股份	5,276,138.00	9.29
49	000729	燕京啤酒	5,267,982.00	9.27
50	300088	长信科技	5,260,595.00	9.26
51	002152	广电运通	5,240,540.00	9.23
52	000728	国元证券	5,225,231.00	9.20
53	002465	海格通信	5,213,569.43	9.18
54	300383	光环新网	5,191,631.00	9.14
55	600765	中航重机	5,175,203.00	9.11
56	600985	淮北矿业	5,167,804.00	9.10
57	600549	厦门钨业	5,076,798.50	8.94
58	000050	深天马 A	5,044,789.84	8.88
59	002223	鱼跃医疗	4,987,296.00	8.78
60	002019	亿帆医药	4,958,798.00	8.73
61	601179	中国西电	4,865,723.34	8.57
62	603883	老百姓	4,859,638.00	8.56
63	601058	赛轮轮胎	4,826,814.00	8.50
64	603160	汇顶科技	4,741,051.00	8.35
65	002025	航天电器	4,737,701.80	8.34
66	600060	海信视像	4,722,233.00	8.31
67	000967	盈峰环境	4,718,057.04	8.31
68	600862	中航高科	4,642,193.00	8.17
69	000932	华菱钢铁	4,579,799.00	8.06
70	600582	天地科技	4,562,039.00	8.03
71	000060	中金岭南	4,556,965.00	8.02
72	002185	华天科技	4,522,715.00	7.96
73	300073	当升科技	4,441,308.00	7.82

74	600498	烽火通信	4,408,342.00	7.76
75	002673	西部证券	4,368,791.00	7.69
76	000878	云南铜业	4,351,516.00	7.66
77	600177	雅戈尔	4,344,059.36	7.65
78	002926	华西证券	4,317,847.00	7.60
79	600372	中航机载	4,304,525.70	7.58
80	300699	光威复材	4,293,692.40	7.56
81	002797	第一创业	4,293,202.00	7.56
82	000156	华数传媒	4,291,248.00	7.56
83	600959	江苏有线	4,273,133.00	7.52
84	300144	宋城演艺	4,217,271.98	7.42
85	002600	领益智造	4,203,262.00	7.40
86	600528	中铁工业	4,171,611.00	7.34
87	603456	九洲药业	4,127,826.00	7.27
88	000031	大悦城	4,125,353.00	7.26
89	600535	天士力	4,100,680.00	7.22
90	600066	宇通客车	4,095,056.76	7.21
91	688009	中国通号	4,088,599.23	7.20
92	601717	郑煤机	4,075,084.00	7.17
93	000887	中鼎股份	4,059,689.00	7.15
94	002008	大族激光	4,030,163.00	7.10
95	002353	杰瑞股份	4,013,437.32	7.07
96	601231	环旭电子	3,980,795.00	7.01
97	002625	光启技术	3,959,130.51	6.97
98	600435	北方导航	3,958,598.00	6.97
99	300568	星源材质	3,958,160.00	6.97
100	000959	首钢股份	3,939,537.80	6.94
101	000513	丽珠集团	3,932,129.00	6.92
102	600718	东软集团	3,891,168.00	6.85
103	603228	景旺电子	3,850,609.00	6.78
104	002683	广东宏大	3,848,047.00	6.77
105	000400	许继电气	3,813,457.00	6.71
106	600079	人福医药	3,800,272.00	6.69
107	600623	华谊集团	3,783,828.00	6.66
108	002595	豪迈科技	3,758,869.00	6.62
109	002463	沪电股份	3,724,992.70	6.56
110	300604	长川科技	3,710,803.00	6.53
111	600350	山东高速	3,691,097.00	6.50
112	000423	东阿阿胶	3,684,281.35	6.49
113	600167	联美控股	3,675,082.00	6.47
114	600008	首创环保	3,665,400.00	6.45
115	600655	豫园股份	3,647,341.00	6.42
116	600642	申能股份	3,621,792.00	6.38

