

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	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	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	20
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	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	21
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
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	22
§ 5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
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	22
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	22
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	23
6.1 资产负债表	23
6.2 利润表	24
6.3 净资产变动表	25
6.4 报表附注	27
§ 7 投资组合报告	62
7.1 期末基金资产组合情况	62
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
7.3 期末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	63
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	87
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	89
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	89
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	90
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	90
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	90

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	90
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	90
7.12 市场中性策略执行情况.....	90
7.13 投资组合报告附注.....	90
§ 8 基金份额持有人信息.....	92
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	92
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	92
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	93
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	93
§ 9 开放式基金份额变动.....	93
§ 10 重大事件揭示	94
10.1 基金份额持有人大会决议.....	94
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.....	94
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	94
10.4 基金投资策略的改变.....	94
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	94
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.....	94
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	95
10.8 其他重大事件	99
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	100
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.....	100
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	100
§ 12 备查文件目录	100
12.1 备查文件目录	100
12.2 存放地点	101
12.3 查阅方式	101

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	汇添富绝对收益定开混合	
基金主代码	000762	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 03 月 15 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	3,099,959,272.54	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
下属分级基金的交易代码	000762	008140
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	2,633,374,271.40	466,585,001.14

2.2 基金产品说明

投资目标	基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。
投资策略	本基金采用包括市场中性投资策略在内的多种绝对收益策略，力争实现基金资产长期持续稳定的绝对回报。绝对收益策略包括：市场中性投资策略、其他绝对收益策略。其他投资策略包括：债券投资策略、中小企业私募债投资策略、衍生品投资策略。
业绩比较基准	一年期定期存款税后利率
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，采用多种绝对收益策略，其中市场中性策略采用股指期货对冲市场风险，使得多空组合的收益波动与市场相关性较低。本基金属于中低风险水平追求绝对收益的投资品种，其预期风险低于股票型基金和一般的混合型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 李鹏	张姗
	联系电话 021-28932888	400-61-95555

电子邮箱	service@99fund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	400-888-9918	400-61-95555
传真	021-28932998	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	李文	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路728号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日 - 2024年06月30日)	
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
本期已实现收益	52,856,211.50	7,502,358.43
本期利润	58,571,744.28	8,018,415.82
加权平均基金份额本期利润	0.0216	0.0164
本期加权平均净值利润率	1.75%	1.38%
本期基金份额净值增长率	1.73%	1.36%
3.1.2 期末数据和指	报告期末(2024年06月30日)	

标		
期末可供分配利润	494,289,110.31	60,790,645.22
期末可供分配基金份额利润	0.1877	0.1303
期末基金资产净值	3,249,596,033.30	554,860,462.69
期末基金份额净值	1.234	1.189
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	23.40%	-6.75%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富绝对收益定开混合 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.08%	0.17%	0.12%	0.00%	-0.04%	0.17%
过去三个月	-0.24%	0.20%	0.37%	0.00%	-0.61%	0.20%
过去六个月	1.73%	0.28%	0.75%	0.01%	0.98%	0.27%
过去一年	-0.80%	0.24%	1.50%	0.00%	-2.30%	0.24%
过去三年	-14.54%	0.28%	4.50%	0.00%	-19.04%	0.28%
自基金合同生效日起至今	23.40%	0.31%	10.95%	0.00%	12.45%	0.31%

汇添富绝对收益定开混合 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.00%	0.17%	0.12%	0.00%	-0.12%	0.17%
过去三个月	-0.42%	0.20%	0.37%	0.00%	-0.79%	0.20%
过去六个月	1.36%	0.28%	0.75%	0.01%	0.61%	0.27%
过去一年	-1.65%	0.24%	1.50%	0.00%	-3.15%	0.24%
过去三年	-16.56%	0.28%	4.50%	0.00%	-21.06%	0.28%
自基金合同生效日起至今	-6.75%	0.30%	6.95%	0.00%	-13.70%	0.30%

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

汇添富绝对收益定开混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富绝对收益定开混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年03月15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。

本基金于2019年11月11日新增C类份额。

§ 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		
顾耀强	本基金的基金经理, 增强收益部总监	2017 年 03 月 15 日	-	20	国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任高级行业分析

					<p>师、基金经理助理，现任增强收益部总监。</p> <p>2009 年 12 月 22 日至今任汇添富策略回报混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 8 月 24 日至今任</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月 20 日至今任汇添富沪深 300 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 2 月 5 日至 2022 年 9 月 22 日任汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 16 日至今任汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。</p>
吴江宏	本基金的基金经理, 稳健收益部总经理	2017 年 03 月 15 日	-	13	<p>国籍：中国。学历：厦门大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益分析师，现任稳健收益部总</p>

					<p>经理。2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月 19 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月 3 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 13 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月 20 日至 2019 年 9 月 4 日任汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2017 年 6 月 23 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2017 年 9 月 27 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月 25 日至 2019 年 8 月 29 日任汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2018 年 4 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金的</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>基金经理。 2018 年 9 月 28 日至 2020 年 6 月 4 日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至今任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 4 月 20 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 5 月 20 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>金经理。</p> <p>2021 年 3 月 4 日至今任汇添富稳健睿选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 23 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 3 月 25 日至今任汇添富稳健鑫添益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 7 月 21 日至今任汇添富鑫享添利六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 10 日至今任汇添富双鑫添利债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 3 月 4 日至今任汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

陈思行	本基金的基金经理助理	2023 年 08 月 29 日	-	13	<p>国籍：中国。学历：复旦大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 7 月至 2012 年 9 月任方正证券投资经理；2012 年 10 月至 2016 年 7 月任光大证券高级投资经理；2016 年 9 月至 2019 年 4 月任银华基金投资经理；2019 年 5 月至 2021 年 12 月任平安养老投资经理；2021 年 12 月至 2022 年 7 月任国寿养老高级投资经理。2022 年 7 月加入汇添富基金。2022 年 8 月 23 日至 2024 年 3 月 29 日任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 8 月 23 日至 2024 年 6 月 13 日</p>
-----	------------	------------------	---	----	---

					<p>任汇添富鑫福债券型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 2 月 1 日至 2024 年 5 月 9 日任汇添富添乐双盈债券型证券投资基金的基金经理助理。</p> <p>2023 年 8 月 29 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理助理。2023 年 11 月 24 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助理。2024 年 4 月 9 日至今任汇添富稳兴回报债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2022 年 11 月 3 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

					2022 年 11 月 25 日至今任汇添富稳健欣享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 22 日至今任汇添富添添乐双鑫债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 29 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 5 月 9 日至今任汇添富添添乐双盈债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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 年上半年市场大幅震荡，年初受悲观预期影响叠加流动性冲击一度出现恐慌性下

跌，但在耐心资本入场和一系列支持经济增长、改革资本市场的政策呵护下，市场情绪得以稳定。不过一些中长期问题如房地产、地方债等对整体经济的影响仍在持续，且扭转预期趋势不易，企业和居民信心恢复缓慢。上半年市场整体防御性特征显著，除出口、AI、资源等少数基本面有亮点的细分行业外，低估值、高股息的资产上涨较多，而消费、医药、地产链、高端制造业等与经济增长相关性较大的行业大多跌幅较大。

2024 年上半年本基金管理人继续努力融合公司基本面研究和量化、固收团队的优势，在市场较大波动背景下净值整体相对平稳。本基金管理人将在投资实践中不断总结反思，持续优化投资框架，以适应不断变化的市场。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富绝对收益定开混合 A 类份额净值增长率为 1.73%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%。本报告期汇添富绝对收益定开混合 C 类份额净值增长率为 1.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%。

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 年下半年，我们对市场保持谨慎乐观。虽然在百年未见之大变局面前，内外部均面临一些前所未有的困难，但相信历史进步的洪流无法阻挡，相信追求美好生活的广大人民和踔厉奋发的中国企业家，在党和国家引领下，终能破除万难，逐步走上高质量发展之路。我们业已看到不少中国企业正在依托自身竞争优势，不断突破技术封锁和贸易壁垒，将高品质、高性价比的中国产品输向全球。从投资方向上看，利率下行趋势中稳定性强的红利资产仍有空间；短期承压但商业模式好、治理结构优、竞争优势强的传统优质公司从中长期看也已具备良好投资价值；此外，围绕高质量发展和新质生产力寻找结构性机会也将是较长时期内的市场脉络之一。

