

# 汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资 基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2024 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
§ 4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	19
§ 5 托管人报告 .....	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	19
6.1 资产负债表 .....	19
6.2 利润表 .....	21
6.3 净资产变动表 .....	22
6.4 报表附注 .....	24
§ 7 投资组合报告.....	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	96
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	97
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	97
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	97
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	98
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	98

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	98
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	98
7.12 投资组合报告附注.....	98
§ 8 基金份额持有人信息.....	99
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	99
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	99
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	100
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	100
§ 9 开放式基金份额变动.....	100
§ 10 重大事件揭示.....	101
10.1 基金份额持有人大会决议.....	101
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	101
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	101
10.4 基金投资策略的改变.....	101
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	101
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	101
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	102
10.8 其他重大事件.....	103
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	104
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	104
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	104
§ 12 备查文件目录.....	104
12.1 备查文件目录.....	104
12.2 存放地点.....	105
12.3 查阅方式.....	105

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证 1000ETF
场内简称	ZZ1000
基金主代码	560110
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 07 月 29 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	394,903,500.00
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	2022 年 08 月 08 日

注：扩位证券简称：中证 1000ETF 基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、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。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
		滕菲菲
		4006800000
		tengfeifei@citicbank.com

客户服务电话	400-888-9918	95558
传真	021-28932998	010-85230024
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	200010	100020
法定代表人	李文	方合英

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日 - 2024年06月30日)
本期已实现收益	-31,835,028.25
本期利润	-43,966,136.43
加权平均基金份额本期利润	-0.1125
本期加权平均净值利润率	-14.62%
本期基金份额净值增长率	-15.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年06月30日)
期末可供分配利润	-112,701,176.24
期末可供分配基金份额利润	-0.2854
期末基金资产净值	282,202,323.76
期末基金份额净值	0.7146
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年06月30日)

基金份额累计净值增长率	-28.54%
-------------	---------

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

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

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

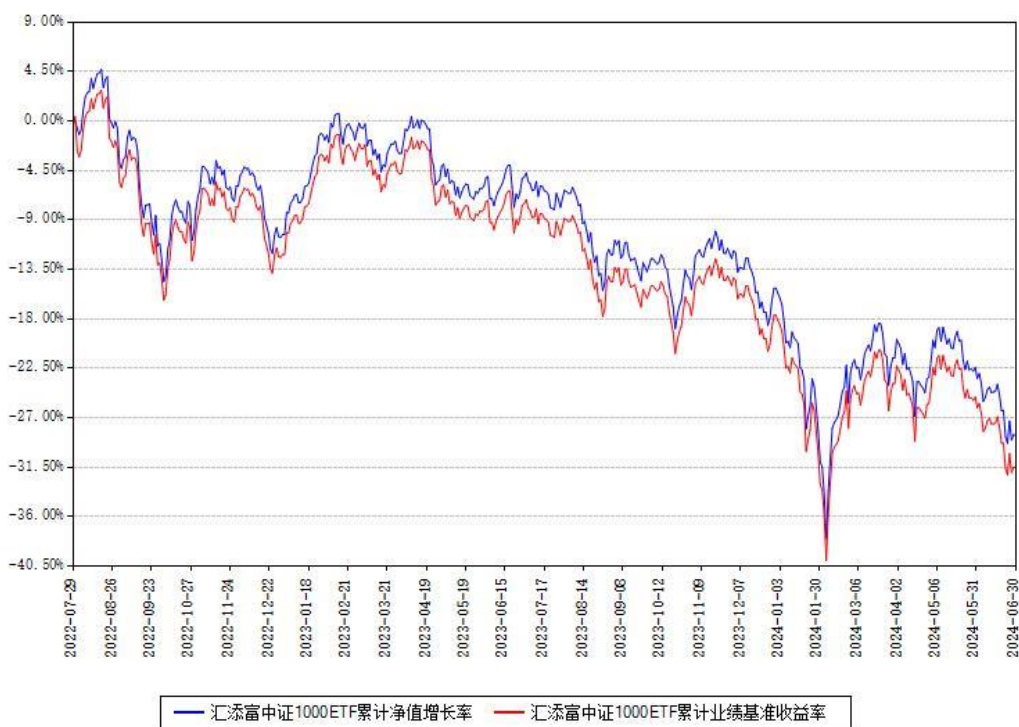
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7.90%	1.42%	-8.58%	1.43%	0.68%	-0.01%
过去三个月	-8.92%	1.47%	-10.02%	1.49%	1.10%	-0.02%
过去六个月	-15.73%	1.95%	-16.84%	1.97%	1.11%	-0.02%
过去一年	-24.60%	1.53%	-25.84%	1.55%	1.24%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-28.54%	1.34%	-31.53%	1.35%	2.99%	-0.01%

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

汇添富中证1000ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2022年07月29日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、



国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

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

2024 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金，包括 12 只股票型基金、9 只债券型基金、1 只混合型基金。截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 336 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
孙浩	本基金的基金经理	2024 年 02 月 07 日	-	4	国籍：中国。学历：北京大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格, CFA。从业经历：2020 年 7 月起任汇添富基金管理股份有限公司数量分析师。2023 年 8 月 29 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接

				<p>基金的基金经 理。2023 年 8 月 29 日至今任中证 银行交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金的 基金经理。2023 年 9 月 28 日至 今任中证长三角 一体化发展主题 交易型开放式指 数证券投资基金 联接基金的基金 经理。2023 年 11 月 28 日至今 任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互 通交易型开放式 指数证券投资基 金联接基金的基 金经理。2023 年 11 月 28 日至今 任汇添富中证沪 港深张江自主创 新 50 交易型开 放式指数证券投资 基金的基金经 理。2023 年 12 月 12 日至今任 汇添富上证综合 交易型开放式指 数证券投资基金 的基金经理。 2023 年 12 月 12 日至今任汇添富 中证 2000 交易 型开放式指数证 券投资基金的基 金经理。2024 年 1 月 30 日至今任 汇添富中证红利 交易型开放式指 数证券投资基金 发起式联接基金</p>
--	--	--	--	--

				<p>的基金经理。</p> <p>2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 26 日至今任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 4 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 20 日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基</p>
--	--	--	--	--

					金发起式联接基金的基金经理。
乐无穹	本基金的基金经理	2022 年 07 月 29 日	2024 年 02 月 07 日	10	<p>国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。</p> <p>从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2024 年 4 月 19 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放</p>

				<p>式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券</p>
--	--	--	--	--

				<p>投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 7 月 29 日至 2024 年 2 月 7 日任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基</p>
--	--	--	--	--

					<p>金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 28 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月 5 日至今任汇添富 MSCI 美国 50 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>3 月 1 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024 年 4 月 1 日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,保障公平交易制度的



执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 6 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

2024 上半年 A 股整体呈现震荡的格局，行业层面，银行、煤炭、石油石化和家电领涨，消费者服务、计算机、商贸零售和传媒跌幅较大；风格上，大盘和价值占优，小盘和成长低迷。

上半年国内经济总体运行平稳，GDP 同比增长 5.0%，规模以上工业增加值同比增长 6.0%，社零同比增长 3.7%，固定资产投资同比增长 3.9%，出口同比增长 6.9%。经济整体呈现出“外

需好于内需、生产强于需求”的格局，国内有效需求依然不足，经济回升向好基础仍需巩固。

国内政策方面，3月随着“两会”的召开，确立了“稳中求进，以进促稳”的政策基调，并强调了聚焦新质生产力的重要性。4月新“国九条”颁布，新“国九条”以强监管、防风险、促高质量发展为主线，有望优化市场环境，推动资本市场的健康发展。

海外方面，美国6月名义CPI同比上升3.0%，低于预期3.1%，核心CPI同比上升3.3%，低于预期3.4%，通胀回落速度超出市场预期，尽管后续通胀环比可能略有反弹，但预计在可控范围内，市场对此持乐观态度，美国年内降息的可能性抬升。

中证1000ETF基金跟踪中证1000指数。中证1000指数是中证系列宽基指数中的小盘风格代表，权重高度分散，与沪深300、中证500等大中盘宽基之间有着差异化的行业分布特征。当前大中小盘宽基的产品生态逐步完善，中证1000ETF基金及其联接基金结合期货、期权等衍生品，能够让投资者构建丰富的策略组合。

#### 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-15.73%。同期业绩比较基准收益率为-16.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场预期美联储开启降息，有望改善汇率约束环境，国内政策则有望加码，重点关注二十届三中全会上会提到的相关政策举措。当下，A股已体现出不错的估值性价比，随着后续市场风险偏好的改善，或有望迎来估值修复。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配采用现金分红；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。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司在汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	5,411,665.80	9,616,088.90
结算备付金		3,495,880.55	3,250,430.26
存出保证金		1,165,812.54	1,442,936.38
交易性金融资产	6.4.7.2	272,683,284.52	406,164,363.25
其中：股票投资		272,683,284.52	406,120,360.36
基金投资		-	-
债券投资		-	44,002.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		1,188,039.65	6,298,404.37
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	85.36	14,360.08
资产总计		283,944,768.42	426,786,583.24
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,407,396.67	10,069,959.47
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		35,036.44	41,278.05
应付托管费		11,678.80	13,759.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		188.07	1,764.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	288,144.68	386,231.19

负债合计		1,742,444.66	10,512,992.87
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	394,903,500.00	490,903,500.00
未分配利润	6.4.7.9	-112,701,176.24	-74,629,909.63
净资产合计		282,202,323.76	416,273,590.37
负债和净资产总计		283,944,768.42	426,786,583.24

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7146 元，基金份额总额 394,903,500.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-43,578,234.93</b>	<b>42,206,480.68</b>
1. 利息收入		333,764.21	442,570.98
其中：存款利息收入	6.4.7.10	44,769.96	69,597.38
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		288,994.25	372,973.60
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-32,681,819.36	7,372,892.51
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-34,588,230.49	3,879,761.98
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	15,631.84	116,468.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-891,197.67	111,846.82
股利收益	6.4.7.17	2,781,976.96	3,264,814.92
以摊余成本计量的金融 资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.18	-12,131,108.18	32,046,499.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	900,928.40	2,344,517.42
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>387,901.50</b>	<b>577,231.45</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	225,175.87	357,374.12
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	75,058.55	119,124.67

3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		1,042.41	4,164.36
8. 其他费用	6.4.7.21	86,624.67	96,568.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-43,966,136.43</b>	<b>41,629,249.23</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-43,966,136.43</b>	<b>41,629,249.23</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-43,966,136.43</b>	<b>41,629,249.23</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	490,903,500.00	-74,629,909.63	416,273,590.37
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	490,903,500.00	-74,629,909.63	416,273,590.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-96,000,000.00	-38,071,266.61	-134,071,266.61
（一）、综合收益总额	-	-43,966,136.43	-43,966,136.43
（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）	-96,000,000.00	5,894,869.82	-90,105,130.18
其中：1. 基金申购款	633,000,000.00	-159,940,234.45	473,059,765.55
2. 基金赎回款	-729,000,000.00	165,835,104.27	-563,164,895.73