117	000807	云铝股份	3,589,814.00	6.32
118	000785	居然之家	3,582,180.00	6.31
119	603233	大参林	3,581,467.19	6.31
120	002730	电光科技	3,532,709.00	6.22
121	002268	电科网安	3,518,885.00	6.20
122	600271	航天信息	3,488,190.00	6.14
123	603218	日月股份	3,461,759.00	6.09
124	000066	中国长城	3,401,074.00	5.99
125	002078	太阳纸业	3,330,718.00	5.86
126	600481	双良节能	3,325,035.00	5.85
127	600258	首旅酒店	3,320,669.00	5.85
128	600166	福田汽车	3,285,940.00	5.79
129	300694	蠡湖股份	3,266,794.00	5.75
130	000830	鲁西化工	3,228,591.00	5.68
131	300724	捷佳伟创	3,215,864.00	5.66
132	000591	太阳能	3,162,188.00	5.57
133	002373	千方科技	3,160,766.00	5.56
134	000039	中集集团	3,152,028.50	5.55
135	002624	完美世界	3,130,059.00	5.51
136	600988	赤峰黄金	3,086,869.00	5.43
137	600161	天坛生物	3,066,674.00	5.40
138	600325	华发股份	3,063,474.00	5.39
139	002580	圣阳股份	3,057,780.00	5.38
140	600873	梅花生物	3,047,503.00	5.37
141	000563	陕国投 A	3,046,828.00	5.36
142	002429	兆驰股份	3,030,232.00	5.34
143	603267	鸿远电子	3,024,216.00	5.32
144	603156	养元饮品	3,016,158.00	5.31
145	601577	长沙银行	2,993,467.00	5.27
146	000883	湖北能源	2,983,490.00	5.25
147	002676	顺威股份	2,977,691.00	5.24
148	002128	电投能源	2,961,803.88	5.21
149	000551	创元科技	2,959,111.00	5.21
150	600755	厦门国贸	2,957,730.00	5.21
151	688538	和辉光电	2,931,584.05	5.16
152	600378	昊华科技	2,880,976.38	5.07
153	002563	森马服饰	2,875,560.00	5.06
154	603939	益丰药房	2,830,969.00	4.98
155	600867	通化东宝	2,824,834.00	4.97
156	002299	圣农发展	2,816,585.00	4.96
157	600497	驰宏锌锗	2,810,082.00	4.95
158	603689	皖天然气	2,801,037.00	4.93
159	600663	陆家嘴	2,772,617.00	4.88

160	600820	隧道股份	2,743,754.00	4.83
161	002925	盈趣科技	2,709,771.00	4.77
162	300626	华瑞股份	2,708,259.00	4.77
163	002855	捷荣技术	2,702,883.00	4.76
164	600171	上海贝岭	2,691,220.00	4.74
165	000089	深圳机场	2,684,242.00	4.73
166	300009	安科生物	2,652,839.00	4.67
167	000997	新大陆	2,618,403.00	4.61
168	300001	特锐德	2,599,415.00	4.58
169	603225	新凤鸣	2,550,440.00	4.49
170	000027	深圳能源	2,535,911.25	4.46
171	000988	华工科技	2,535,751.00	4.46
172	600160	巨化股份	2,528,143.04	4.45
173	603127	昭衍新药	2,514,727.63	4.43
174	600500	中化国际	2,503,275.00	4.41
175	002080	中材科技	2,487,501.00	4.38
176	000598	兴蓉环境	2,480,948.00	4.37
177	603858	步长制药	2,461,671.00	4.33
178	002092	中泰化学	2,458,927.50	4.33
179	002296	辉煌科技	2,453,934.00	4.32
180	600398	海澜之家	2,432,402.00	4.28
181	300682	朗新科技	2,427,830.37	4.27
182	600529	山东药玻	2,412,530.00	4.25
183	603926	铁流股份	2,396,876.00	4.22
184	002507	涪陵榨菜	2,363,837.30	4.16
185	603589	口子窖	2,358,869.00	4.15
186	300257	开山股份	2,354,152.00	4.14
187	600282	南钢股份	2,349,290.00	4.14
188	600170	上海建工	2,349,108.00	4.14
189	601958	金钼股份	2,349,097.00	4.14
190	002578	闽发铝业	2,345,312.00	4.13
191	300253	卫宁健康	2,327,967.00	4.10
192	600153	建发股份	2,316,932.00	4.08
193	600315	上海家化	2,300,528.00	4.05
194	300395	菲利华	2,267,529.22	3.99
195	600597	光明乳业	2,256,514.00	3.97
196	000869	张裕A	2,252,682.36	3.97
197	000547	航天发展	2,231,993.00	3.93
198	600027	华电国际	2,221,630.00	3.91
199	002899	英派斯	2,212,508.00	3.90
200	600390	五矿资本	2,189,660.00	3.86
201	000933	神火股份	2,175,614.00	3.83
202	002532	天山铝业	2,156,085.00	3.80