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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；封闭期，基金收益分配采用现金分红；开放期，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	30,891,918.48	5,286,307.72
结算备付金		620,511,666.99	579,740,029.76
存出保证金		216,442,570.27	264,939,430.83
交易性金融资产	6.4.7.2	2,946,804,980.25	3,276,025,685.81
其中：股票投资		2,236,534,743.70	2,500,600,525.39
基金投资		-	-
债券投资		710,270,236.55	775,425,160.42
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	50,000,000.00	154,023,382.96
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		35,370,796.41	16,840,938.23
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,900,021,932.40	4,296,855,775.31
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	5,101,937.94
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,748,649.25	4,210,967.34

应付托管费		624,774.86	701,827.89
应付销售服务费		364,586.35	425,607.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,029.71	279,420.37
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	90,824,396.24	157,586,484.37
负债合计		95,565,436.41	168,306,244.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	3,099,959,272.54	3,421,128,647.65
未分配利润	6.4.7.9	704,497,223.45	707,420,882.74
净资产合计		3,804,456,495.99	4,128,549,530.39
负债和净资产总计		3,900,021,932.40	4,296,855,775.31

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,099,959,272.54 份。本基金下属汇添富绝对收益定开混合 A 基金份额净值 1.234 元，基金份额总额 2,633,374,271.40 份；本基金下属汇添富绝对收益定开混合 C 基金份额净值 1.189 元，基金份额总额 466,585,001.14 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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
一、营业总收入		97,667,946.52	-83,803,551.98
1. 利息收入		5,228,235.67	8,917,340.00
其中：存款利息收入	6.4.7.10	4,796,620.09	7,681,299.25
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		431,615.58	1,236,040.75
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		86,207,679.59	-106,182,209.51
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-221,376,177.51	-69,616,701.34
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	14,805,952.78	26,284,148.35
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	270,386,051.77	-90,586,251.80
股利收益	6.4.7.17	22,391,852.55	27,736,595.28
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	6,231,590.17	12,533,841.36
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	441.09	927,476.17
减：二、营业总支出		31,077,786.42	56,174,232.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,420,082.95	44,544,895.12
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,903,347.11	7,424,149.22
3. 销售服务费		2,310,979.29	3,813,606.32
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		1,235,435.86	15,770.07
8. 其他费用	6.4.7.21	207,941.21	375,811.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		66,590,160.10	-139,977,784.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		66,590,160.10	-139,977,784.55
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		66,590,160.10	-139,977,784.55

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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	3,421,128,647.65	707,420,882.74	4,128,549,530.39
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	3,421,128,647.65	707,420,882.74	4,128,549,530.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-321,169,375.11	-2,923,659.29	-324,093,034.40

(一)、综合收益总额	-	66,590,160.10	66,590,160.10
(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)	-321,169,375.11	-69,513,819.39	-390,683,194.50
其中：1. 基金申购款	441,793.08	99,226.31	541,019.39
2. 基金赎回款	-321,611,168.19	-69,613,045.70	-391,224,213.89
(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	3,099,959,272.54	704,497,223.45	3,804,456,495.99
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	5,981,895,774.80	1,627,013,229.56	7,608,909,004.36
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	5,981,895,774.80	1,627,013,229.56	7,608,909,004.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,537,510,260.43	-567,000,876.51	-2,104,511,136.94
(一)、综合收益总额	-	-139,977,784.55	-139,977,784.55
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-1,537,510,260.43	-427,023,091.96	-1,964,533,352.39
其中：1. 基金申购款	1,253,945.58	352,937.45	1,606,883.03
2. 基金赎回款	-1,538,764,206.01	-427,376,029.41	-1,966,140,235.42
(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	-	-	-

产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	4,444,385,514.37	1,060,012,353.05	5,504,397,867.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（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[2014]741 号文《关于核准汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》以及中国证监会机构部函[2016]2980 号文《关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金延期募集备案的回函》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 2017 年 3 月 15 日生效。首次设立基金募集规模为 493,313,864.49 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（2017）验字第 60466941_B11 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

自 2019 年 11 月 11 日起，本基金增设 C 类基金份额，原基金份额变更为 A 类基金份额，基金注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司。

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，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的相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120% 之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合

约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。本基金基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。本基金的业绩比较基准为：一年期定期存款税后利率。

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	30,891,918.48
等于：本金	30,885,823.31
加：应计利息	6,095.17
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	30,891,918.48

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	2,330,132,057.61	-	2,236,534,743.70	-93,597,313.91	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	246,581,926.65	710,133.39	259,230,495.71	11,938,435.67
	银行间市场	442,472,651.66	4,299,430.84	451,039,740.84	4,267,658.34
	其他	-	-	-	-
	合计	689,054,578.31	5,009,564.23	710,270,236.55	16,206,094.01

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,019,186,635.92	5,009,564.23	2,946,804,980.25	77,391,219.90

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	-1,873,842,126.95	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	-1,873,842,126.95	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-1,873,842,126.95	-	-	-

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

IC2407	IC2407	-345	-339,314,400.00	17,186,840.00
IF2407	IF2407	-158	-162,913,800.00	2,809,500.00
IF2412	IF2412	-754	-774,056,400.00	16,873,920.00
IH2412	IH2412	-19	-13,485,060.00	42,381.69
IM2407	IM2407	-290	-281,764,000.00	18,015,825.26
IM2409	IM2409	-240	-229,449,600.00	17,930,400.00
合计				72,858,866.95
减：可抵销期货暂收款				72,858,866.95
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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	50,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	4,927,464.50
其中：交易所市场	4,921,584.50
银行间市场	5,880.00
应付利息	-
应付审计费	44,753.80
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	85,792,505.60
合计	90,824,396.24

注：本基金适用国债冲抵期货备付金，其他负债-其他为期末应付各期货公司的备付金余额。

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富绝对收益定开混合 A		
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	2,887,912,208.13	2,887,912,208.13
本期申购	436,209.23	436,209.23
本期赎回（以“-”号填列）	-254,974,145.96	-254,974,145.96
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	2,633,374,271.40	2,633,374,271.40

汇添富绝对收益定开混合 C		
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	533,216,439.52	533,216,439.52
本期申购	5,583.85	5,583.85
本期赎回 (以“-”号填列)	-66,637,022.23	-66,637,022.23
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	466,585,001.14	466,585,001.14

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富绝对收益定开混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	493,741,673.80	121,166,556.23	614,908,230.03
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	493,741,673.80	121,166,556.23	614,908,230.03
本期利润	52,856,211.50	5,715,532.78	58,571,744.28
本期基金份额交易产生的变动数	-52,308,774.99	-4,949,437.42	-57,258,212.41
其中：基金申购款	89,627.45	8,575.71	98,203.16
基金赎回款	-52,398,402.44	-4,958,013.13	-57,356,415.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	494,289,110.31	121,932,651.59	616,221,761.90
汇添富绝对收益定开混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	63,302,661.11	29,209,991.60	92,512,652.71
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	63,302,661.11	29,209,991.60	92,512,652.71

本期利润	7,502,358.43	516,057.39	8,018,415.82
本期基金份额交易产生的变动数	-10,014,374.32	-2,241,232.66	-12,255,606.98
其中：基金申购款	862.94	160.21	1,023.15
基金赎回款	-10,015,237.26	-2,241,392.87	-12,256,630.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,790,645.22	27,484,816.33	88,275,461.55

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	101,432.27
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	4,691,814.08
其他	3,373.74
合计	4,796,620.09

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——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	6,425,807,909.34
减：卖出股票成本总额	6,633,781,877.22
减：交易费用	13,402,209.63
买卖股票差价收入	-221,376,177.51

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	10,918,389.67
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	3,887,563.11
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	14,805,952.78

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	769,876,528.84
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	754,872,808.22
减：应计利息总额	11,094,987.15
减：交易费用	21,170.36
买卖债券差价收入	3,887,563.11

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	270,386,051.77
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	22,391,852.55
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	22,391,852.55

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	68,321,011.04
——股票投资	58,035,316.71
——债券投资	10,285,694.33
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-62,089,420.87
——权证投资	-
——期货投资	-62,089,420.87
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	6,231,590.17

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	441.09
替代损益	-
其他	-
合计	441.09