(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	394,903,500.00	-112,701,176.24	282,202,323.76
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	625,903,500.00	-64,624,922.66	561,278,577.34
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	625,903,500.00	-64,624,922.66	561,278,577.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-84,000,000.00	36,259,708.16	-47,740,291.84
(一)、综合收益总额	-	41,629,249.23	41,629,249.23
(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)	-84,000,000.00	-5,369,541.07	-89,369,541.07
其中: 1. 基金申购款	621,000,000.00	-24,388,071.53	596,611,928.47
2. 基金赎回款	-705,000,000.00	19,018,530.46	-685,981,469.54
(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	541,903,500.00	-28,365,214.50	513,538,285.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 1000 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]583 号《关于准予汇添富中证 1000 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 2022 年 7 月 29 日生效。首次设立基金募集规模为 3,634,903,500.00 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（2022）验字第 60466941\_B45 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金的标的指数为中证 1000 指数及其未来可能发生的变更。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、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：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 90%，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。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中



国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

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

##### 2. 增值税

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

税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4. 企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权

的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 5. 个人所得税

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

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

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

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

### 6. 4. 7 重要财务报表项目的说明

#### 6. 4. 7. 1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	5,411,665.80
等于：本金	5,411,166.46
加：应计利息	499.34
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	5,411,665.80

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	304,473,302.22	-	272,683,284.52	- 31,790,017.70
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	304,473,302.22	-	272,683,284.52	- 31,790,017.70

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-

(外汇期货投资)	-	-	-	-
权益衍生工具	8,150,680.00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	8,150,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,150,680.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2407	IM2407	8	7,772,800.00	-377,880.00
合计				-377,880.00
减：可抵销期货暂收款				-377,880.00
净额				-

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

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	85.36
待摊费用	-
合计	85.36

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	203,609.32
其中：交易所市场	203,609.32
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	24,863.02
应付信息披露费	59,672.34
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	288,144.68

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	490,903,500.00	490,903,500.00
本期申购	633,000,000.00	633,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-729,000,000.00	-729,000,000.00
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	394,903,500.00	394,903,500.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-64,697,189.84	-9,932,719.79	-74,629,909.63
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-64,697,189.84	-9,932,719.79	-74,629,909.63
本期利润	-31,835,028.25	-12,131,108.18	-43,966,136.43
本期基金份额交易产生的变动数	12,167,887.61	-6,273,017.79	5,894,869.82
其中：基金申购款	-127,721,956.02	-32,218,278.43	-159,940,234.45
基金赎回款	139,889,843.63	25,945,260.64	165,835,104.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-84,364,330.48	-28,336,845.76	-112,701,176.24

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	10,279.35
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	32,321.23
其他	2,169.38
合计	44,769.96

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-25,736,254.85
股票投资收益——赎回差价收入	-8,851,975.64
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	-34,588,230.49

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	420,360,326.00
减：卖出股票成本总额	445,247,303.11
减：交易费用	849,277.74
买卖股票差价收入	-25,736,254.85

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
赎回基金份额对价总额	563,164,895.73
减：现金支付赎回款总额	312,221,436.73
减：赎回股票成本总额	259,795,434.64
减：交易费用	-
赎回差价收入	-8,851,975.64

6.4.7.11.4 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	83.76
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	15,548.08
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	15,631.84

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	143,642.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	128,000.00
减：应计利息总额	88.32
减：交易费用	5.75
买卖债券差价收入	15,548.08

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	-891,197.67
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

## 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,781,976.96
其中：证券出借权益补偿收入	155,797.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,781,976.96

## 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1. 交易性金融资产	-11,849,748.18
——股票投资	-11,849,748.18
——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	-281,360.00
——权证投资	-
——期货投资	-281,360.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-12,131,108.18

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	900,928.40
其他	-
合计	900,928.40

## 6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
审计费用		24,863.02
信息披露费		59,672.34
证券出借违约金		-
账户维护费		-
银行费用		2,089.31
指数使用费		-
持有人大会-公证费		-
持有人大会-律师费		-
开户费		-
上市费		-
或有管理费		-
其他		-
合计		86,624.67

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

根据《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《基金管理公司子公司管理规定》等法律法规的有关规定，经中国证券监督管理委员会同意，汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）已受让汇添富资本管理有限公司持有的汇添富投资管理有限公司（以下简称“汇添富投资”）全部股权。汇添富投资已由本公司的“全资子公司的全资子公司”变更为“全资子公司”。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构

中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	225,279,871.26	28.20	236,734,064.82	24.09

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	143,642.15	100.00	678,206.61	100.00

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

##### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	165,782.84	28.20	97,807.42	48.04
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	170,756.60	24.09	115,327.38	33.59

注：上述佣金的计算方式按相关协议约定的佣金率计算。上述佣金与应支付非关联方交易佣金的计算方式、佣金计算比率不存在差异，具有公允性。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（被动股票型基金不适用）。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	225,175.87	357,374.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	48,753.84	7,692.82
应支付基金管理人的净管理费	176,422.03	349,681.30

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	75,058.55	119,124.67

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

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易**

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

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	5,695,700.00	1.44	-	-
汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	23,306,300.00	5.90	59,198,500.00	12.06

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	5,411,665.80	10,279.35	10,444,202.75	14,549.06

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

#### 6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024年05月06日	重大事項停牌	9.12	2024年07月08日	9.88	17,200	327,078.27	156,864.00	

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日		期末估值单价	数量(单位：张)	期末估值总额
1	300630	普利制药	2024年05月13日	2024年05月13日	9.12	2,300	20,976.00
合计	-	-	-	-	-	2,300	20,976.00

注：出借证券中如有其它流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构



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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年 06月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,411,665.80	-	-	-	-	-	5,411,665.80
结算备付金	3,495,880.55	-	-	-	-	-	3,495,880.55
存出保证金	233,076.54	-	-	-	-	932,736.00	1,165,812.54

交易性金融资产	-	-	-	-	-	272,683,284.52	272,683,284.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,188,039.65	1,188,039.65
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	85.36	85.36
资产总计	9,140,622.89	-	-	-	-	274,804,145.53	283,944,768.42
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	-	-	1,407,396.67	1,407,396.67
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,036.44	35,036.44
应付托管费	-	-	-	-	-	11,678.80	11,678.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	188.07	188.07
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	288,144.68	288,144.68
负债总计	-	-	-	-	-	1,742,444.66	1,742,444.66
利率敏感度缺口	9,140,622.89	-	-	-	-	273,061,700.87	282,202,323.76
上年度末 2023 年 12 月 31	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

目							
资产							
货币资金	9,616,088.90	-	-	-	-	-	9,616,088.90
结算备付金	3,250,430.26	-	-	-	-	-	3,250,430.26
存出保证金	312,440.38	-	-	-	-	1,130,496.00	1,442,936.38
交易性金融资产	-	-	44,002.89	-	-	406,120,360.36	406,164,363.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	6,298,404.37	6,298,404.37
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	14,360.08	14,360.08
资产总计	13,178,959.54	-	44,002.89	-	-	413,563,620.81	426,786,583.24
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	-	-	-	-	-	10,069,959.47	10,069,959.47
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	41,278.05	41,278.05
应付 托管 费	-	-	-	-	-	13,759.36	13,759.36
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 投资 顾问 费	-	-	-	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-	-	1,764.80	1,764.80
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税负 债	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	386,231.19	386,231.19
负债 总计	-	-	-	-	-	10,512,992.87	10,512,992.87
利率	13,178,959.54	-	44,002.89	-	-	403,050,627.94	416,273,590.37

敏感 度缺 口							
---------------	--	--	--	--	--	--	--

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	272,683,284.52	96.63	406,120,360.36	97.56
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	44,002.89	0.01
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	272,683,284.52	96.63	406,164,363.25	97.57

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险,即从长期来看,本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关,且报告期
----	--

	内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	中证 1000 指数上涨 5%	13,996,647.97	20,688,491.23
中证 1000 指数下跌 5%	-13,996,647.97	-20,688,491.23	

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。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日
第一层次	272,526,420.52
第二层次	-
第三层次	156,864.00
合计	272,683,284.52

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动



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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	272,683,284.52	96.03
	其中：股票	272,683,284.52	96.03
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	8,907,546.35	3.14
8	其他各项资产	2,353,937.55	0.83

9	合计	283,944,768.42	100.00
---	----	----------------	--------

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 20,976.00 元，占期末基金资产净值比例 0.01%。此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”章节的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,818,159.00	0.64
B	采矿业	10,065,486.95	3.57
C	制造业	176,194,853.36	62.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,949,474.26	3.17
E	建筑业	4,477,763.24	1.59
F	批发和零售业	9,415,401.32	3.34
G	交通运输、仓储和邮政业	8,416,581.88	2.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,536,188.83	10.11
J	金融业	7,750,010.34	2.75
K	房地产业	4,026,032.00	1.43
L	租赁和商务服务业	4,497,669.79	1.59
M	科学研究和技术服务业	2,033,781.27	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	2,356,951.90	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	941,996.50	0.33
R	文化、体育和娱乐业	3,046,517.88	1.08
S	综合	-	-
	合计	272,526,868.52	96.57

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	156,864.00	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	156,864.00	0.06

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲光	174,301	1,361,290.81	0.48
2	601099	太平洋	364,400	1,111,420.00	0.39
3	300573	兴齐眼药	6,700	1,098,800.00	0.39
4	300476	胜宏科技	32,400	1,045,224.00	0.37
5	000426	兴业银锡	68,500	930,230.00	0.33
6	002085	万丰奥威	67,900	898,996.00	0.32
7	300339	润和软件	42,300	874,341.00	0.31
8	002318	久立特材	36,600	853,878.00	0.30
9	600312	平高电气	43,400	844,130.00	0.30

10	000766	通化金马	51,600	835,404.00	0.30
11	300346	南大光电	28,840	824,535.60	0.29
12	000528	柳工	73,400	821,346.00	0.29
13	601918	新集能源	83,100	810,225.00	0.29
14	688578	艾力斯医药科技	12,395	790,057.30	0.28
15	002405	四维图新	126,827	788,863.94	0.28
16	601677	明泰铝业	66,280	766,196.80	0.27
17	002126	银轮股份	43,700	760,817.00	0.27
18	002130	沃尔核材	53,800	759,656.00	0.27
19	601975	招商南油	207,400	744,566.00	0.26
20	601001	晋控煤业	44,900	741,748.00	0.26
21	002176	江特电机	90,954	741,275.10	0.26
22	605589	圣泉集团	36,200	734,498.00	0.26
23	603129	春风动力	5,100	725,934.00	0.26
24	603005	晶方科技	35,000	713,300.00	0.25
25	600559	老白干酒	39,000	709,020.00	0.25
26	002139	拓邦股份	66,610	707,398.20	0.25
27	300049	福瑞股份	14,000	704,760.00	0.25
28	688235	百济神州	5,955	689,827.20	0.24
29	688676	海南金盘智能科技	12,611	657,663.65	0.23
30	301308	江波龙	6,800	644,232.00	0.23
31	002270	华明装	28,700	638,288.00	0.23