203	300115	长盈精密	2,155,643.66	3.80
204	002294	信立泰	2,148,013.00	3.78
205	002131	利欧股份	2,133,786.00	3.76
206	002966	苏州银行	2,117,771.00	3.73
207	000998	隆平高科	2,109,898.00	3.71
208	601139	深圳燃气	2,082,716.00	3.67
209	300632	光莆股份	2,061,963.00	3.63
210	002690	美亚光电	2,050,593.00	3.61
211	002266	浙富控股	2,047,989.00	3.61
212	603989	艾华集团	2,020,291.00	3.56
213	600956	新天绿能	1,978,831.00	3.48
214	002940	昂利康	1,937,459.00	3.41
215	603897	长城科技	1,923,622.00	3.39
216	002010	传化智联	1,922,370.00	3.38
217	002666	德联集团	1,918,520.00	3.38
218	600863	内蒙华电	1,911,000.00	3.36
219	002368	太极股份	1,896,441.00	3.34
220	300037	新宙邦	1,893,880.00	3.33
221	600298	安琪酵母	1,889,102.67	3.33
222	603158	腾龙股份	1,878,791.92	3.31
223	600517	国网英大	1,874,837.00	3.30
224	002357	富临运业	1,863,910.00	3.28
225	601666	平煤股份	1,846,820.00	3.25
226	300595	欧普康视	1,831,680.91	3.22
227	000703	恒逸石化	1,824,918.25	3.21
228	300441	鲍斯股份	1,822,857.00	3.21
229	600521	华海药业	1,821,271.00	3.21
230	603289	泰瑞机器	1,795,219.00	3.16
231	600118	中国卫星	1,788,259.00	3.15
232	002160	常铝股份	1,786,954.00	3.15
233	603861	白云电器	1,772,787.00	3.12
234	688819	天能电池集团股份	1,772,178.36	3.12
235	300529	健帆生物	1,763,225.00	3.10
236	600348	华阳股份	1,757,826.00	3.09
237	002407	多氟多	1,724,637.40	3.04
238	000683	远兴能源	1,694,642.00	2.98
239	000975	银泰黄金	1,687,026.00	2.97
240	600516	方大炭素	1,683,875.00	2.96
241	002511	中顺洁柔	1,663,862.00	2.93
242	603707	健友股份	1,661,747.00	2.93
243	601990	南京证券	1,657,633.00	2.92
244	002363	隆基机械	1,633,364.50	2.88

245	603309	维力医疗	1,619,758.00	2.85
246	600827	百联股份	1,586,209.00	2.79
247	600927	永安期货	1,583,081.00	2.79
248	002540	亚太科技	1,539,157.00	2.71
249	002664	信质集团	1,521,363.00	2.68
250	002850	科达利	1,519,431.00	2.68
251	600399	抚顺特钢	1,515,083.00	2.67
252	002774	快意电梯	1,490,955.00	2.62
253	688567	孚能科技	1,486,452.72	2.62
254	600126	杭钢股份	1,453,835.00	2.56
255	600184	光电股份	1,421,703.00	2.50
256	002195	岩山科技	1,415,799.00	2.49
257	603712	七一二	1,407,397.00	2.48
258	002531	天顺风能	1,396,050.00	2.46
259	002439	启明星辰	1,391,735.00	2.45
260	688772	珠海冠宇电 池	1,363,082.94	2.40
261	688385	复旦微电	1,303,099.30	2.29
262	300118	东方日升	1,273,633.00	2.24
263	000968	蓝焰控股	1,268,992.00	2.23
264	002244	滨江集团	1,257,548.00	2.21
265	000519	中兵红箭	1,254,158.00	2.21
266	300076	GQY 视讯	1,247,595.00	2.20
267	002381	双箭股份	1,214,667.00	2.14
268	000960	锡业股份	1,209,152.00	2.13
269	300357	我武生物	1,166,960.00	2.05
270	002250	联化科技	1,162,688.00	2.05
271	601608	中信重工	1,154,300.00	2.03
272	002939	长城证券	1,149,195.00	2.02
273	002568	百润股份	1,144,440.00	2.01
274	000553	安道麦 A	1,140,475.00	2.01
275	600563	法拉电子	1,139,922.00	2.01
276	600859	王府井	1,136,892.00	2.00