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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	15,422.93
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	69,492.14
合计	207,941.21

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, 基金注册登记

	机构, 基金发起人
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注: 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 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	727,347,509.83	5.71	1,958,259,073.74	23.89

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	24,882,749.05	13.04	30,000,000.00	13.95

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 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	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
东方证券	711,130,000.00	18.14	2,330,000,000.00	45.16

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	535,252.59	5.71	307,951.75	6.26
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	1,412,491.06	23.66	70,706.86	3.04

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	23,420,082.95	44,544,895.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,583,236.17	17,768,991.88
应支付基金管理人的净管理费	13,836,846.78	26,775,903.24

注：2023 年 7 月 10 日前，本基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 7 月 10 日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一

致后，基金托管人于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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	上年度可比期间
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	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	3,903,347.11	7,424,149.22

注：2023 年 7 月 10 日前，本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 7 月 10 日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C	合计
招商银行股份有限公司	-	1,006,477.01	1,006,477.01
东方证券股份有限公司	-	21,177.38	21,177.38
汇添富基金管理股份有限公司	-	28,928.10	28,928.10
合计	-	1,056,582.49	1,056,582.49
获得销售服务	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		

费的各关联方 名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富绝对收 益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C	合计
招商银行股份有限公司	-	1,690,025.46	1,690,025.46
东方证券股份有限公司	-	31,312.70	31,312.70
汇添富基金管理股份有限公司	-	40,862.30	40,862.30
合计	-	1,762,200.46	1,762,200.46

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
招商银行	30,891,918.48	101,432.27	51,593,731.96	318,353.25

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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等相关法律法规、以及本基金合同的有关规定，经审慎研究并履行适当审批程序后，投资于基金托管人招商银行发行的股票招商银行。于本报告期末，本基金持有招商银行 1,251,872.00 股。（于上年度可比期间，本基金持有招商银行 1,251,872.00 股。）

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

				型						
001359	平安电工	2024年03月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	
001379	腾达科技	2024年01月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	
001387	雪祺电气	2024年01月04日	6个月	新股流通受限	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	
001389	广合科技	2024年03月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	
301392	汇成真空	2024年05月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	
301536	星辰科技	2024年03月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	
301538	骏鼎达	2024年03月13日	6个月	新股流通受限	39.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	
301539	宏	2024	6	新	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	

	鑫科技	年 04 月 03 日	个 月	股 流 通 受 限						
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	
301587	中瑞股份	2024 年 03 月 27 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	
301588	美新科技	2024 年 03 月 06 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	
301589	诺瓦星云	2024 年 02 月 01 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	70.48	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	
301591	肯特股份	2024 年 02 月 20 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	
601033	永兴股份	2024 年 01 月 11 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	
603082	北自科	2024 年 01 月	6 个 月	新 股 流	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	

	技 股 份	月 23 日		通 受 限						
603312	西 典 新 能	2024 年 01 月 04 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	
603325	博 隆 技 术	2024 年 01 月 03 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	
603341	龙 旗 科 技	2024 年 02 月 23 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	
603344	星 德 胜 科 技	2024 年 03 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	
603375	盛 景 微 电 子	2024 年 01 月 17 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	
688530	欧 莱 新 材	2024 年 04 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	
688695	中 创 股 份	2024 年 03 月 06 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	

		日		限						
688709	成都华微	2024年01月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	
688717	艾罗能源	2023年12月26日	6个月	新股流通受限	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“骏鼎达”（证券代码：301538）包含其新股发行后根据权益分配方案以资本公积金转增获得的43股（根据骏鼎达2023年年度权益分派实施公告，骏鼎达以公司现有总股本40,000,000股为基数，向全体股东每10股派7元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每10股转增4股，除权除息日为2024年5月22日。）。

本基金持有的流通受限股票“诺瓦星云”（证券代码：301589）包含其新股发行后根据权益分配方案以资本公积金转增获得的553股（根据诺瓦星云2023年年度权益分派实施公告，诺瓦星云以公司现有总股本51,360,000股为基数，向全体股东每10股派97元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每10股转增8股，除权除息日为2024年5月30日。）。

本基金持有的流通受限股票“雪祺电气”（证券代码：001387）包含其新股发行后根据权益分配方案以资本公积金转增获得的40股（根据雪祺电气2023年年度权益分派实施公告，雪祺电气以公司现有总股本136,760,000股为基数，向全体股东每10股派3.5元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每10股转增3股，除权除息日为2024年6月3日。）。

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	80,900	1,168,319.79	737,808.00	

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

注：截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日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	30,891,918.48	-	-	-	-	-	30,891,918.48
结算备付金	620,511,666.99	-	-	-	-	-	620,511,666.99
存出保证金	324,579.07	-	-	-	-	216,117,991.20	216,442,570.27
交易性金融资	120,523,514.88	23,239,558.52	197,810,291.17	87,734,159.26	280,962,712.72	2,236,534,743.70	2,946,804,980.25

产							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	-	-	50,000,000.00
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	35,370,796.41	35,370,796.41
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	822,251,679.42	23,239,558.52	197,810,291.17	87,734,159.26	280,962,712.72	2,488,023,531.31	3,900,021,932.40
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	3,748,649.25	3,748,649.25

管理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	624,774.86	624,774.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-	364,586.35	364,586.35
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	3,029.71	3,029.71
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	90,824,396.24	90,824,396.24
负	-	-	-	-	-	95,565,43	95,565,43

债总计						6.41	6.41
利率敏感度缺口	822,251,679.42	23,239,558.52	197,810,291.17	87,734,159.26	280,962,712.72	2,392,458,094.90	3,804,456,495.99
上年度末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	5,286,307.72	-	-	-	-	-	5,286,307.72
结算备付金	579,740,029.76	-	-	-	-	-	579,740,029.76
存出保证金	526,299.63	-	-	-	-	264,413,131.20	264,939,430.83
交易性金融资产	142,327,086.21	10,452,658.52	291,556,002.21	259,667,843.90	71,421,569.58	2,500,600,525.39	3,276,025,685.81

衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	154,023,382.96	-	-	-	-	-	154,023,382.96
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	16,840,938.23	16,840,938.23
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资	881,903,	10,452,	291,556,	259,667,	71,421,5	2,781,854	4,296,855

产总计	106.28	658.52	002.21	843.90	69.58	,594.82	,775.31
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	-	-	-	-	-	5,101,937.94	5,101,937.94
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管	-	-	-	-	-	4,210,967.34	4,210,967.34

理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	701,827.89	701,827.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	425,607.01	425,607.01
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	279,420.37	279,420.37
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	157,586.484.37	157,586.484.37
负债	-	-	-	-	-	168,306.244.92	168,306.244.92

总计							
利率敏感度缺口	881,903,106.28	10,452,658.52	291,556,002.21	259,667,843.90	71,421,569.58	2,613,548,349.90	4,128,549,530.39

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	8,441,465.27	3,142,902.03
	基准利率增加 25 个基点	-8,132,413.33	-3,095,043.47

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	2,236,534,743.70	58.79	2,500,600,525.39	60.57
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	710,270,236.55	18.67	775,425,160.42	18.78
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	2,946,804,980.25	77.46	3,276,025,685.81	79.35

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
	沪深 300 指数上涨 5%	20,837,700.22	20,343,234.40
沪深 300 指数下跌 5%	-20,837,700.22	-20,343,234.40	

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	2,355,381,415.23
第二层次	589,756,496.39
第三层次	1,667,068.63
合计	2,946,804,980.25

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	2,236,534,743.70	57.35
	其中：股票	2,236,534,743.70	57.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	710,270,236.55	18.21
	其中：债券	710,270,236.55	18.21
	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	50,000,000.00	1.28
	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	651,403,585.47	16.70
8	其他各项资产	251,813,366.68	6.46
9	合计	3,900,021,932.40	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	166,187,742.59	4.37
C	制造业	1,371,060,385.64	36.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	72,771,774.10	1.91
E	建筑业	9,553,069.00	0.25
F	批发和零售业	39,280,454.20	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	59,520,468.00	1.56
H	住宿和餐饮业	6,617,520.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	111,498,729.47	2.93
J	金融业	297,898,575.45	7.83
K	房地产业	29,374,614.30	0.77