		备			
32	600100	同方股份	125,400	638,286.00	0.23
33	600761	安徽合力	29,409	636,410.76	0.23
34	300775	三角防务	20,700	633,420.00	0.22
35	000403	派林生物	23,500	626,510.00	0.22
36	600685	中船防务	22,100	616,590.00	0.22
37	600711	盛屯矿业	166,800	612,156.00	0.22
38	300315	掌趣科技	146,600	611,322.00	0.22
39	300762	上海瀚讯	33,800	605,358.00	0.21
40	000690	宝新能源	116,300	593,130.00	0.21
41	688019	安集科技	4,697	590,882.60	0.21
42	000415	渤海租赁	231,300	589,815.00	0.21
43	600285	羚锐制药	24,300	588,303.00	0.21
44	601333	广深铁路	180,900	586,116.00	0.21
45	000034	神州数码	25,400	581,406.00	0.21
46	688266	泽璟制药	10,421	565,026.62	0.20
47	688166	博瑞生物医药	16,121	564,235.00	0.20
48	300458	全志科技	23,700	557,187.00	0.20
49	000875	吉电股份	104,400	556,452.00	0.20
50	300083	创世纪	90,200	552,926.00	0.20
51	688608	恒玄科技	3,767	551,413.46	0.20
52	002312	川发龙蟒	80,800	543,784.00	0.19
53	600323	瀚蓝环	26,000	543,400.00	0.19

		境			
54	300679	电连技术	13,500	543,105.00	0.19
55	000422	湖北宜化	45,500	542,360.00	0.19
56	300115	长盈精密	45,100	540,749.00	0.19
57	605111	新洁能	17,644	539,729.96	0.19
58	600363	联创光电	19,600	539,392.00	0.19
59	000543	皖能电力	60,600	536,310.00	0.19
60	002402	和而泰	49,700	532,287.00	0.19
61	300294	博雅生物	16,000	528,000.00	0.19
62	688076	诺泰生物	6,700	524,476.00	0.19
63	300627	华测导航	17,400	519,390.00	0.18
64	002389	航天彩虹	37,200	516,708.00	0.18
65	601126	四方股份	26,600	511,252.00	0.18
66	688037	芯源微电子	5,736	510,504.00	0.18
67	300459	汤姆猫	150,100	508,839.00	0.18
68	688027	科大国盾量子	3,367	508,417.00	0.18
69	002837	英维克	23,739	507,777.21	0.18
70	688050	爱博诺德医疗	6,901	505,981.32	0.18
71	603283	赛腾股份	6,600	504,240.00	0.18
72	601375	中原证券	147,400	502,634.00	0.18
73	600422	昆药集团	28,160	502,092.80	0.18
74	688327	云从科技	44,200	499,902.00	0.18
75	000581	威孚高科	30,700	499,796.00	0.18
76	600908	无锡银行	93,400	496,888.00	0.18

77	002151	北斗星通	20,500	495,690.00	0.18
78	002807	江阴银行	131,400	495,378.00	0.18
79	600771	广誉远	26,200	493,346.00	0.17
80	603556	海兴电力	10,530	493,119.90	0.17
81	605090	九丰能源	16,740	485,460.00	0.17
82	601222	林洋能源	77,100	483,417.00	0.17
83	002332	仙琚制药	42,200	481,502.00	0.17
84	002851	麦格米特	18,600	480,624.00	0.17
85	002245	蔚蓝锂芯	61,700	478,175.00	0.17
86	300666	江丰电子	10,012	476,170.72	0.17
87	002145	中核钛白	144,900	475,272.00	0.17
88	000682	东方电子	42,800	472,512.00	0.17
89	603393	新天然气	13,600	472,464.00	0.17
90	600750	江中药业	20,300	469,133.00	0.17
91	603236	移远通信	10,008	467,673.84	0.17
92	000860	顺鑫农业	27,700	463,698.00	0.16
93	603083	剑桥科技	14,300	461,604.00	0.16
94	603300	华铁应急	84,120	459,295.20	0.16
95	300633	开立医疗	11,531	456,396.98	0.16
96	301301	川宁生物	35,700	456,246.00	0.16
97	600461	洪城环境	39,300	455,094.00	0.16
98	300757	罗博特科	5,200	454,220.00	0.16

99	300298	三诺生物	17,920	454,092.80	0.16
100	688278	特宝生物	8,453	452,658.15	0.16
101	002400	省广集团	93,200	452,020.00	0.16
102	600338	西藏珠峰	48,900	451,836.00	0.16
103	688568	中科星图公司	9,459	451,194.30	0.16
104	300857	协创数据	7,900	450,300.00	0.16
105	600667	太极实业	78,800	449,948.00	0.16
106	603505	金石资源	16,095	449,533.35	0.16
107	000951	中国重汽	31,300	448,216.00	0.16
108	600452	涪陵电力	35,340	447,757.80	0.16
109	688088	虹软科技	15,509	447,589.74	0.16
110	300624	万兴科技	8,431	447,433.17	0.16
111	600330	天通股份	65,700	446,760.00	0.16
112	002222	福晶科技	19,820	446,544.60	0.16
113	002745	木林森	55,300	445,718.00	0.16
114	300735	光弘科技	20,600	444,960.00	0.16
115	600331	宏达股份	75,900	439,461.00	0.16
116	300672	国科微	8,300	438,572.00	0.16
117	600821	金开新能	85,200	437,928.00	0.16
118	002832	比音勒芬	18,100	437,477.00	0.16
119	300133	华策影视	71,200	437,168.00	0.15
120	300045	华力创通	24,700	435,955.00	0.15
121	002675	东诚药	35,400	434,004.00	0.15



		业			
122	600201	生物股份	60,100	433,321.00	0.15
123	300456	赛微电子	27,300	433,251.00	0.15
124	600916	中国黄金	45,000	432,900.00	0.15
125	300475	香农芯创	14,600	431,722.00	0.15
126	600572	康恩贝	96,400	430,908.00	0.15
127	600718	东软集团	51,900	429,213.00	0.15
128	002773	康弘药业	19,800	428,670.00	0.15
129	600123	兰花科创	47,750	427,362.50	0.15
130	000035	中国天楹	94,330	427,314.90	0.15
131	600993	马应龙	16,000	426,720.00	0.15
132	002063	远光软件	81,316	426,095.84	0.15
133	600728	佳都科技	114,300	424,053.00	0.15
134	002249	大洋电机	89,300	422,389.00	0.15
135	000923	河钢资源	24,500	421,890.00	0.15
136	000628	高新发展	9,500	421,515.00	0.15
137	300182	捷成股份	113,600	421,456.00	0.15
138	002484	江海股份	31,800	421,350.00	0.15
139	300638	广和通	24,620	421,002.00	0.15
140	000686	东北证券	75,100	419,058.00	0.15
141	688596	正帆科技	12,668	418,044.00	0.15
142	300738	奥飞数据	41,264	417,591.68	0.15
143	002182	宝武镁业	37,020	417,585.60	0.15
144	002317	众生药	36,500	417,195.00	0.15

		业			
145	002015	协鑫能科	52,100	414,716.00	0.15
146	300705	九典制药	15,500	414,470.00	0.15
147	002221	东华能源	50,400	413,784.00	0.15
148	600057	厦门象屿	60,788	413,358.40	0.15
149	688333	西安铂力特	8,519	412,745.55	0.15
150	603588	高能环境	65,700	412,596.00	0.15
151	300525	博思软件	32,434	411,911.80	0.15
152	002544	普天科技	22,000	411,180.00	0.15
153	600641	万业企业	34,900	410,075.00	0.15
154	002567	唐人神	76,400	409,504.00	0.15
155	600587	新华医疗	25,960	408,610.40	0.14
156	300623	捷捷微电	23,600	408,280.00	0.14
157	600877	电科芯片	38,000	407,360.00	0.14
158	002100	天康生物	58,600	406,098.00	0.14
159	688498	源杰科技	3,100	406,069.00	0.14
160	600850	电科数字	22,290	403,449.00	0.14
161	000762	西藏矿业	22,300	403,184.00	0.14
162	300811	铂科新材	9,152	401,772.80	0.14
163	002701	奥瑞金	96,400	401,024.00	0.14
164	600601	方正科技	133,400	400,200.00	0.14
165	000902	新洋丰	33,700	400,019.00	0.14
166	300777	中简科技	18,600	399,900.00	0.14
167	300229	拓尔思	29,700	398,871.00	0.14

168	300761	立华股份	17,560	397,558.40	0.14
169	603279	景津装备	18,320	397,360.80	0.14
170	000970	中科三环	51,900	397,035.00	0.14
171	600216	浙江医药	36,100	396,378.00	0.14
172	688139	海尔生物	10,650	396,180.00	0.14
173	002747	埃斯顿	27,771	394,903.62	0.14
174	300034	钢研高纳	24,760	393,436.40	0.14
175	600064	南京高科	64,800	393,336.00	0.14
176	603565	中谷物流	45,000	393,300.00	0.14
177	002617	露笑科技	81,700	392,160.00	0.14
178	601860	紫金银行	156,800	392,000.00	0.14
179	603477	巨星农牧	13,600	390,320.00	0.14
180	002003	伟星股份	31,100	390,305.00	0.14
181	300075	数字政通	26,460	390,285.00	0.14
182	001696	宗申动力	36,600	389,424.00	0.14
183	600456	宝钛股份	15,221	388,592.13	0.14
184	688408	中信博新能源	4,215	388,117.20	0.14
185	600971	恒源煤电	32,300	385,662.00	0.14
186	000927	中国铁物	162,000	385,560.00	0.14
187	688062	迈威生物	13,300	384,902.00	0.14
188	600269	赣粤高速	74,400	384,648.00	0.14
189	600596	新安股份	50,600	384,560.00	0.14