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资 产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	9,500,153.80	16.73

2	000783	长江证券	8,807,895.00	15.51
3	300003	乐普医疗	8,793,592.00	15.48
4	002028	思源电气	7,013,621.00	12.35
5	000623	吉林敖东	6,836,256.00	12.04
6	002273	水晶光电	6,831,823.61	12.03
7	300136	信维通信	6,804,431.00	11.98
8	002384	东山精密	6,798,117.00	11.97
9	002065	东华软件	6,526,885.00	11.49
10	002500	山西证券	6,466,800.00	11.39
11	300285	国瓷材料	6,458,654.00	11.37
12	000009	中国宝安	6,400,666.00	11.27
13	000630	铜陵有色	6,382,735.00	11.24
14	000987	越秀资本	6,279,483.45	11.06
15	002138	顺络电子	6,253,442.00	11.01
16	002340	格林美	6,251,254.00	11.01
17	000739	普洛药业	6,231,250.00	10.97
18	002745	木林森	5,952,702.60	10.48
19	000738	航发控制	5,895,519.00	10.38
20	300296	利亚德	5,819,842.00	10.25
21	002249	大洋电机	5,685,885.00	10.01
22	002056	横店东磁	5,538,263.00	9.75
23	002444	巨星科技	5,457,841.00	9.61
24	000728	国元证券	5,449,879.00	9.60
25	000559	万向钱潮	5,403,966.00	9.51
26	002422	科伦药业	5,339,852.00	9.40
27	002465	海格通信	5,171,855.00	9.11
28	300383	光环新网	5,141,931.00	9.05
29	002203	海亮股份	5,088,202.80	8.96
30	002152	广电运通	5,056,643.74	8.90
31	300088	长信科技	5,032,599.72	8.86
32	000636	风华高科	5,015,836.00	8.83
33	000729	燕京啤酒	4,974,165.00	8.76
34	300012	华测检测	4,969,182.00	8.75
35	000050	深天马 A	4,889,113.00	8.61
36	002223	鱼跃医疗	4,783,145.00	8.42
37	002797	第一创业	4,716,195.00	8.30
38	002019	亿帆医药	4,571,016.00	8.05
39	300073	当升科技	4,528,459.00	7.97
40	000967	盈峰环境	4,509,265.00	7.94
41	002926	华西证券	4,484,831.00	7.90
42	000932	华菱钢铁	4,479,862.00	7.89
43	002025	航天电器	4,466,079.78	7.86
44	000060	中金岭南	4,413,241.00	7.77

45	002673	西部证券	4,370,258.00	7.69
46	000031	大悦城	4,345,425.00	7.65
47	000878	云南铜业	4,333,824.00	7.63
48	300144	宋城演艺	4,265,144.36	7.51
49	300699	光威复材	4,180,669.40	7.36
50	002353	杰瑞股份	4,114,162.17	7.24
51	002185	华天科技	4,072,259.00	7.17
52	000156	华数传媒	4,025,524.00	7.09
53	002625	光启技术	3,988,928.00	7.02
54	002008	大族激光	3,965,391.00	6.98
55	000959	首钢股份	3,956,284.00	6.97
56	300568	星源材质	3,928,861.06	6.92
57	000887	中鼎股份	3,902,503.01	6.87
58	000807	云铝股份	3,753,628.00	6.61
59	002600	领益智造	3,701,756.80	6.52
60	300604	长川科技	3,646,039.00	6.42
61	000400	许继电气	3,596,296.00	6.33
62	000513	丽珠集团	3,593,024.00	6.33
63	000785	居然之家	3,563,644.00	6.27
64	002595	豪迈科技	3,552,335.00	6.25
65	002683	广东宏大	3,527,732.99	6.21
66	002268	电科网安	3,523,485.00	6.20
67	000066	中国长城	3,393,961.00	5.98
68	000423	东阿阿胶	3,366,204.00	5.93
69	002078	太阳纸业	3,358,932.00	5.91
70	002730	电光科技	3,343,031.00	5.89
71	002463	沪电股份	3,339,084.00	5.88
72	300694	蠡湖股份	3,281,035.00	5.78
73	000563	陕国投A	3,158,971.00	5.56
74	000591	太阳能	3,133,408.00	5.52
75	002624	完美世界	3,099,177.58	5.46
76	300724	捷佳伟创	3,073,040.00	5.41
77	002855	捷荣技术	3,042,707.00	5.36
78	002580	圣阳股份	3,003,095.00	5.29
79	000830	鲁西化工	2,994,530.00	5.27
80	000039	中集集团	2,959,532.50	5.21
81	002676	顺威股份	2,955,712.00	5.20
82	000551	创元科技	2,902,074.00	5.11
83	002429	兆驰股份	2,884,783.00	5.08
84	000883	湖北能源	2,838,509.00	5.00
85	002373	千方科技	2,831,501.00	4.99
86	002128	电投能源	2,733,161.00	4.81
87	002563	森马服饰	2,704,002.00	4.76