L	租赁和商务服务业	18,089,051.91	0.48
M	科学研究和技术服务业	9,436,636.96	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	11,398,639.68	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,882,178.40	0.29
Q	卫生和社会工作	9,454,351.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	11,156,377.00	0.29
S	综合	2,354,176.00	0.06
	合计	2,236,534,743.70	58.79

7.2.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	40,780	59,840,164.20	1.57
2	300750	宁德时代	286,498	51,578,234.94	1.36
3	600036	招商银行	1,251,872	42,801,503.68	1.13
4	600938	中国海油	1,180,500	38,956,500.00	1.02
5	601899	紫金矿业	2,183,400	38,362,338.00	1.01
6	002594	比亚迪	143,869	36,003,217.25	0.95
7	600900	长江电力	1,069,158	30,920,049.36	0.81
8	600941	中国移动	283,600	30,487,000.00	0.80
9	601658	邮储银行	5,985,800	30,348,006.00	0.80
10	601088	中国神华	660,519	29,307,228.03	0.77
11	002475	立讯精密	688,100	27,049,211.00	0.71
12	000568	泸州老窖	188,381	27,030,789.69	0.71

13	000333	美的集团	392,617	25,323,796.50	0.67
14	002371	北方华创	77,800	24,887,442.00	0.65
15	000338	潍柴动力	1,530,300	24,852,072.00	0.65
16	600030	中信证券	1,340,096	24,429,950.08	0.64
17	601939	建设银行	3,020,918	22,354,793.20	0.59
18	601398	工商银行	3,916,738	22,325,406.60	0.59
19	300308	中际旭创	156,200	21,536,856.00	0.57
20	601318	中国平安	515,995	21,341,553.20	0.56
21	600276	恒瑞医药	549,620	21,138,385.20	0.56
22	601138	工业富联	753,000	20,632,200.00	0.54
23	000858	五粮液	156,900	20,089,476.00	0.53
24	300274	阳光电源	322,000	19,973,660.00	0.53
25	000651	格力电器	501,500	19,668,830.00	0.52
26	603129	春风动力	130,000	18,504,200.00	0.49
27	600426	华鲁恒升	689,713	18,373,954.32	0.48
28	601166	兴业银行	1,000,000	17,620,000.00	0.46
29	601077	渝农商行	3,500,000	17,570,000.00	0.46
30	600160	巨化股份	703,343	16,971,666.59	0.45
31	002028	思源电气	250,300	16,745,070.00	0.44
32	002840	华统股份	1,000,000	16,590,000.00	0.44
33	300033	同花顺	151,500	15,710,550.00	0.41
34	000933	神火股份	753,400	15,241,282.00	0.40

35	601628	中国人寿	478,109	14,845,284.45	0.39
36	600233	圆通速递	925,800	14,488,770.00	0.38
37	688012	中微半导体设备	100,000	14,126,000.00	0.37
38	601881	中国银河	1,300,000	14,118,000.00	0.37
39	600026	中远海能	900,000	14,049,000.00	0.37
40	300856	科思股份	418,400	13,392,984.00	0.35
41	601225	陕西煤业	519,200	13,379,784.00	0.35
42	601865	福莱特	653,300	13,131,330.00	0.35
43	603939	益丰药房	524,400	12,874,020.00	0.34
44	600559	老白干酒	700,000	12,726,000.00	0.33
45	002463	沪电股份	340,700	12,435,550.00	0.33
46	600795	国电电力	2,000,000	11,980,000.00	0.31
47	603596	伯特利	299,940	11,667,666.00	0.31
48	601567	三星医疗	323,500	11,322,500.00	0.30
49	688187	时代电气	227,535	11,235,678.30	0.30
50	688331	荣昌生物	258,202	11,154,326.40	0.29
51	002142	宁波银行	500,020	11,030,441.20	0.29
52	600809	山西汾酒	51,838	10,931,597.44	0.29
53	603369	今世缘	230,100	10,630,620.00	0.28
54	300059	东方财富	1,000,034	10,560,359.04	0.28
55	002236	大华股份	675,000	10,435,500.00	0.27
56	603568	伟明环保	499,800	10,285,884.00	0.27
57	600150	中国船	243,800	9,925,098.00	0.26

		舶			
58	600325	华发股份	1,458,800	9,482,200.00	0.25
59	688072	拓荆科技	78,735	9,456,860.85	0.25
60	001979	招商蛇口	1,062,500	9,339,375.00	0.25
61	603379	三美股份	237,900	9,311,406.00	0.24
62	300054	鼎龙股份	403,500	9,151,380.00	0.24
63	002541	鸿路钢构	538,980	9,146,490.60	0.24
64	603055	台华新材	873,700	8,850,581.00	0.23
65	600085	同仁堂	229,817	8,781,307.57	0.23
66	000526	学大教育	139,899	8,617,778.40	0.23
67	600348	华阳股份	857,350	8,539,206.00	0.22
68	000408	藏格矿业	352,800	8,491,896.00	0.22
69	002415	海康威视	258,400	7,987,144.00	0.21
70	688639	华恒生物	100,000	7,639,000.00	0.20
71	688100	威胜信息	200,000	7,630,000.00	0.20
72	300298	三诺生物	300,000	7,602,000.00	0.20
73	000786	北新建材	254,800	7,557,368.00	0.20
74	603919	金徽酒	413,900	7,520,563.00	0.20
75	603605	珀莱雅	66,125	7,339,213.75	0.19
76	600547	山东黄金	268,000	7,337,840.00	0.19
77	688062	迈威生物	250,000	7,235,000.00	0.19
78	300679	电连技术	178,300	7,173,009.00	0.19
79	603893	瑞芯微	119,800	7,088,566.00	0.19
80	600765	中航重机	338,700	6,909,480.00	0.18

81	600845	宝信软件	214,056	6,834,808.08	0.18
82	300144	宋城演艺	830,800	6,671,324.00	0.18
83	600570	恒生电子	375,278	6,627,409.48	0.17
84	301073	君亭酒店	363,600	6,617,520.00	0.17
85	002273	水晶光电	372,500	6,325,050.00	0.17
86	300014	亿纬锂能	158,021	6,308,198.32	0.17
87	601888	中国中免	100,071	6,253,436.79	0.16
88	301267	华夏眼科	300,000	6,216,000.00	0.16
89	603087	甘李药业	133,900	6,202,248.00	0.16
90	600521	华海药业	357,300	6,091,965.00	0.16
91	000066	中国长城	684,700	5,991,125.00	0.16
92	688516	奥特维科技	140,741	5,884,381.21	0.15
93	600415	小商品城	787,800	5,845,476.00	0.15
94	605599	菜百股份	456,700	5,813,791.00	0.15
95	688235	百济神州	50,094	5,802,888.96	0.15
96	601101	昊华能源	623,620	5,731,067.80	0.15
97	000423	东阿阿胶	90,800	5,684,080.00	0.15
98	601636	旗滨集团	879,900	5,675,355.00	0.15
99	601198	东兴证券	708,900	5,642,844.00	0.15
100	002128	电投能源	266,800	5,629,480.00	0.15
101	600038	中直股份	136,600	5,615,626.00	0.15
102	002410	广联达	585,800	5,611,964.00	0.15

103	603025	大豪科技	400,400	5,533,528.00	0.15
104	600406	国电南瑞	219,100	5,468,736.00	0.14
105	002019	亿帆医药	434,000	5,364,240.00	0.14
106	688188	上海柏楚电子科技	28,947	5,342,168.85	0.14
107	000703	恒逸石化	745,200	5,283,468.00	0.14
108	688036	传音控股	68,643	5,253,935.22	0.14
109	300034	钢研高纳	330,160	5,246,242.40	0.14
110	301061	匠心家居	110,000	5,165,600.00	0.14
111	300919	中伟股份	166,640	5,164,173.60	0.14
112	688520	神州细胞集团公司	131,100	5,158,785.00	0.14
113	603993	洛阳钼业	599,500	5,095,750.00	0.13
114	688213	思特威电子科技	104,502	5,068,347.00	0.13
115	002025	航天电器	108,397	5,027,452.86	0.13
116	600009	上海机场	154,400	4,979,400.00	0.13
117	002245	蔚蓝锂芯	629,600	4,879,400.00	0.13
118	600563	法拉电子	63,800	4,860,284.00	0.13
119	600299	安迪苏	500,600	4,855,820.00	0.13
120	603786	科博达	75,400	4,836,910.00	0.13
121	600011	华能国际	500,000	4,810,000.00	0.13
122	600916	中国黄金	495,700	4,768,634.00	0.13
123	002008	大族激光	229,100	4,765,280.00	0.13
124	002100	天康生	680,600	4,716,558.00	0.12