190	600420	国药现代	36,000	384,480.00	0.14
191	002036	联创电子	56,700	382,725.00	0.14
192	601678	滨化股份	109,700	381,756.00	0.14
193	601137	博威合金	25,012	381,182.88	0.14
194	000917	电广传媒	75,438	380,961.90	0.13
195	600602	云赛智联	34,500	380,880.00	0.13
196	300068	南都电源	45,800	379,224.00	0.13
197	688639	华恒生物	4,964	379,199.96	0.13
198	600552	凯盛科技	40,200	379,086.00	0.13
199	000758	中色股份	74,400	377,952.00	0.13
200	002541	鸿路钢构	22,260	377,752.20	0.13
201	601187	厦门银行	70,600	376,298.00	0.13
202	300457	赢合科技	21,000	374,430.00	0.13
203	603871	嘉友国际	21,100	373,259.00	0.13
204	600595	中孚实业	149,600	372,504.00	0.13
205	603766	隆鑫通用	54,900	372,222.00	0.13
206	002839	张家港行	92,500	371,850.00	0.13
207	600273	嘉化能源	52,000	371,280.00	0.13
208	000012	南玻A	73,400	369,936.00	0.13
209	603323	苏农银行	76,900	369,889.00	0.13
210	601777	力帆科技	96,300	369,792.00	0.13
211	600179	安通控股	158,288	368,811.04	0.13

212	300236	上海新阳	11,800	367,452.00	0.13
213	300036	超图软件	26,300	367,148.00	0.13
214	600120	浙江东方	109,700	366,398.00	0.13
215	300482	万孚生物	15,000	366,000.00	0.13
216	603027	千禾味业	27,475	365,417.50	0.13
217	600320	振华重工	106,620	364,640.40	0.13
218	688575	亚辉龙生物	15,600	363,792.00	0.13
219	002335	科华数据	17,200	363,436.00	0.13
220	002737	葵花药业	15,500	362,390.00	0.13
221	600562	国睿科技	26,400	360,624.00	0.13
222	603678	火炬电子	14,600	360,474.00	0.13
223	688208	道通科技	14,900	359,686.00	0.13
224	300415	伊之密	17,300	359,494.00	0.13
225	002597	金禾实业	18,000	358,020.00	0.13
226	300327	中颖电子	18,150	357,192.00	0.13
227	300101	振芯科技	24,100	355,957.00	0.13
228	600633	浙数文化	40,400	355,924.00	0.13
229	002091	江苏国泰	52,200	355,482.00	0.13
230	000650	仁和药业	60,100	354,590.00	0.13
231	002075	沙钢股份	93,800	353,626.00	0.13
232	600246	万通发展	52,600	353,472.00	0.13
233	600116	三峡水利	51,200	353,280.00	0.13

234	600577	精达股份	88,800	352,536.00	0.12
235	600446	金证股份	35,500	352,515.00	0.12
236	600428	中远海特	57,500	351,900.00	0.12
237	000737	北方铜业	37,900	351,712.00	0.12
238	603599	广信股份	28,980	351,527.40	0.12
239	002237	恒邦股份	30,500	351,055.00	0.12
240	002416	爱施德	39,500	349,575.00	0.12
241	300130	新国都	21,000	349,440.00	0.12
242	300303	聚飞光电	71,900	349,434.00	0.12
243	688018	乐鑫科技	3,540	349,327.20	0.12
244	688116	天奈科技	15,100	348,508.00	0.12
245	300910	瑞丰新材	7,970	348,448.40	0.12
246	300319	麦捷科技	37,300	348,009.00	0.12
247	000829	天音控股	38,300	347,764.00	0.12
248	601778	晶科科技	152,500	347,700.00	0.12
249	603997	继峰股份	33,950	347,308.50	0.12
250	600621	华鑫股份	28,300	346,958.00	0.12
251	600210	紫江企业	65,000	345,800.00	0.12
252	600395	盘江股份	57,500	345,575.00	0.12
253	000685	中山公用	47,600	343,196.00	0.12
254	300026	红日药业	112,200	342,210.00	0.12
255	603108	润达医疗	22,500	340,650.00	0.12
256	000657	中钨高	37,250	340,465.00	0.12

		新			
257	603358	华达科技	11,800	340,430.00	0.12
258	603220	中贝通信	12,500	339,500.00	0.12
259	600976	健民集团	6,700	338,350.00	0.12
260	002020	京新药业	32,300	338,181.00	0.12
261	002048	宁波华翔	26,000	336,440.00	0.12
262	002192	融捷股份	11,200	336,224.00	0.12
263	002011	盾安环境	34,200	336,186.00	0.12
264	000028	国药一致	10,420	335,836.60	0.12
265	688289	圣湘生物	19,100	335,778.00	0.12
266	600782	新钢股份	100,800	334,656.00	0.12
267	002396	星网锐捷	25,300	334,213.00	0.12
268	002698	博实股份	27,200	333,744.00	0.12
269	301039	中集车辆	38,800	333,680.00	0.12
270	600986	浙文互联	79,400	333,480.00	0.12
271	688789	杭州宏华数码科技	3,090	333,102.00	0.12
272	300674	宇信科技	30,000	332,400.00	0.12
273	000420	吉林化纤	105,100	332,116.00	0.12
274	603690	至纯科技	14,420	331,804.20	0.12
275	600717	天津港	77,500	330,925.00	0.12
276	600409	三友化工	65,800	330,316.00	0.12
277	000676	智度股份	54,400	330,208.00	0.12

278	600459	贵研铂业	24,434	330,103.34	0.12
279	000801	四川九洲	33,000	330,000.00	0.12
280	002706	良信股份	48,000	329,280.00	0.12
281	001309	德明利	3,800	328,320.00	0.12
282	300035	中科电气	38,500	327,635.00	0.12
283	300284	苏交科	40,500	327,240.00	0.12
284	600072	中船科技	24,200	327,184.00	0.12
285	600328	中盐化工	47,530	326,055.80	0.12
286	002171	楚江新材	49,400	325,546.00	0.12
287	301050	雷电微力	6,748	324,983.68	0.12
288	002539	云图控股	45,500	324,415.00	0.11
289	600575	淮河能源	83,200	323,648.00	0.11
290	600645	中源协和	20,100	323,610.00	0.11
291	300244	迪安诊断	26,800	321,600.00	0.11
292	300170	汉得信息	52,340	321,367.60	0.11
293	002004	华邦健康	84,400	320,720.00	0.11
294	688110	东芯股份	16,800	320,376.00	0.11
295	300747	锐科激光	17,960	318,790.00	0.11
296	300773	拉卡拉	25,600	318,208.00	0.11
297	600267	海正药业	45,300	318,006.00	0.11
298	600252	中恒集团	146,500	317,905.00	0.11
299	002948	青岛银行	94,100	317,117.00	0.11
300	603308	应流股份	25,400	315,468.00	0.11



301	600864	哈投股份	66,300	314,925.00	0.11
302	600158	中体产业	40,800	313,752.00	0.11
303	601028	玉龙股份	25,100	313,750.00	0.11
304	600295	鄂尔多斯	31,580	313,273.60	0.11
305	002351	漫步者	23,820	313,233.00	0.11
306	000969	安泰科技	39,300	311,649.00	0.11
307	601963	重庆银行	40,200	311,550.00	0.11
308	600037	歌华有线	52,000	310,960.00	0.11
309	300618	寒锐钴业	11,700	309,465.00	0.11
310	688016	心脉医疗	3,156	309,445.80	0.11
311	600888	新疆众和	43,759	309,376.13	0.11
312	600586	金晶科技	53,221	308,681.80	0.11
313	002099	海翔药业	60,400	308,644.00	0.11
314	300079	数码视讯	76,000	308,560.00	0.11
315	600933	爱柯迪	20,800	307,632.00	0.11
316	002324	普利特	35,900	306,945.00	0.11
317	001301	尚太科技	7,100	306,862.00	0.11
318	002212	天融信	62,900	306,323.00	0.11
319	600688	上海石化	117,300	306,153.00	0.11
320	300188	国投智能	27,500	305,525.00	0.11
321	688518	联赢激光股份	18,273	305,159.10	0.11
322	000915	华特达因	10,100	304,616.00	0.11
323	300470	中密控股	9,000	304,290.00	0.11
324	002061	浙江交	83,340	304,191.00	0.11

		科			
325	002906	华阳集团	11,300	302,388.00	0.11
326	601311	骆驼股份	37,600	301,552.00	0.11
327	000681	视觉中国	26,200	301,300.00	0.11
328	300166	东方国信	49,200	301,104.00	0.11
329	002428	云南锗业	27,700	300,822.00	0.11
330	300109	新开源	25,977	300,813.66	0.11
331	688123	聚辰半导体	4,943	300,682.69	0.11
332	000821	京山轻机	26,500	300,245.00	0.11
333	002123	梦网科技	42,500	298,775.00	0.11
334	000727	冠捷科技	144,900	298,494.00	0.11
335	600259	广晟有色	10,900	298,006.00	0.11
336	300685	艾德生物	16,880	297,763.20	0.11
337	603026	石大胜华	8,800	297,440.00	0.11
338	002643	万润股份	29,700	297,000.00	0.11
339	000552	甘肃能化	85,500	296,685.00	0.11
340	603267	鸿远电子	8,700	296,670.00	0.11
341	600138	中青旅	30,700	296,562.00	0.11
342	688409	富创精密	8,023	296,369.62	0.11
343	002174	游族网络	39,000	296,010.00	0.10
344	600480	凌云股份	30,100	295,883.00	0.10
345	600720	中交设计	33,240	295,836.00	0.10
346	688100	威胜信息	7,754	295,815.10	0.10

347	002154	报喜鸟	54,300	295,392.00	0.10
348	603713	密尔克卫	5,517	295,269.84	0.10
349	601369	陕鼓动力	36,800	295,136.00	0.10
350	300678	中科信息	11,100	294,372.00	0.10
351	002079	苏州固锟	34,500	293,940.00	0.10
352	300576	容大感光	8,000	292,240.00	0.10
353	002727	一心堂	19,300	291,237.00	0.10
354	600248	陕建股份	80,100	290,763.00	0.10
355	600125	铁龙物流	48,700	290,739.00	0.10
356	601702	华峰铝业	15,900	290,334.00	0.10
357	002023	海特高新	31,700	290,055.00	0.10
358	601718	际华集团	116,700	289,416.00	0.10
359	000429	粤高速A	27,800	289,398.00	0.10
360	000555	神州信息	31,000	288,920.00	0.10
361	600557	康缘药业	18,400	288,880.00	0.10
362	002254	泰和新材	32,600	288,510.00	0.10
363	002214	大立科技	25,500	287,640.00	0.10
364	300185	通裕重工	166,800	286,896.00	0.10
365	600597	光明乳业	36,900	286,713.00	0.10
366	603063	禾望电气	18,700	286,671.00	0.10
367	002010	传化智联	74,500	286,080.00	0.10
368	600211	西藏药业	8,770	285,726.60	0.10