88	002299	圣农发展	2,662,102.00	4.69
89	300626	华瑞股份	2,639,882.00	4.65
90	002080	中材科技	2,596,143.00	4.57
91	000027	深圳能源	2,528,473.00	4.45
92	000089	深圳机场	2,520,111.00	4.44
93	002925	盈趣科技	2,489,665.00	4.38
94	000997	新大陆	2,466,193.00	4.34
95	002296	辉煌科技	2,439,568.00	4.30
96	000598	兴蓉环境	2,413,092.00	4.25
97	002578	闽发铝业	2,376,146.00	4.18
98	300009	安科生物	2,374,347.00	4.18
99	000988	华工科技	2,370,450.00	4.17
100	300001	特锐德	2,333,562.00	4.11
101	300257	开山股份	2,322,483.00	4.09
102	002507	涪陵榨菜	2,273,043.40	4.00
103	000869	张裕A	2,272,861.68	4.00
104	002092	中泰化学	2,254,500.00	3.97
105	300253	卫宁健康	2,223,674.00	3.92
106	300395	菲利华	2,219,510.39	3.91
107	002131	利欧股份	2,194,923.00	3.86
108	002899	英派斯	2,160,490.00	3.80
109	300115	长盈精密	2,153,828.80	3.79
110	000547	航天发展	2,128,259.00	3.75
111	300682	朗新科技	2,126,596.00	3.74
112	000998	隆平高科	2,012,187.00	3.54
113	002966	苏州银行	1,966,048.10	3.46
114	002266	浙富控股	1,960,231.00	3.45
115	300632	光莆股份	1,950,227.00	3.43
116	002368	太极股份	1,946,005.00	3.43
117	000933	神火股份	1,931,616.00	3.40
118	002294	信立泰	1,929,353.00	3.40
119	002532	天山铝业	1,916,828.00	3.37
120	002666	德联集团	1,876,774.00	3.30
121	002357	富临运业	1,870,243.00	3.29
122	002940	昂利康	1,858,730.00	3.27
123	300529	健帆生物	1,855,263.00	3.27
124	002160	常铝股份	1,822,898.56	3.21
125	000703	恒逸石化	1,800,269.00	3.17
126	300441	鲍斯股份	1,797,652.00	3.16
127	002690	美亚光电	1,779,745.02	3.13
128	300037	新宙邦	1,765,418.00	3.11
129	002407	多氟多	1,722,472.00	3.03
130	300595	欧普康视	1,710,654.00	3.01

131	002363	隆基机械	1,704,368.64	3.00
132	002010	传化智联	1,690,809.00	2.98
133	000975	银泰黄金	1,665,353.40	2.93
134	000683	远兴能源	1,548,640.32	2.73
135	002540	亚太科技	1,542,748.00	2.72
136	002664	信质集团	1,536,081.05	2.70
137	002511	中顺洁柔	1,497,389.00	2.64
138	002774	快意电梯	1,438,868.00	2.53
139	002850	科达利	1,438,683.87	2.53
140	601108	财通证券	1,435,709.00	2.53
141	002531	天顺风能	1,396,743.00	2.46
142	002244	滨江集团	1,344,783.00	2.37
143	002195	岩山科技	1,292,376.00	2.28
144	000968	蓝焰控股	1,265,239.00	2.23
145	002939	长城证券	1,213,600.00	2.14
146	600369	西南证券	1,190,704.00	2.10
147	300357	我武生物	1,163,132.00	2.05
148	000519	中兵红箭	1,162,978.00	2.05
149	002439	启明星辰	1,156,260.00	2.04
150	002568	百润股份	1,148,039.00	2.02