		物			
125	600623	华谊集团	814,200	4,706,076.00	0.12
126	300857	协创数据	81,900	4,668,300.00	0.12
127	300558	贝达药业	143,010	4,654,975.50	0.12
128	000528	柳工	411,400	4,603,566.00	0.12
129	600309	万华化学	56,659	4,581,446.74	0.12
130	603983	丸美股份	165,900	4,567,227.00	0.12
131	000738	航发控制	224,100	4,497,687.00	0.12
132	002027	分众传媒	727,100	4,406,226.00	0.12
133	000403	派林生物	159,301	4,246,964.66	0.11
134	600004	白云机场	441,100	4,181,628.00	0.11
135	000959	首钢股份	1,536,300	4,178,736.00	0.11
136	002078	太阳纸业	299,200	4,173,840.00	0.11
137	600549	厦门钨业	233,900	4,034,775.00	0.11
138	688798	艾为电子	69,064	3,910,403.68	0.10
139	601311	骆驼股份	475,640	3,814,632.80	0.10
140	688234	天岳先进	81,017	3,801,317.64	0.10
141	600970	中材国际	300,000	3,618,000.00	0.10
142	688276	长春百克生物科技	127,110	3,606,110.70	0.09
143	000425	徐工机械	500,000	3,575,000.00	0.09
144	600812	华北制药	866,010	3,567,961.20	0.09
145	000600	建投能源	558,000	3,515,400.00	0.09

146	600007	中国国贸	158,900	3,489,444.00	0.09
147	002752	昇兴股份	688,800	3,485,328.00	0.09
148	000758	中色股份	684,800	3,478,784.00	0.09
149	002745	木林森	430,000	3,465,800.00	0.09
150	000400	许继电气	100,000	3,441,000.00	0.09
151	000729	燕京啤酒	387,300	3,419,859.00	0.09
152	601609	金田股份	598,800	3,389,208.00	0.09
153	600420	国药现代	316,000	3,374,880.00	0.09
154	688105	诺唯赞生物	164,196	3,285,561.96	0.09
155	002267	陕天然气	433,100	3,274,236.00	0.09
156	688088	虹软科技	113,200	3,266,952.00	0.09
157	002237	恒邦股份	279,600	3,218,196.00	0.08
158	002145	中核钛白	979,100	3,211,448.00	0.08
159	601058	赛轮轮胎	229,196	3,208,744.00	0.08
160	688127	蓝特光学	172,922	3,180,035.58	0.08
161	688281	华秦科技实业	37,660	3,137,831.20	0.08
162	000958	电投产融	856,600	3,135,156.00	0.08
163	000513	丽珠集团	83,900	3,121,919.00	0.08
164	600529	山东药玻	122,722	3,109,775.48	0.08
165	688002	睿创微纳	110,117	3,079,972.49	0.08
166	000538	云南白药	60,000	3,069,000.00	0.08
167	002195	岩山科技	1,221,500	3,065,965.00	0.08

168	603039	泛微网络	96,500	3,064,840.00	0.08
169	688208	道通科技	126,300	3,048,882.00	0.08
170	000848	承德露露	387,000	3,041,820.00	0.08
171	603799	华友钴业	135,818	3,005,652.34	0.08
172	603733	仙鹤股份	170,600	2,999,148.00	0.08
173	000065	北方国际	284,600	2,951,302.00	0.08
174	600810	神马股份	473,900	2,938,180.00	0.08
175	603160	汇顶科技	42,600	2,928,750.00	0.08
176	002755	奥赛康	303,200	2,925,880.00	0.08
177	300492	华图山鼎	30,900	2,910,780.00	0.08
178	605376	博迁新材	127,300	2,873,161.00	0.08
179	002608	江苏国信	368,600	2,856,650.00	0.08
180	000032	深桑达A	190,000	2,846,200.00	0.07
181	603323	苏农银行	591,400	2,844,634.00	0.07
182	600690	海尔智家	100,000	2,838,000.00	0.07
183	000680	山推股份	300,000	2,781,000.00	0.07
184	301308	江波龙	29,205	2,766,881.70	0.07
185	601633	长城汽车	108,600	2,747,580.00	0.07
186	603298	杭叉集团	139,160	2,733,102.40	0.07
187	000938	紫光股份	121,600	2,717,760.00	0.07
188	601890	亚星锚链	385,400	2,717,070.00	0.07
189	603056	德邦股份	206,300	2,702,530.00	0.07
190	000550	江铃汽	124,400	2,700,724.00	0.07

		车			
191	000488	晨鸣纸业	779,700	2,697,762.00	0.07
192	600618	氯碱化工	306,700	2,692,826.00	0.07
193	688586	中航飞机装备	288,300	2,681,190.00	0.07
194	603297	永新光学	43,600	2,637,364.00	0.07
195	300724	捷佳伟创	48,478	2,618,296.78	0.07
196	600517	国网英大	601,100	2,602,763.00	0.07
197	600751	海航科技	1,168,700	2,594,514.00	0.07
198	002399	海普瑞	298,800	2,590,596.00	0.07
199	688116	天奈科技	112,200	2,589,576.00	0.07
200	300207	欣旺达	170,400	2,584,968.00	0.07
201	002020	京新药业	245,700	2,572,479.00	0.07
202	603026	石大胜华	76,000	2,568,800.00	0.07
203	002557	洽洽食品	90,800	2,559,652.00	0.07
204	600315	上海家化	142,600	2,535,428.00	0.07
205	002967	广电计量	214,100	2,526,380.00	0.07
206	600459	贵研铂业	186,100	2,514,211.00	0.07
207	605222	起帆电缆	162,600	2,494,284.00	0.07
208	000830	鲁西化工	210,200	2,436,218.00	0.06
209	688180	君实生物	83,800	2,434,390.00	0.06
210	600761	安徽合力	112,114	2,426,146.96	0.06
211	601717	郑煤机	163,500	2,419,800.00	0.06
212	000818	航锦科技	109,500	2,417,760.00	0.06
213	002558	巨人网	255,500	2,411,920.00	0.06

		络			
214	002948	青岛银行	714,700	2,408,539.00	0.06
215	300251	光线传媒	284,900	2,396,009.00	0.06
216	002185	华天科技	293,500	2,392,025.00	0.06
217	603583	捷昌驱动	116,900	2,382,422.00	0.06
218	601615	明阳智能	251,000	2,369,440.00	0.06
219	601989	中国重工	478,900	2,360,977.00	0.06
220	300394	天孚通信	26,640	2,355,508.80	0.06
221	600673	东阳光	334,400	2,354,176.00	0.06
222	601127	赛力斯	25,600	2,332,672.00	0.06
223	600663	陆家嘴	264,400	2,332,008.00	0.06
224	603000	人民网	116,400	2,326,836.00	0.06
225	300415	伊之密	111,100	2,308,658.00	0.06
226	600989	宝丰能源	132,800	2,301,424.00	0.06
227	600848	上海临港	251,800	2,293,898.00	0.06
228	600575	淮河能源	587,800	2,286,542.00	0.06
229	002607	中公教育	1,480,000	2,264,400.00	0.06
230	600596	新安股份	297,700	2,262,520.00	0.06
231	002534	西子洁能	225,900	2,261,259.00	0.06
232	002782	可立克	203,700	2,256,996.00	0.06
233	600458	时代新材	222,400	2,246,240.00	0.06
234	002219	新里程	1,207,300	2,245,578.00	0.06
235	688692	达梦数据	10,000	2,243,800.00	0.06
236	688289	圣湘生物	126,935	2,231,517.30	0.06
237	601991	大唐发电	733,700	2,208,437.00	0.06
238	600577	精达股	553,600	2,197,792.00	0.06