369	000049	德赛电 池	12,180	285,621.00	0.10
370	300655	晶瑞电 材	39,589	285,040.80	0.10
371	002038	双鹭药 业	38,500	283,745.00	0.10
372	600509	天富能 源	51,400	283,214.00	0.10
373	002292	奥飞娱 乐	47,300	282,854.00	0.10
374	600063	皖维高 新	80,300	282,656.00	0.10
375	002215	诺普 信	37,900	282,355.00	0.10
376	688739	成大生 物	11,609	281,402.16	0.10
377	688007	光峰科 技	17,473	281,315.30	0.10
378	300855	图南股 份	10,633	281,136.52	0.10
379	300570	太辰光	8,600	280,876.00	0.10
380	601101	昊华能 源	30,500	280,295.00	0.10
381	600507	方大特 钢	74,900	280,126.00	0.10
382	300783	三只松 鼠	12,800	279,936.00	0.10
383	300077	国民技 术	32,000	279,360.00	0.10
384	002239	奥特佳	121,400	279,220.00	0.10
385	300398	飞凯材 料	22,700	279,210.00	0.10
386	600055	万东医 疗	22,600	279,110.00	0.10
387	300343	联创股 份	58,613	278,997.88	0.10
388	002043	兔宝 宝	26,900	278,953.00	0.10
389	000090	天健集 团	69,312	278,634.24	0.10
390	300693	盛弘股 份	13,300	278,502.00	0.10
391	603920	世运电	14,100	278,334.00	0.10

		路			
392	002276	万马股份	38,800	278,196.00	0.10
393	688106	金宏气体	15,873	278,094.96	0.10
394	000065	北方国际	26,800	277,916.00	0.10
395	002233	塔牌集团	38,000	277,780.00	0.10
396	002315	焦点科技	10,300	277,688.00	0.10
397	600206	有研新材	31,200	277,680.00	0.10
398	002183	怡亚通	97,600	277,184.00	0.10
399	002446	盛路通信	49,000	276,850.00	0.10
400	688556	高测科技股份	23,246	276,394.94	0.10
401	301035	润丰股份	6,200	276,148.00	0.10
402	603699	纽威股份	16,100	275,632.00	0.10
403	600502	安徽建工	64,100	275,630.00	0.10
404	600635	大众公用	102,800	275,504.00	0.10
405	000811	冰轮环境	28,500	275,025.00	0.10
406	688798	艾为电子	4,854	274,833.48	0.10
407	002468	申通快递	32,700	274,680.00	0.10
408	688321	微芯生物	15,566	273,961.60	0.10
409	002840	华统股份	16,500	273,735.00	0.10
410	002815	崇达技术	29,100	272,958.00	0.10
411	600006	东风汽车	42,700	272,853.00	0.10
412	000582	北部湾港	36,600	272,304.00	0.10

413	002761	浙江建投	34,800	271,788.00	0.10
414	600059	古越龙山	34,200	271,548.00	0.10
415	688083	中望软件	3,735	271,235.70	0.10
416	002635	安洁科技	17,500	270,200.00	0.10
417	600961	株冶集团	28,600	269,984.00	0.10
418	600478	科力远	71,600	269,932.00	0.10
419	603281	江瀚新材	12,000	269,400.00	0.10
420	300151	昌红科技	17,000	268,940.00	0.10
421	600197	伊力特	15,100	268,931.00	0.10
422	300841	康华生物	5,300	268,392.00	0.10
423	600740	山西焦化	68,400	268,128.00	0.10
424	688183	生益电子	13,800	267,444.00	0.09
425	600729	重庆百货	11,952	267,246.72	0.09
426	300348	长亮科技	39,100	266,662.00	0.09
427	000848	承德露露	33,900	266,454.00	0.09
428	300113	顺网科技	26,000	266,240.00	0.09
429	300180	华峰超纤	75,400	266,162.00	0.09
430	688279	峰昭科技	2,400	266,160.00	0.09
431	002354	天娱数科	88,800	265,512.00	0.09
432	002421	达实智能	113,800	265,154.00	0.09
433	002726	龙大美食	40,400	265,024.00	0.09
434	300598	诚迈科技	9,420	264,513.60	0.09
435	000603	盛达资	22,300	263,809.00	0.09

		源			
436	600017	日照港	98,800	263,796.00	0.09
437	688403	汇成股份	31,100	263,728.00	0.09
438	002895	川恒股份	14,400	263,664.00	0.09
439	601952	苏垦农发	29,200	263,384.00	0.09
440	000913	钱江摩托	16,700	263,192.00	0.09
441	600773	西藏城投	25,500	263,160.00	0.09
442	002006	精工科技	19,600	263,032.00	0.09
443	300463	迈克生物	23,100	262,878.00	0.09
444	002847	盐津铺子	6,139	262,565.03	0.09
445	000810	创维数字	30,600	262,548.00	0.09
446	600531	豫光金铅	40,700	262,108.00	0.09
447	600757	长江传媒	32,500	261,950.00	0.09
448	000901	航天科技	29,800	261,048.00	0.09
449	603368	柳药集团	14,900	260,750.00	0.09
450	603612	索通发展	20,400	260,304.00	0.09
451	000966	长源电力	59,000	260,190.00	0.09
452	600305	恒顺醋业	35,900	259,557.00	0.09
453	300827	上能电气	11,608	259,554.88	0.09
454	002081	金螳螂	85,600	259,368.00	0.09
455	603033	三维股份	22,074	258,265.80	0.09
456	002960	青鸟消防	20,395	257,792.80	0.09
457	600266	城建发	68,800	257,312.00	0.09

		展			
458	601163	三角轮胎	16,900	257,218.00	0.09
459	600012	皖通高速	18,400	257,048.00	0.09
460	600550	保变电气	49,300	256,853.00	0.09
461	600185	格力地产	60,300	256,275.00	0.09
462	002458	益生股份	29,500	255,470.00	0.09
463	688630	芯碁微装	4,080	255,285.60	0.09
464	603197	保隆科技	8,100	255,150.00	0.09
465	000928	中钢国际	45,900	254,745.00	0.09
466	600797	浙大网新	55,000	254,650.00	0.09
467	601200	上海环境	29,900	254,150.00	0.09
468	300065	海兰信	38,400	253,824.00	0.09
469	300123	亚光科技	54,660	253,622.40	0.09
470	000488	晨鸣纸业	73,300	253,618.00	0.09
471	601890	亚星锚链	35,900	253,095.00	0.09
472	002226	江南化工	56,400	252,672.00	0.09
473	300432	富临精工	39,200	252,448.00	0.09
474	688366	昊海生物科技	4,091	252,332.88	0.09
475	300770	新媒股份	7,530	251,351.40	0.09
476	603306	华懋科技	13,900	251,173.00	0.09
477	300428	立中集团	13,500	250,965.00	0.09
478	601208	东材科技	34,500	250,470.00	0.09
479	300620	光库科	6,800	250,104.00	0.09



		技			
480	300031	宝通科技	17,400	250,038.00	0.09
481	600996	贵广网络	32,550	249,984.00	0.09
482	002649	博彦科技	31,400	249,944.00	0.09
483	600776	东方通信	25,377	249,455.91	0.09
484	003021	兆威机电	5,400	249,210.00	0.09
485	603100	川仪股份	10,600	249,206.00	0.09
486	002511	中顺洁柔	35,900	248,428.00	0.09
487	600869	远东股份	71,000	247,790.00	0.09
488	688503	聚和材料股份公司	8,800	247,280.00	0.09
489	601528	瑞丰银行	52,370	247,186.40	0.09
490	301219	腾远钴业	6,460	247,159.60	0.09
491	002467	二六三	73,900	246,826.00	0.09
492	002681	奋达科技	67,600	246,740.00	0.09
493	300027	华谊兄弟	148,500	246,510.00	0.09
494	600033	福建高速	73,500	246,225.00	0.09
495	300171	东富龙	20,700	246,123.00	0.09
496	300416	苏试试验	19,100	245,626.00	0.09
497	603881	数据港	19,320	245,557.20	0.09
498	000503	国新健康	36,800	245,456.00	0.09
499	603919	金徽酒	13,500	245,295.00	0.09
500	603008	喜临门	14,100	244,353.00	0.09
501	300379	东方通	30,240	244,339.20	0.09
502	002705	新宝股份	17,300	243,411.00	0.09
503	300233	金城医	16,310	243,345.20	0.09

		药			
504	300232	洲明科技	46,600	243,252.00	0.09
505	000550	江铃汽车	11,198	243,108.58	0.09
506	002097	山河智能	40,300	243,009.00	0.09
507	603128	华贸物流	42,100	242,917.00	0.09
508	300224	正海磁材	26,200	242,612.00	0.09
509	000600	建投能源	38,500	242,550.00	0.09
510	600151	航天机电	53,600	242,272.00	0.09
511	000990	诚志股份	32,500	241,800.00	0.09
512	688559	海目星激光	7,346	241,609.94	0.09
513	300406	九强生物	15,700	241,466.00	0.09
514	300634	彩讯股份	14,300	240,669.00	0.09
515	600675	中华企业	97,400	240,578.00	0.09
516	601326	秦港股份	75,800	240,286.00	0.09
517	000837	秦川机床	32,600	239,936.00	0.09
518	300455	航天智装	19,400	239,784.00	0.08
519	688192	迪哲医药	6,500	239,460.00	0.08
520	300129	泰胜风能	35,100	239,382.00	0.08
521	002127	南极电商	91,600	238,160.00	0.08
522	300352	北信源	61,800	237,312.00	0.08
523	600007	中国国贸	10,800	237,168.00	0.08
524	601619	嘉泽新能	78,200	236,946.00	0.08
525	002583	海能达	58,200	236,874.00	0.08

525	300856	科思股份	7,400	236,874.00	0.08
527	601519	大智慧	42,600	236,856.00	0.08
528	300366	创意信息	32,700	236,748.00	0.08
529	603888	新华网	11,000	236,610.00	0.08
530	300596	利安隆	8,700	236,031.00	0.08
531	688141	杰华特微电子	14,600	235,936.00	0.08
532	688262	苏州国芯科技	12,953	235,874.13	0.08
533	300602	飞荣达	15,500	234,205.00	0.08
534	002626	金达威	16,200	234,090.00	0.08
535	600997	开滦股份	34,100	233,926.00	0.08
536	002498	汉缆股份	71,100	233,919.00	0.08
537	301071	力量钻石	8,440	233,872.40	0.08
538	300393	中来股份	40,500	233,685.00	0.08
539	600623	华谊集团	40,400	233,512.00	0.08
540	600389	江山股份	16,545	233,449.95	0.08
541	002859	洁美科技	11,600	232,928.00	0.08
542	300725	药石科技	8,700	232,899.00	0.08
543	300593	新雷能	23,251	231,114.94	0.08
544	301095	广立微	5,600	230,272.00	0.08
545	000767	晋控电力	98,600	229,738.00	0.08
546	300260	新莱应材	10,920	228,664.80	0.08
547	001914	招商积余	22,800	228,456.00	0.08
548	300451	创业慧康	66,000	228,360.00	0.08
549	600710	苏美达	28,000	228,200.00	0.08
550	002993	奥海科技	6,130	228,036.00	0.08
551	002777	久远银	15,200	227,848.00	0.08