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。

8.4.3 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	1,100,034,471.89
卖出股票收入（成交）总额	655,220,917.07

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，华测检测认证集团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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	292,034.10
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	292,034.10

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,954	30,441.66	19,171,400.00	32.23	40,311,600.00	67.77

9.2 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	中信证券股份有限公司	5,914,000.00	9.94
2	山东健桥药业有限公司	3,000,000.00	5.04
3	广发证券股份有限公司	2,655,200.00	4.46
4	华泰证券股份有限公司	2,577,700.00	4.33
5	赵东茂	2,000,000.00	3.36
6	珠海海电配网自动化有限公司	2,000,000.00	3.36
7	刁卓	1,254,200.00	2.11
8	杨树潮	1,100,000.00	1.85
9	海南盛丰私募基金管理有限公司—盛丰优谷私募证券投资基金	1,049,900.00	1.77
10	谢清桃	1,000,000.00	1.68
10	周清华	1,000,000.00	1.68
10	王利娟	1,000,000.00	1.68

10	上海洁乐特防锈包装技术有限公司	1,000,000.00	1.68
----	-----------------	--------------	------

9.3 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。

9.4 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

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 07 月 19 日）基金份额总额	961,483,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	36,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	938,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	59,483,000.00

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2023 年 07 月 19 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 70,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
东方证券	4	1,212,686,387.55	69.09	877,532.27	83.36	
华泰证券	2	542,569,001.41	30.91	175,164.74	16.64	

财信 证券	1	-	-	-	-	
长城 证券	1	-	-	-	-	
长江 证券	1	-	-	-	-	
东吴 证券	2	-	-	-	-	
东兴 证券	1	-	-	-	-	
方正 证券	1	-	-	-	-	
高盛 中国	1	-	-	-	-	
光大 证券	1	-	-	-	-	
广发 证券	1	-	-	-	-	
国都 证券	1	-	-	-	-	
国金 证券	2	-	-	-	-	
国泰 君安	2	-	-	-	-	
国投 证券	2	-	-	-	-	
国新 证券	2	-	-	-	-	
国信 证券	2	-	-	-	-	
海通 证券	2	-	-	-	-	
华鑫 证券	3	-	-	-	-	
上海 证券	1	-	-	-	-	
申万 宏源 证券	1	-	-	-	-	
西南 证券	1	-	-	-	-	
兴业 证券	2	-	-	-	-	
银河	2	-	-	-	-	

证券						
招商证券	2	-	-	-	-	
中金财富	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	2	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
中银国际	1	-	-	-	-	

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。

11.7.2 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 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信	-	-	-	-	-	-	-	-

建投 证券								
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

11.8 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	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发行文件	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 20 日
2	关于汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金增	上交所,上证报,公司网站,中国证监会	2023 年 07 月 03 日

	加网下现金发售代理机构的公告	基金电子披露网站	
3	关于汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 06 日
4	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 12 日
5	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 20 日
6	关于汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 26 日
7	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2023 年 7 月 26 日更新)	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 26 日
8	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 26 日
9	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 26 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金增加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	2023 年 07 月 31 日
11	汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 31 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 15 日
13	关于汇添富基金管理股份有限公司运用自有资金投资旗下基金的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日
14	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与南京途牛基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 04 日
15	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与凤凰金信(海口)基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 12 日
16	汇添富基金管理股份有限公司旗	上交所, 上证报, 公	2023 年 10 月 25 日

	下基金 2023 年第三季度报告	司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	
17	关于汇添富运用自有资金投资旗下基金的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 09 日
18	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及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 17 日
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加浙商证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 8 月 4 日至 2023 年 8 月 6 日	-	113,066,500.00	113,066,500.00	-	-
个人	1	2023 年 8 月 1 日至 2023 年 8 月 1 日	-	370,067,300.00	370,067,300.00	-	-
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富中证 500 增强策略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、报告期内汇添富中证 500 增强策略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。

13.2 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

13.3 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

2024 年 03 月 29 日