		份			
239	300409	道氏技术	256,726	2,197,574.56	0.06
240	600688	上海石化	833,600	2,175,696.00	0.06
241	600566	济川药业	68,300	2,165,793.00	0.06
242	605499	东鹏饮料	10,000	2,157,500.00	0.06
243	300687	赛意信息	154,300	2,147,856.00	0.06
244	002602	世纪华通	623,500	2,138,605.00	0.06
245	601139	深圳燃气	319,600	2,134,928.00	0.06
246	000800	一汽解放	271,900	2,128,977.00	0.06
247	002318	久立特材	91,100	2,125,363.00	0.06
248	603348	文灿股份	76,400	2,115,516.00	0.06
249	603027	千禾味业	157,388	2,093,260.40	0.06
250	688322	奥比中光	77,600	2,072,696.00	0.05
251	603093	南华期货	236,600	2,048,956.00	0.05
252	600711	盛屯矿业	554,000	2,033,180.00	0.05
253	600901	江苏金租	402,000	2,030,100.00	0.05
254	600707	彩虹股份	297,300	2,024,613.00	0.05
255	000725	京东方A	494,500	2,022,505.00	0.05
256	601702	华峰铝业	110,600	2,019,556.00	0.05
257	688608	恒玄科技	13,788	2,018,287.44	0.05
258	300233	金城医药	135,100	2,015,692.00	0.05
259	300379	东方通	246,400	1,990,912.00	0.05
260	300953	震裕科	36,600	1,983,720.00	0.05

		技			
261	000563	陕国投 A	719,900	1,979,725.00	0.05
262	002635	安洁科技	128,100	1,977,864.00	0.05
263	000825	太钢不锈	585,000	1,977,300.00	0.05
264	002320	海峡股份	380,800	1,964,928.00	0.05
265	600966	博汇纸业	409,900	1,959,322.00	0.05
266	600998	九州通	400,915	1,956,465.20	0.05
267	600908	无锡银行	366,700	1,950,844.00	0.05
268	688008	澜起科技	33,900	1,937,724.00	0.05
269	603906	龙蟠科技	248,300	1,934,257.00	0.05
270	300587	天铁股份	474,755	1,918,010.20	0.05
271	688778	厦钨新能源	61,000	1,905,640.00	0.05
272	603337	杰克股份	72,000	1,895,040.00	0.05
273	600391	航发科技	123,600	1,884,900.00	0.05
274	601872	招商轮船	222,300	1,878,435.00	0.05
275	002468	申通快递	223,300	1,875,720.00	0.05
276	001872	招商港口	97,300	1,873,025.00	0.05
277	300369	绿盟科技	364,200	1,861,062.00	0.05
278	002837	英维克	86,900	1,858,791.00	0.05
279	002859	洁美科技	92,400	1,855,392.00	0.05
280	603228	景旺电子	58,000	1,844,400.00	0.05
281	000930	中粮科技	366,400	1,842,992.00	0.05
282	002215	诺普信	247,100	1,840,895.00	0.05

283	688158	优刻得科技	178,100	1,821,963.00	0.05
284	603883	老百姓	98,800	1,813,968.00	0.05
285	601375	中原证券	524,400	1,788,204.00	0.05
286	002340	格林美	277,900	1,770,223.00	0.05
287	600372	中航机载	147,524	1,765,862.28	0.05
288	300685	艾德生物	100,000	1,764,000.00	0.05
289	600416	湘电股份	177,300	1,762,362.00	0.05
290	688266	泽璟制药	32,434	1,758,571.48	0.05
291	603489	八方股份	65,100	1,756,398.00	0.05
292	002444	巨星科技	70,300	1,736,410.00	0.05
293	002517	恺英网络	181,500	1,733,325.00	0.05
294	688029	南微医学科技	28,100	1,729,836.00	0.05
295	601038	一拖股份	109,300	1,728,033.00	0.05
296	002697	红旗连锁	373,200	1,727,916.00	0.05
297	603565	中谷物流	197,400	1,725,276.00	0.05
298	002053	云南能投	142,700	1,725,243.00	0.05
299	600562	国睿科技	122,800	1,677,448.00	0.04
300	600369	西南证券	468,300	1,676,514.00	0.04
301	002294	信立泰	62,200	1,656,386.00	0.04
302	300001	特锐德	81,500	1,639,780.00	0.04
303	601555	东吴证券	276,700	1,632,530.00	0.04
304	603308	应流股份	131,300	1,630,746.00	0.04
305	002911	佛燃能源	173,741	1,587,992.74	0.04
306	600993	马应龙	58,600	1,562,862.00	0.04

307	600380	健康元	139,200	1,554,864.00	0.04
308	601611	中国核建	192,100	1,554,089.00	0.04
309	002430	杭氧股份	68,100	1,515,225.00	0.04
310	600985	淮北矿业	89,500	1,498,230.00	0.04
311	688099	晶晨半导体	25,114	1,489,762.48	0.04
312	300408	三环集团	50,700	1,479,933.00	0.04
313	601111	中国国航	197,200	1,455,336.00	0.04
314	600760	中航沈飞	36,100	1,447,610.00	0.04
315	600509	天富能源	259,600	1,430,396.00	0.04
316	600556	天下秀	387,600	1,410,864.00	0.04
317	002555	三七互娱	107,800	1,406,790.00	0.04
318	603699	纽威股份	81,800	1,400,416.00	0.04
319	600787	中储股份	289,600	1,392,976.00	0.04
320	601326	秦港股份	420,600	1,333,302.00	0.04
321	300253	卫宁健康	224,500	1,324,550.00	0.03
322	002048	宁波华翔	100,800	1,304,352.00	0.03
323	688776	国光电气	23,500	1,301,900.00	0.03
324	301327	华宝新能	22,700	1,300,710.00	0.03
325	603198	迎驾贡酒	22,300	1,282,250.00	0.03
326	603693	江苏新能	109,400	1,271,228.00	0.03
327	603995	甬金股份	71,900	1,259,688.00	0.03
328	002773	康弘药业	57,800	1,251,370.00	0.03
329	000728	国元证	205,800	1,247,148.00	0.03

		券			
330	000089	深圳机场	192,400	1,229,436.00	0.03
331	002705	新宝股份	87,100	1,225,497.00	0.03
332	600971	恒源煤电	102,540	1,224,327.60	0.03
333	601369	陕鼓动力	150,900	1,210,218.00	0.03
334	688408	中信博新能源	12,983	1,195,474.64	0.03
335	002928	华夏航空	185,600	1,176,704.00	0.03
336	600862	中航高科	62,600	1,175,628.00	0.03
337	000030	富奥股份	239,100	1,173,981.00	0.03
338	300413	芒果超媒	55,200	1,153,680.00	0.03
339	000029	深深房A	108,100	1,149,103.00	0.03
340	002978	安宁股份	40,556	1,129,890.16	0.03
341	601966	玲珑轮胎	60,100	1,104,037.00	0.03
342	300821	东岳硅材	160,100	1,095,084.00	0.03
343	600601	方正科技	359,700	1,079,100.00	0.03
344	002429	兆驰股份	222,200	1,068,782.00	0.03
345	603229	奥翔药业	105,500	1,060,275.00	0.03
346	688050	爱博诺德医疗	14,459	1,060,133.88	0.03
347	603985	恒润股份	89,000	1,059,100.00	0.03
348	600000	浦发银行	128,400	1,056,732.00	0.03
349	301050	雷电微力	21,700	1,045,072.00	0.03
350	600316	洪都航空	61,900	1,029,397.00	0.03

351	601222	林洋能源	163,900	1,027,653.00	0.03
352	603368	柳药集团	58,300	1,020,250.00	0.03
353	002073	软控股份	137,200	1,013,908.00	0.03
354	000967	盈峰环境	239,200	1,011,816.00	0.03
355	300170	汉得信息	164,600	1,010,644.00	0.03
356	688128	中国电器研究院	58,697	1,010,175.37	0.03
357	000795	英洛华	181,700	1,006,618.00	0.03
358	603233	大参林	69,800	998,140.00	0.03
359	301239	普瑞眼科	28,100	992,773.00	0.03
360	002865	钧达股份	25,600	982,528.00	0.03
361	002015	协鑫能科	121,600	967,936.00	0.03
362	603567	珍宝岛	91,300	961,389.00	0.03
363	002384	东山精密	45,400	939,780.00	0.02
364	002906	华阳集团	35,100	939,276.00	0.02
365	002601	龙佰集团	50,200	932,214.00	0.02
366	300833	浩洋股份	20,000	928,000.00	0.02
367	603806	福斯特	63,040	926,688.00	0.02
368	605020	永和股份	48,300	926,394.00	0.02
369	002093	国脉科技	152,500	925,675.00	0.02
370	301071	力量钻石	33,300	922,743.00	0.02
371	002583	海能达	223,900	911,273.00	0.02
372	600114	东睦股份	63,300	910,887.00	0.02
373	300115	长盈精密	75,300	902,847.00	0.02
374	603979	金诚信	17,500	884,275.00	0.02