		海			
552	603936	博敏电子	27,000	226,800.00	0.08
553	688318	财富趋势	2,873	226,708.43	0.08
554	002605	姚记科技	11,100	226,662.00	0.08
555	600110	诺德股份	74,300	226,615.00	0.08
556	002274	华昌化工	30,500	226,310.00	0.08
557	002545	东方铁塔	33,200	226,092.00	0.08
558	603039	泛微网络	7,100	225,496.00	0.08
559	002537	海联金汇	43,600	225,412.00	0.08
560	600313	农发种业	40,300	225,277.00	0.08
561	000950	重药控股	46,200	224,994.00	0.08
562	600649	城投控股	67,700	224,764.00	0.08
563	000756	新华制药	15,500	224,440.00	0.08
564	600787	中储股份	46,600	224,146.00	0.08
565	600458	时代新材	22,100	223,210.00	0.08
566	688658	悦康药业	12,500	223,000.00	0.08
567	601801	皖新传媒	32,100	222,453.00	0.08
568	301171	易点天下	15,100	221,970.00	0.08
569	688362	甬矽电子	11,400	221,844.00	0.08
570	000719	中原传媒	21,900	221,409.00	0.08
571	002929	润建股份	7,600	221,236.00	0.08
572	603876	鼎胜新材	23,800	220,626.00	0.08

573	002077	大港股份	18,500	220,520.00	0.08
574	003006	百亚股份	9,300	220,410.00	0.08
575	300087	荃银高科	35,620	220,131.60	0.08
576	002550	千红制药	40,800	219,912.00	0.08
577	600496	精工钢构	85,700	219,392.00	0.08
578	688322	奥比中光	8,200	219,022.00	0.08
579	603383	顶点软件	6,800	218,076.00	0.08
580	600508	上海能源	15,400	217,910.00	0.08
581	002108	沧州明珠	71,200	217,872.00	0.08
582	300772	运达股份	22,660	217,536.00	0.08
583	002928	华夏航空	34,200	216,828.00	0.08
584	300263	隆华科技	38,700	216,720.00	0.08
585	603533	掌阅科技	11,600	216,572.00	0.08
586	603866	桃李面包	42,700	216,489.00	0.08
587	300257	开山股份	21,400	216,140.00	0.08
588	600366	宁波韵升	41,400	216,108.00	0.08
589	000059	华锦股份	51,300	214,947.00	0.08
590	603567	珍宝岛	20,400	214,812.00	0.08
591	600963	岳阳林纸	58,100	213,227.00	0.08
592	600490	鹏欣资源	82,000	213,200.00	0.08
593	600751	海航科技	96,000	213,120.00	0.08
594	300687	赛意信息	15,300	212,976.00	0.08

595	300409	道氏技术	24,800	212,288.00	0.08
596	000735	罗牛山	49,000	212,170.00	0.08
597	603583	捷昌驱动	10,400	211,952.00	0.08
598	600556	天下秀	58,200	211,848.00	0.08
599	001270	铖昌科技	5,760	211,507.20	0.07
600	300671	富满微	8,320	211,494.40	0.07
601	603328	依顿电子	26,800	210,648.00	0.07
602	300613	富瀚微	6,376	209,834.16	0.07
603	002925	盈趣科技	16,500	209,055.00	0.07
604	605599	菜百股份	16,400	208,772.00	0.07
605	688439	振华风光	3,140	208,653.00	0.07
606	601969	海南矿业	32,900	208,586.00	0.07
607	688066	北京航天宏图	11,682	207,939.60	0.07
608	300363	博腾股份	17,400	207,930.00	0.07
609	000088	盐田港	45,800	207,474.00	0.07
610	002390	信邦制药	62,600	207,206.00	0.07
611	600477	杭萧钢构	88,800	206,904.00	0.07
612	002258	利尔化学	25,720	206,274.40	0.07
613	002060	广东建工	60,300	206,226.00	0.07
614	688127	蓝特光学	11,173	205,471.47	0.07
615	002216	三全食品	18,700	205,326.00	0.07
616	002434	万里扬	41,800	204,820.00	0.07
617	600966	博汇纸业	42,800	204,584.00	0.07
618	600195	中牧股	27,200	203,728.00	0.07

		份			
619	001287	中电港	12,300	203,319.00	0.07
620	300226	上海钢联	12,000	203,280.00	0.07
621	300726	宏达电子	8,909	203,125.20	0.07
622	688270	浙江臻镭科技股份	7,780	203,058.00	0.07
623	002219	新里程	109,000	202,740.00	0.07
624	688700	东威科技	7,727	202,524.67	0.07
625	301015	百洋医药	8,600	202,358.00	0.07
626	000795	英洛华	36,500	202,210.00	0.07
627	688167	西安炬光科技	3,670	201,850.00	0.07
628	600775	南京熊猫	25,200	201,600.00	0.07
629	300119	瑞普生物	14,800	201,576.00	0.07
630	605333	沪光股份	7,200	200,520.00	0.07
631	000828	东莞控股	22,200	200,022.00	0.07
632	002697	红旗连锁	43,200	200,016.00	0.07
633	688158	优刻得科技	19,540	199,894.20	0.07
634	301087	可孚医疗	5,890	199,671.00	0.07
635	301047	义翘神州	3,330	199,633.50	0.07
636	603348	文灿股份	7,200	199,368.00	0.07
637	688696	极米科技	2,575	198,893.00	0.07
638	688598	金博碳素股份	7,024	198,779.20	0.07
639	002349	精华制药	30,300	198,768.00	0.07
640	603733	仙鹤股份	11,300	198,654.00	0.07

641	002125	湘潭电化	20,400	198,492.00	0.07
642	002985	北摩高科	9,000	198,270.00	0.07
643	605507	国邦医药	11,900	198,135.00	0.07
644	600169	太原重工	108,100	197,823.00	0.07
645	600861	北京人力	12,100	197,472.00	0.07
646	300663	科蓝软件	20,000	197,400.00	0.07
647	600835	上海机电	17,100	196,821.00	0.07
648	300332	天壕能源	37,000	196,470.00	0.07
649	002191	劲嘉股份	54,400	196,384.00	0.07
650	688690	纳微科技	11,300	196,281.00	0.07
651	000935	四川双马	16,300	195,763.00	0.07
652	603043	广州酒家	12,240	195,472.80	0.07
653	601908	京运通	77,200	195,316.00	0.07
654	300203	聚光科技	19,300	194,737.00	0.07
655	601882	海天精工	8,500	194,735.00	0.07
656	600163	中闽能源	40,400	194,728.00	0.07
657	301363	美好医疗	6,700	194,300.00	0.07
658	600073	光明肉业	35,200	193,952.00	0.07
659	300723	一品红	9,850	193,552.50	0.07
660	000048	京基智农	14,100	193,029.00	0.07
661	688389	深圳普门科技	11,845	192,599.70	0.07
662	600223	福瑞达	27,200	192,304.00	0.07
663	002158	汉钟精机	11,500	192,280.00	0.07



664	601595	上海电影	9,700	191,866.00	0.07
665	300261	雅本化学	36,200	191,860.00	0.07
666	605376	博迁新材	8,500	191,845.00	0.07
667	600812	华北制药	46,300	190,756.00	0.07
668	002250	联化科技	39,500	189,600.00	0.07
669	600929	雪天盐业	35,700	189,210.00	0.07
670	001213	中铁特货	47,600	188,020.00	0.07
671	600391	航发科技	12,300	187,575.00	0.07
672	600075	新疆天业	54,300	187,335.00	0.07
673	300443	金雷股份	12,200	187,026.00	0.07
674	603638	艾迪精密	13,300	186,599.00	0.07
675	601038	一拖股份	11,800	186,558.00	0.07
676	601606	长城军工	19,500	186,420.00	0.07
677	300323	华灿光电	42,800	186,180.00	0.07
678	002320	海峡股份	36,000	185,760.00	0.07
679	002101	广东鸿图	17,600	185,328.00	0.07
680	600335	国机汽车	32,100	185,217.00	0.07
681	000627	天茂集团	105,800	185,150.00	0.07
682	600639	浦东金桥	18,100	184,801.00	0.07
683	688239	贵州航宇科技	5,300	184,440.00	0.07
684	300085	银之杰	22,800	184,224.00	0.07
685	601107	四川成渝	35,000	183,750.00	0.07

686	603801	志邦家居	14,029	183,499.32	0.07
687	600874	创业环保	32,800	183,352.00	0.06
688	002051	中工国际	26,300	183,048.00	0.06
689	603398	沐邦高科	11,700	182,637.00	0.06
690	601921	浙版传媒	23,900	182,596.00	0.06
691	002585	双星新材	36,800	182,528.00	0.06
692	002283	天润工业	42,500	182,325.00	0.06
693	688190	云路先进材料股份	2,436	181,993.56	0.06
694	002967	广电计量	15,400	181,720.00	0.06
695	601515	东峰集团	49,600	181,040.00	0.06
696	301155	海力风电	4,500	181,035.00	0.06
697	300820	英杰电气	4,600	180,964.00	0.06
698	603896	寿仙谷	7,700	180,719.00	0.06
699	600780	通宝能源	30,600	180,540.00	0.06
700	300039	上海凯宝	33,700	180,295.00	0.06
701	002243	力合科创	32,600	180,278.00	0.06
702	600682	南京新百	36,100	180,139.00	0.06
703	000712	锦龙股份	24,000	180,000.00	0.06
704	688388	嘉元科技	18,435	179,741.25	0.06
705	002267	陕天然气	23,700	179,172.00	0.06
706	601949	中国出版	30,300	179,073.00	0.06
707	300660	江苏雷利	7,000	178,640.00	0.06

708	600449	宁夏建 材	15,200	178,600.00	0.06
709	002053	云南能 投	14,700	177,723.00	0.06
710	000061	农产 品	36,500	177,390.00	0.06
711	600648	外高桥	20,000	177,200.00	0.06
712	002194	武汉凡 谷	22,000	177,100.00	0.06
713	000557	西部创 业	47,000	176,720.00	0.06
714	601609	金田股 份	31,200	176,592.00	0.06
715	300587	天铁股 份	43,700	176,548.00	0.06
716	300821	东岳硅 材	25,700	175,788.00	0.06
717	603171	税友股 份	6,500	175,760.00	0.06
718	002204	大连重 工	41,100	175,497.00	0.06
719	601096	宏盛华 源铁塔 集团	42,900	175,461.00	0.06
720	603730	岱美股 份	17,629	175,232.26	0.06
721	000498	山东路 桥	33,500	175,205.00	0.06
722	603566	普莱柯	12,900	175,182.00	0.06
723	301238	瑞泰新 材	11,700	175,149.00	0.06
724	002461	珠江啤 酒	23,500	174,370.00	0.06
725	000567	海德股 份	31,054	174,212.94	0.06
726	605123	派克新 材	3,100	174,158.00	0.06
727	002163	海南发 展	31,600	173,168.00	0.06
728	601069	西部黄 金	14,800	172,124.00	0.06
729	688508	芯朋微 电子	4,720	171,666.40	0.06

730	688339	亿华通科技	5,726	171,665.48	0.06
731	002941	新疆交建	17,200	171,656.00	0.06
732	002987	京北方	16,271	171,333.63	0.06
733	301175	中科环保	39,000	171,210.00	0.06
734	600882	妙可蓝多	13,701	170,851.47	0.06
735	603118	共进股份	25,500	170,850.00	0.06
736	002242	九阳股份	16,300	170,824.00	0.06
737	002068	黑猫股份	24,000	170,400.00	0.06
738	002291	遥望科技	39,500	169,850.00	0.06
739	688298	东方基因生物	6,221	168,900.15	0.06
740	002581	未名医药	17,500	168,875.00	0.06
741	002891	中宠股份	8,080	168,629.60	0.06
742	000688	国城矿业	17,700	168,504.00	0.06
743	688400	凌云光技术	10,100	168,468.00	0.06
744	603187	海容冷链	14,440	168,370.40	0.06
745	000885	城发环境	13,800	167,946.00	0.06
746	600217	中再资环	44,500	167,320.00	0.06
747	300527	中船应急	25,600	165,632.00	0.06
748	301153	中科江南	5,860	165,603.60	0.06
749	300358	楚天科技	22,200	165,168.00	0.06
750	603025	大豪科技	11,940	165,010.80	0.06
751	002612	朗姿股份	11,900	164,458.00	0.06

752	301031	中熔电气	2,000	164,400.00	0.06
753	000881	中广核技	25,500	164,220.00	0.06
754	002488	金固股份	37,400	164,186.00	0.06
755	600643	爱建集团	43,300	163,241.00	0.06
756	601869	长飞光纤	6,700	163,011.00	0.06
757	603466	风语筑	19,072	162,874.88	0.06
758	000968	蓝焰控股	25,600	162,816.00	0.06
759	000736	中交地产	18,300	162,504.00	0.06
760	000869	张裕A	7,600	162,260.00	0.06
761	300737	科顺股份	37,700	162,110.00	0.06
762	688707	振华新材料	16,500	160,710.00	0.06
763	001337	四川黄金	6,900	160,149.00	0.06
764	688343	云天励飞股份	5,600	159,880.00	0.06
765	000672	上峰水泥	26,120	159,854.40	0.06
766	688351	微创电生理股份	7,245	159,679.80	0.06
767	600225	卓朗科技	91,700	159,558.00	0.06
768	688586	中航飞机装备	17,146	159,457.80	0.06
769	301291	明阳电气	5,300	159,265.00	0.06
770	000791	甘肃能源	25,700	158,569.00	0.06
771	002096	易普力	13,300	158,270.00	0.06
772	605020	永和股份	8,240	158,043.20	0.06
773	603299	苏盐井神	16,600	157,700.00	0.06

774	002746	仙坛股份	27,500	157,575.00	0.06
775	300143	盈康生命	20,900	157,377.00	0.06
776	600491	龙元建设	57,400	157,276.00	0.06
777	301316	慧博云通	10,700	157,076.00	0.06
778	603169	兰石重装	34,900	157,050.00	0.06
779	601033	永兴股份	9,700	157,043.00	0.06
780	603229	奥翔药业	15,620	156,981.00	0.06
781	603595	东尼电子	7,608	156,648.72	0.06
782	002646	天佑德酒	15,300	156,519.00	0.06
783	605168	三人行	5,943	156,479.19	0.06
784	603327	福蓉科技	12,090	155,840.10	0.06
785	603212	赛伍技术	14,000	154,560.00	0.05
786	301216	万凯新材	13,750	153,862.50	0.05
787	688261	东微半导体	2,980	153,112.40	0.05
788	003040	楚天龙	12,400	152,520.00	0.05
789	300369	绿盟科技	29,800	152,278.00	0.05
789	603301	振德医疗	7,300	152,278.00	0.05
791	003012	东鹏控股	24,900	152,139.00	0.05
792	600058	五矿发展	23,000	151,800.00	0.05
793	000029	深深房A	14,200	150,946.00	0.05
794	002041	登海种业	18,500	149,480.00	0.05
795	301078	孩子王	29,500	149,270.00	0.05
796	002034	旺能环境	11,460	149,094.60	0.05

797	600662	外服控股	36,900	147,969.00	0.05
798	688097	博众精工科技	6,943	147,747.04	0.05
799	000062	深圳华强	16,600	147,740.00	0.05
800	600783	鲁信创投	15,800	147,414.00	0.05
801	002378	章源钨业	25,560	146,714.40	0.05
802	600651	飞乐音响	53,100	146,556.00	0.05
803	300953	震裕科技	2,700	146,340.00	0.05
804	603636	南威软件	19,000	146,300.00	0.05
805	000597	东北制药	37,800	146,286.00	0.05
806	002135	东南网架	36,800	145,728.00	0.05
807	300850	新强联	9,700	145,694.00	0.05
808	300579	数字认证	7,450	145,275.00	0.05
809	603055	台华新材	14,300	144,859.00	0.05
810	002913	奥士康	5,400	144,774.00	0.05
811	688033	天宜上佳	24,037	144,222.00	0.05
812	688091	上海谊众药业	6,380	144,124.20	0.05
813	603915	国茂股份	14,000	144,060.00	0.05
814	300183	东软载波	12,400	143,592.00	0.05
815	688326	经纬恒润	2,495	143,038.35	0.05
816	002516	旷达科技	39,200	142,688.00	0.05
817	002265	建设工业	16,500	142,395.00	0.05
818	688711	江苏宏微科技	8,862	142,323.72	0.05
819	688048	长光华	4,543	141,923.32	0.05

		芯			
820	300134	大富科技	20,800	141,856.00	0.05
821	000025	特力A	10,500	141,120.00	0.05
822	002302	西部建设	27,100	140,920.00	0.05
823	603985	恒润股份	11,800	140,420.00	0.05
824	600657	信达地产	46,000	140,300.00	0.05
825	600301	华锡有色	6,900	139,518.00	0.05
826	603906	龙蟠科技	17,900	139,441.00	0.05
827	603297	永新光学	2,300	139,127.00	0.05
828	603105	芯能科技	15,800	139,040.00	0.05
829	300267	尔康制药	66,655	138,642.40	0.05
830	002489	浙江永强	58,400	138,408.00	0.05
831	600810	神马股份	22,300	138,260.00	0.05
832	688800	瑞可达连接系统	4,920	138,153.60	0.05
833	301239	普瑞眼科	3,900	137,787.00	0.05
834	000517	荣安地产	51,400	137,752.00	0.05
835	002190	成飞集成	9,700	136,964.00	0.05
836	688031	星环科技	3,712	136,267.52	0.05
837	000718	苏宁环球	81,000	136,080.00	0.05
838	300702	天宇股份	7,600	135,508.00	0.05
839	301339	通行宝	6,800	135,252.00	0.05
840	603162	海通发展	14,500	134,850.00	0.05



841	688232	国泰新点软件	6,800	134,096.00	0.05
842	301268	铭利达	8,600	133,730.00	0.05
843	688177	百奥泰生物	6,300	133,056.00	0.05
844	688432	有研硅	13,700	132,753.00	0.05
845	000030	富奥股份	27,000	132,570.00	0.05
846	002088	鲁阳节能	10,900	131,781.00	0.05
847	300206	理邦仪器	15,300	131,427.00	0.05
848	001338	永顺泰	13,400	131,320.00	0.05
849	002453	华软科技	30,500	130,845.00	0.05
850	600604	市北高新	37,700	130,442.00	0.05
851	688336	三生国健	6,400	130,240.00	0.05
852	600475	华光环能	14,900	129,779.00	0.05
853	301080	百普赛斯	3,700	129,500.00	0.05
854	603609	禾丰股份	19,800	129,492.00	0.05
855	688268	广东华特气体	2,500	129,025.00	0.05
856	603123	翠微股份	21,700	128,898.00	0.05
857	688776	国光电气	2,300	127,420.00	0.05
858	688131	皓元医药	6,636	126,946.68	0.04
859	000016	深康佳A	59,500	126,735.00	0.04
860	301217	铜冠铜箔	13,200	126,720.00	0.04
861	688381	帝奥微电子	6,500	126,620.00	0.04
862	605009	豪悦护理	3,200	126,208.00	0.04
863	301205	联特科技	2,000	125,500.00	0.04

864	300768	迪普科技	10,500	124,425.00	0.04
865	603113	金能科技	22,700	124,169.00	0.04
866	003009	中天火箭	3,200	123,776.00	0.04
867	301498	乖宝宠物	2,300	123,740.00	0.04
868	301293	三博脑科	3,250	122,492.50	0.04
869	603989	艾华集团	8,700	122,322.00	0.04
870	688105	诺唯赞生物	6,100	122,061.00	0.04
871	688515	裕太微电子	2,100	121,800.00	0.04
872	601015	陕西黑猫	43,267	121,147.60	0.04
873	000813	德展健康	58,200	121,056.00	0.04
874	300382	斯莱克	20,300	119,973.00	0.04
875	603530	神马电力	4,500	119,205.00	0.04
876	688023	安恒信息	2,966	118,669.66	0.04
877	002314	南山控股	57,300	118,611.00	0.04
878	002534	西子洁能	11,800	118,118.00	0.04
879	601886	江河集团	24,200	118,096.00	0.04
880	001323	慕思股份	4,100	117,957.00	0.04
881	002275	桂林三金	9,500	117,895.00	0.04
882	688147	微导纳米科技	4,700	117,030.00	0.04
883	301207	华兰疫苗	6,600	116,622.00	0.04
884	002782	可立克	10,500	116,340.00	0.04
885	301246	宏源药业	8,600	115,756.00	0.04
886	301367	怡和嘉	1,860	115,692.00	0.04