375	601068	中铝国际	209,000	879,890.00	0.02
376	002127	南极电商	336,500	874,900.00	0.02
377	603915	国茂股份	82,200	845,838.00	0.02
378	688018	乐鑫科技	8,496	838,385.28	0.02
379	603505	金石资源	29,400	821,142.00	0.02
380	000627	天茂集团	467,800	818,650.00	0.02
381	000883	湖北能源	135,900	816,759.00	0.02
382	603501	韦尔股份	8,200	814,834.00	0.02
383	300618	寒锐钴业	30,800	814,660.00	0.02
384	002543	万和电气	81,300	809,748.00	0.02
385	688556	高测科技股份	66,800	794,252.00	0.02
386	002291	遥望科技	182,800	786,040.00	0.02
387	603517	绝味食品	50,900	783,860.00	0.02
388	301078	孩子王	154,500	781,770.00	0.02
389	688007	光峰科技	47,700	767,970.00	0.02
390	601811	新华文轩	54,800	767,748.00	0.02
391	002153	石基信息	133,600	765,528.00	0.02
392	600835	上海机电	66,400	764,264.00	0.02
393	300396	迪瑞医疗	37,400	759,594.00	0.02
394	002249	大洋电机	160,100	757,273.00	0.02
395	300136	信维通信	38,600	755,788.00	0.02
396	002839	张家港行	187,300	752,946.00	0.02

397	600956	新天绿能	91,900	750,823.00	0.02
398	300188	国投智能	67,500	749,925.00	0.02
399	000837	秦川机床	101,300	745,568.00	0.02
400	601963	重庆银行	96,100	744,775.00	0.02
401	002152	广电运通	70,800	740,568.00	0.02
402	300630	普利制药	80,900	737,808.00	0.02
403	002993	奥海科技	19,700	732,840.00	0.02
404	300735	光弘科技	33,900	732,240.00	0.02
405	601216	君正集团	198,100	730,989.00	0.02
406	600872	中炬高新	32,200	730,618.00	0.02
407	600771	广誉远	38,500	724,955.00	0.02
408	600480	凌云股份	73,400	721,522.00	0.02
409	688023	安恒信息	18,000	720,180.00	0.02
410	000543	皖能电力	81,100	717,735.00	0.02
411	002274	华昌化工	96,300	714,546.00	0.02
412	000422	湖北宜化	59,900	714,008.00	0.02
413	688222	成都先导	62,900	713,915.00	0.02
414	002516	旷达科技	196,100	713,804.00	0.02
415	002707	众信旅游	123,100	706,594.00	0.02
416	688065	凯赛生物	15,500	703,545.00	0.02
417	002901	大博医疗	27,200	702,576.00	0.02
418	688789	杭州宏华数码科技	6,487	699,298.60	0.02

419	688076	诺泰生物	8,900	696,692.00	0.02
420	688388	嘉元科技	71,200	694,200.00	0.02
421	300841	康华生物	13,649	691,185.36	0.02
422	002531	天顺风能	77,100	689,274.00	0.02
423	002106	莱宝高科	63,200	688,880.00	0.02
424	603103	横店影视	49,500	685,080.00	0.02
425	688484	南芯科技	18,300	678,930.00	0.02
426	002315	焦点科技	25,100	676,696.00	0.02
427	000402	金融街	282,698	664,340.30	0.02
428	688106	金宏气体	37,700	660,504.00	0.02
429	300747	锐科激光	37,200	660,300.00	0.02
430	688232	国泰新点软件	33,300	656,676.00	0.02
431	688063	派能科技	16,520	656,009.20	0.02
432	688336	三生国健	32,200	655,270.00	0.02
433	600170	上海建工	304,600	654,890.00	0.02
434	002138	顺络电子	23,700	650,802.00	0.02
435	600499	科达制造	77,100	649,953.00	0.02
436	600460	士兰微	37,100	649,621.00	0.02
437	002701	奥瑞金	156,000	648,960.00	0.02
438	002683	广东宏大	32,200	648,186.00	0.02
439	300077	国民技术	74,100	646,893.00	0.02
440	601168	西部矿业	35,900	644,405.00	0.02
441	600967	内蒙一	89,300	642,960.00	0.02

		机			
442	601827	三峰环境	75,000	636,750.00	0.02
443	001330	博纳影业	117,600	636,216.00	0.02
444	688728	格科微有限公司	52,223	632,420.53	0.02
445	603345	安井食品	8,500	631,635.00	0.02
446	002945	华林证券	63,100	629,738.00	0.02
447	000630	铜陵有色	173,800	627,418.00	0.02
448	002270	华明装备	28,100	624,944.00	0.02
449	001914	招商积余	62,300	624,246.00	0.02
450	000821	京山轻机	54,600	618,618.00	0.02
451	002891	中宠股份	29,600	617,752.00	0.02
452	002426	胜利精密	390,100	616,358.00	0.02
453	002064	华峰化学	85,700	614,469.00	0.02
454	300657	弘信电子	40,000	600,800.00	0.02
455	002595	豪迈科技	15,600	595,452.00	0.02
456	603317	天味食品	51,940	592,635.40	0.02
457	002292	奥飞娱乐	98,700	590,226.00	0.02
458	688313	仕佳光子	61,900	589,288.00	0.02
459	601700	风范股份	134,100	588,699.00	0.02
460	688095	福昕软件开发	12,700	581,787.00	0.02
461	300783	三只松鼠	26,300	575,181.00	0.02
462	300474	景嘉微	9,066	573,243.18	0.02

463	601528	瑞丰银行	120,000	566,400.00	0.01
464	300203	聚光科技	56,000	565,040.00	0.01
465	000559	万向钱潮	125,000	557,500.00	0.01
466	688567	孚能科技	56,969	546,902.40	0.01
467	301171	易点天下	37,200	546,840.00	0.01
468	605333	沪光股份	19,500	543,075.00	0.01
469	600216	浙江医药	49,300	541,314.00	0.01
470	600586	金晶科技	93,200	540,560.00	0.01
471	300502	新易盛	5,100	538,305.00	0.01
472	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.01
473	600988	赤峰黄金	32,500	531,050.00	0.01
474	000582	北部湾港	71,100	528,984.00	0.01
475	688185	康希诺生物	12,847	527,883.23	0.01
476	688031	星环科技	14,300	524,953.00	0.01
477	300872	天阳科技	39,600	524,700.00	0.01
478	600827	百联股份	71,000	523,980.00	0.01
479	000975	银泰黄金	32,000	521,280.00	0.01
480	600366	宁波韵升	99,800	520,956.00	0.01
481	688779	长远锂科	112,500	520,875.00	0.01
482	688239	贵州航宇科技	14,900	518,520.00	0.01
483	603013	亚普股份	38,200	514,554.00	0.01
484	002465	海格通信	49,300	510,748.00	0.01

485	688766	普冉半 导体	5,220	507,227.40	0.01
486	688566	吉贝尔 药业	22,100	497,250.00	0.01
487	605123	派克新 材	8,800	494,384.00	0.01
488	300463	迈克生 物	42,800	487,064.00	0.01
489	300039	上海凯 宝	90,700	485,245.00	0.01
490	002139	拓邦股 份	45,500	483,210.00	0.01
491	002240	盛新锂 能	35,800	480,436.00	0.01
492	301015	百洋医 药	20,300	477,659.00	0.01
493	301589	诺瓦星 云	2,486	475,453.44	0.01
494	301291	明阳电 气	15,600	468,780.00	0.01
495	001309	德明利	5,400	466,560.00	0.01
496	603588	高能环 境	72,600	455,928.00	0.01
497	603516	淳中科 技	14,400	454,608.00	0.01
498	002332	仙琚制 药	39,700	452,977.00	0.01
499	002023	海特高 新	49,500	452,925.00	0.01
500	002204	大连重 工	104,400	445,788.00	0.01
501	300109	新开源	38,000	440,040.00	0.01
502	600850	电科数 字	24,100	436,210.00	0.01
503	300382	斯莱克	73,600	434,976.00	0.01
504	601069	西部黄 金	37,300	433,799.00	0.01
505	603355	莱克电 气	20,000	432,000.00	0.01
506	600651	飞乐音 响	155,400	428,904.00	0.01
507	688268	广东华 特气体	8,200	423,202.00	0.01