		业			
887	300080	易成新能	40,100	115,488.00	0.04
888	002959	小熊电器	2,400	115,464.00	0.04
889	002991	甘源食品	1,900	115,235.00	0.04
890	688372	伟测科技	2,926	115,079.58	0.04
891	300869	康泰医学	8,800	115,016.00	0.04
892	688484	南芯科技	3,100	115,010.00	0.04
893	688686	奥普特科技	1,794	114,869.82	0.04
894	601011	宝泰隆	71,500	114,400.00	0.04
895	002978	安宁股份	4,100	114,226.00	0.04
896	603071	物产环能	9,100	114,023.00	0.04
897	600903	贵州燃气	18,200	113,568.00	0.04
898	603013	亚普股份	8,400	113,148.00	0.04
899	603983	丸美股份	4,100	112,873.00	0.04
900	300894	火星人	8,780	112,559.60	0.04
901	603439	贵州三力	8,800	112,288.00	0.04
902	002901	大博医疗	4,300	111,069.00	0.04
903	688209	英集芯科技	8,945	111,007.45	0.04
904	603693	江苏新能	9,500	110,390.00	0.04
905	600691	阳煤化工	63,800	109,098.00	0.04
906	603666	亿嘉和	6,900	108,882.00	0.04
907	301327	华宝新能	1,900	108,870.00	0.04
908	688202	美迪西生物医药	4,173	108,706.65	0.04

909	300446	航天智造	9,100	108,290.00	0.04
910	688146	中船派瑞特气	3,600	107,460.00	0.04
911	603877	太平鸟	7,800	107,094.00	0.04
912	603718	海利生物	17,300	106,741.00	0.04
913	603995	甬金股份	6,075	106,434.00	0.04
914	688526	武汉科前生物	7,242	106,384.98	0.04
915	600400	红豆股份	49,000	106,330.00	0.04
916	600610	中毅达	26,700	106,266.00	0.04
917	600618	氯碱化工	12,100	106,238.00	0.04
918	605222	起帆电缆	6,900	105,846.00	0.04
919	688001	苏州华兴源创科技	4,665	105,335.70	0.04
920	688383	新益昌科技	2,016	105,053.76	0.04
921	603170	宝立食品科技	8,800	104,544.00	0.04
922	688380	中微半导	6,200	103,664.00	0.04
923	688392	骄成超声波	2,437	103,426.28	0.04
924	001258	立新能源	14,800	102,564.00	0.04
925	688502	茂莱光学	1,100	102,311.00	0.04
926	300741	华宝股份	6,700	102,108.00	0.04
927	603719	良品铺子	8,700	101,529.00	0.04
928	688206	概伦电子	6,800	100,980.00	0.04
929	000019	深粮控股	17,500	100,450.00	0.04
930	601083	锦江航运	10,500	100,380.00	0.04

931	688368	晶丰明源半导体	1,808	100,163.20	0.04
932	301526	国际复材	29,900	99,567.00	0.04
933	000761	本钢板材	39,200	98,392.00	0.03
934	300973	立高食品	3,500	98,315.00	0.03
935	688352	顾中科技	8,600	98,126.00	0.03
936	301089	拓新药业	3,300	97,911.00	0.03
937	603938	三孚股份	8,320	97,760.00	0.03
938	001308	康冠科技	4,300	96,750.00	0.03
939	301325	曼恩斯特	2,240	95,020.80	0.03
940	301348	蓝箭电子	3,100	94,209.00	0.03
941	688173	希荻微电子	8,521	93,986.63	0.03
942	688337	普源精电	3,712	93,616.64	0.03
943	688185	康希诺生物	2,276	93,520.84	0.03
944	002549	凯美特气	18,300	93,513.00	0.03
945	300755	华致酒行	6,800	92,888.00	0.03
946	601811	新华文轩	6,600	92,466.00	0.03
947	603098	森特股份	11,700	91,962.00	0.03
948	002651	利君股份	16,600	91,134.00	0.03
949	301069	凯盛新材	6,900	90,459.00	0.03
950	001311	多利科技	3,710	89,707.80	0.03
951	300140	节能环保	14,900	88,953.00	0.03
952	002911	佛燃能	9,649	88,191.86	0.03

		源			
953	688046	药康生物	8,553	87,411.66	0.03
954	688680	海优新材	3,013	86,593.62	0.03
955	603093	南华期货	9,900	85,734.00	0.03
956	300887	谱尼测试	11,530	85,322.00	0.03
957	000058	深赛格	15,700	84,309.00	0.03
958	003039	顺控发展	6,700	83,951.00	0.03
959	001269	欧晶科技	3,000	83,400.00	0.03
960	002946	新乳业	9,400	82,344.00	0.03
961	603132	金徽股份	5,900	81,184.00	0.03
962	002990	盛视科技	4,000	80,520.00	0.03
963	301487	盟固利	3,100	80,166.00	0.03
964	002961	瑞达期货	7,200	78,840.00	0.03
965	001322	箭牌家居	10,400	76,024.00	0.03
966	688128	中国电器研究院	4,240	72,970.40	0.03
967	301559	中集环科	5,000	72,850.00	0.03
968	301558	三态股份	8,600	72,154.00	0.03
969	688315	诺禾致源科技	6,560	71,635.20	0.03
970	301371	敷尔佳	2,300	71,438.00	0.03
971	002287	奇正藏药	3,600	70,488.00	0.02
972	603489	八方股份	2,600	70,148.00	0.02
973	601022	宁波远洋	7,800	68,796.00	0.02
974	601068	中铝国际	16,000	67,360.00	0.02

975	600403	大有能源	25,900	66,822.00	0.02
976	301511	德福科技	4,500	66,420.00	0.02
977	603057	上海紫燕食品	4,200	64,344.00	0.02
978	300860	锋尚文化	3,000	63,120.00	0.02
979	688152	麒麟信安	1,600	61,952.00	0.02
980	001236	弘业期货	8,300	59,013.00	0.02
981	301510	固高科技	2,100	58,275.00	0.02
982	301090	华润材料	8,800	57,904.00	0.02
983	688531	日联科技股份	1,200	55,392.00	0.02
984	605011	杭州热电	2,200	53,526.00	0.02
985	688161	威高骨科	2,700	53,514.00	0.02
986	603103	横店影视	3,600	49,824.00	0.02
987	301262	海看股份	2,200	49,610.00	0.02
988	605365	立达信	3,100	49,197.00	0.02
989	301180	万祥科技	3,000	46,920.00	0.02
990	001376	百通能源	2,400	44,688.00	0.02
991	301381	赛维时代	1,900	43,187.00	0.02
992	301177	迪阿股份	2,300	42,780.00	0.02
993	601279	英利汽车	11,100	41,403.00	0.01
994	603075	热威科技股份	2,300	40,595.00	0.01
995	688433	华曙高科	1,900	39,634.00	0.01
996	301376	致欧科技	1,800	38,106.00	0.01

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	300630	普利制药	17,200	156,864.00	0.06

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产 净值比例（%）
1	300573	兴齐眼药	5,292,331.00	1.27
2	300624	万兴科技	2,566,056.10	0.62
3	301308	江波龙	2,350,902.00	0.56
4	002456	欧菲光	2,181,965.00	0.52
5	300841	康华生物	1,765,845.00	0.42
6	301035	润丰股份	1,747,012.00	0.42
7	002436	兴森科技	1,699,116.00	0.41
8	300002	神州泰岳	1,649,180.00	0.40
9	002405	四维图新	1,555,412.00	0.37
10	002176	江特电机	1,508,047.00	0.36
11	300476	胜宏科技	1,489,710.00	0.36
12	300339	润和软件	1,473,747.94	0.35
13	300811	铂科新材	1,463,506.00	0.35
14	002318	久立特材	1,438,873.00	0.35
15	300567	精测电子	1,411,030.00	0.34
16	300672	国科微	1,388,665.00	0.33
17	002085	万丰奥威	1,370,500.00	0.33
18	301050	雷电微力	1,358,932.00	0.33
19	300820	英杰电气	1,318,520.00	0.32
20	002151	北斗星通	1,291,128.15	0.31

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元



序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300573	兴齐眼药	5,690,207.52	1.37
2	002436	兴森科技	3,097,374.00	0.74
3	300002	神州泰岳	2,853,700.00	0.69
4	300624	万兴科技	2,740,458.30	0.66
5	301308	江波龙	2,496,112.81	0.60
6	300054	鼎龙股份	2,433,382.00	0.58
7	000921	海信家电	2,328,167.00	0.56
8	300567	精测电子	2,287,457.00	0.55
9	688617	惠泰医疗	2,281,329.77	0.55
10	002456	欧菲光	2,267,310.00	0.54
11	000818	航锦科技	2,123,230.00	0.51
12	002261	拓维信息	2,018,340.00	0.48
13	002176	江特电机	1,887,973.00	0.45
14	002405	四维图新	1,872,747.50	0.45
15	300841	康华生物	1,861,698.75	0.45
16	301035	润丰股份	1,846,768.00	0.44
17	300339	润和软件	1,780,867.00	0.43
18	300803	指南针	1,681,857.00	0.40
19	300476	胜宏科技	1,676,725.00	0.40
20	002318	久立特材	1,646,230.00	0.40

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	378,438,788.71
卖出股票收入（成交）总额	420,360,326.00

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

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

#### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,165,812.54
2	应收清算款	1,188,039.65
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	85.36
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,353,937.55

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300630	普利制药	156,864.00	0.06	重大事项停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中信银行股份有限公司-汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
6,330	62,386.02	130,178,390.00	32.96	264,725,110.00	67.04	23,306,300.00	5.90

注:机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
----	-------	----------	--------------

1	中国工商银行股份有限公司—汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	23,100,000.00	5.85
2	招商证券股份有限公司	22,931,549.00	5.81
3	和泰人寿保险股份有限公司—传统保险产品	15,000,000.00	3.80
4	周畅旭	12,700,000.00	3.22
5	邱莉莎	8,521,200.00	2.16
6	国信证券股份有限公司	7,407,500.00	1.88
7	王一静	7,071,000.00	1.79
8	黄永耀	5,949,000.00	1.51
9	东方证券股份有限公司	5,695,700.00	1.44
10	杨志仓	5,000,000.00	1.27
11	中信银行股份有限公司—汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	23,306,300.00	5.90

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 07 月 29 日）基金份额总额	3,634,903,500.00
本报告期期初基金份额总额	490,903,500.00
本报告期基金总申购份额	633,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	729,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	394,903,500.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，中信银行股份有限公司托管业务未涉及诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	4	573,519,243.45	71.80	422,065.64	71.80	
东方证券	2	225,279,871.26	28.20	165,782.84	28.20	

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	143,642.15	100.00	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部（合称“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

(2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）

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

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

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2024 年 01 月 02 日
2	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京增财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	2024 年 01 月 17 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 22 日
4	汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 07 日
5	汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2024 年 2 月 8 日更新）	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 08 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华金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	2024 年 03 月 08 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 29 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息资料的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 03 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关	上交所, 上证报, 公	2024 年 04 月 16 日

	于汇添富投资管理有限公司股东变更的公告	司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 22 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华源证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 20 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财达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	2024 年 06 月 03 日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 07 日
14	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京中期时代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	2024 年 06 月 13 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 25 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注: 无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 1000 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 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 1000 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 1000 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

## 12.3 查阅方式

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

2024 年 08 月 30 日