508	601601	中国太保	15,100	420,686.00	0.01
509	603408	建霖家居	31,400	414,166.00	0.01
510	300035	中科电气	48,400	411,884.00	0.01
511	002063	远光软件	77,400	405,576.00	0.01
512	000034	神州数码	17,600	402,864.00	0.01
513	600897	厦门空港	31,600	398,476.00	0.01
514	600019	宝钢股份	59,800	397,670.00	0.01
515	601500	通用股份	73,800	394,092.00	0.01
516	000598	兴蓉环境	52,400	394,048.00	0.01
517	603896	寿仙谷	16,500	387,255.00	0.01
518	688138	清溢光电	18,000	387,000.00	0.01
519	002110	三钢闽光	129,500	382,025.00	0.01
520	688111	金山办公	1,600	364,000.00	0.01
521	600933	爱柯迪	24,600	363,834.00	0.01
522	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
523	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
524	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
525	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
526	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
527	688535	华海诚科新材料	161	11,031.72	0.00
528	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
529	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
530	301591	肯特股	219	8,098.62	0.00

		份			
531	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
532	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
533	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
534	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
535	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
536	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
537	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
538	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
539	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
540	603344	星德胜科技	182	4,124.12	0.00
541	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
542	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
543	603082	北自科技股份	107	3,155.43	0.00
544	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
545	603375	盛景微电子	72	2,800.80	0.00
546	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
547	603373	安邦护卫集团股份	88	2,419.12	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	000568	泸州老窖	35,300,339.79	0.86
2	600519	贵州茅台	34,527,237.00	0.84
3	600941	中国移动	33,193,461.00	0.80
4	601088	中国神华	30,739,499.00	0.74
5	002142	宁波银行	29,707,125.00	0.72
6	688072	拓荆科技	29,285,709.06	0.71
7	000338	潍柴动力	28,734,908.00	0.70
8	300750	宁德时代	28,039,762.52	0.68
9	601881	中国银河	27,067,312.00	0.66
10	002594	比亚迪	26,242,603.54	0.64
11	688639	华恒生物	26,214,756.87	0.63
12	601166	兴业银行	25,735,399.00	0.62
13	000858	五粮液	23,706,125.00	0.57
14	300308	中际旭创	23,486,595.32	0.57
15	300274	阳光电源	22,477,362.28	0.54
16	688002	睿创微纳	22,289,834.53	0.54
17	603596	伯特利	22,126,191.17	0.54
18	600938	中国海油	22,120,559.00	0.54
19	688012	中微半导体设备	21,967,147.36	0.53
20	688567	孚能科技	21,712,927.12	0.53

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	002142	宁波银行	31,584,920.00	0.77
2	601699	潞安环能	29,618,612.56	0.72
3	688072	拓荆科技	26,590,024.95	0.64
4	601137	博威合金	23,804,182.72	0.58
5	600919	江苏银行	23,623,933.62	0.57
6	002171	楚江新材	22,955,784.00	0.56
7	000568	泸州老窖	22,941,310.61	0.56
8	600900	长江电力	22,416,297.00	0.54
9	603379	三美股份	22,352,208.80	0.54
10	002262	恩华药业	22,240,907.00	0.54
11	688100	威胜信息	22,090,228.01	0.54
12	605117	德业股份	22,065,927.67	0.53

13	688235	百济神州	21,896,035.39	0.53
14	002557	洽洽食品	21,751,335.00	0.53
15	688234	天岳先进	21,656,897.46	0.52
16	601318	中国平安	21,161,225.00	0.51
17	688567	孚能科技	19,913,939.87	0.48
18	601128	常熟银行	19,896,192.85	0.48
19	300773	拉卡拉	19,715,086.49	0.48
20	688798	艾为电子	19,392,281.88	0.47

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	6,311,680,778.82
卖出股票收入（成交）总额	6,425,807,909.34

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	423,633,955.83	11.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	136,587,835.05	3.59
	其中：政策性金融债	53,043,923.97	1.39
4	企业债券	12,597,915.22	0.33
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	16,927,015.57	0.44
7	可转债（可交换债）	120,523,514.88	3.17
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	710,270,236.55	18.67

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	230018	23 付息 国债 18	1,000,000	103,199,230.77	2.71

2	113052	兴业转债	800,000	86,574,136.98	2.28
3	220011	22 付息国债 11	700,000	70,578,947.95	1.86
4	230013	23 付息国债 13	640,000	64,331,309.59	1.69
5	019729	23 国债 26	500,000	51,945,328.77	1.37

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

本基金根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素,计算需要用到的期货合约数量,对这个数量进行动态跟踪与测算,并进行适时灵活调整。同时,综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素,在各个月份期货合约之间进行动态配置,通过空头部分的优化创造额外收益。

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 市场中性策略执行情况

截止本报告期末,本基金持有的股票资产 2,236,534,743.70 元,占基金资产净值的比例为 58.79%;运用股指期货进行对冲的空头合约市值-1,800,983,260.00 元,占基金资产净值的比例为-47.34%,运用股指期货进行对冲的空头合约市值占股票资产的比例为-80.53%。

本报告期内,本基金执行市场中性策略的投资收益为 49,009,874.26 元,公允价值变动损益为-4,054,104.16 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.13.2

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。

7.13.3 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	216,442,570.27
2	应收清算款	35,370,796.41
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	251,813,366.68

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	86,574,136.98	2.28
2	113062	常银转债	9,202,196.95	0.24
3	127084	柳工转 2	6,685,676.73	0.18
4	113641	华友转债	4,433,093.83	0.12
5	113652	伟 22 转债	3,135,453.25	0.08
6	118030	睿创转债	2,214,210.96	0.06
7	113633	科沃转债	1,526,479.95	0.04
8	110085	通 22 转债	1,513,525.97	0.04
9	113069	博 23 转债	1,513,507.07	0.04
10	127024	盈峰转债	1,433,374.39	0.04
11	113061	拓普转债	1,289,066.83	0.03
12	113661	福 22 转债	497,742.87	0.01
13	113655	欧 22 转债	424,485.76	0.01
14	110095	双良转债	80,563.34	0.00

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
汇添富绝对收益定开混合 A	45,828	57,462.13	42,603,442.97	1.62	2,590,770,828.43	98.38
汇添富绝对收益定开混合 C	6,684	69,806.25	31,551,022.54	6.76	435,033,978.60	93.24
合计	52,512	59,033.35	74,154,465.51	2.39	3,025,804,807.03	97.61

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
----	------	------------	----------

			(%)
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	汇添富绝对收益 定开混合 A	4,577,245.98	0.17
	汇添富绝对收益 定开混合 C	15,113.55	0.00
	合计	4,592,359.53	0.15

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持有 本开放式基金	汇添富绝对收益定开混合 A	0
	汇添富绝对收益定开混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	汇添富绝对收益定开混合 A	>100
	汇添富绝对收益定开混合 C	0
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,001,000.00 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 03 月 15 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
基金合同生效日 (2017 年 03 月 15 日) 基金份额总额	493,313,864.49	-
本报告期初基金份 额总额	2,887,912,208.13	533,216,439.52
本报告期基金总申 购份额	436,209.23	5,583.85
减：本报告期基金总 赎回份额	254,974,145.96	66,637,022.23
本报告期基金拆分 变	-	-

动份额		
本报告期期末基金份 额总额	2,633,374,271.40	466,585,001.14

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，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安	2	2,176,082,578.32	17.09	1,601,380.60	17.09	
天风证券	2	1,811,834,976.22	14.23	1,333,335.83	14.23	
海通证券	2	1,352,582,825.04	10.62	995,366.75	10.62	
中信建投证券	2	1,185,250,524.41	9.31	872,222.26	9.31	
东北证券	2	1,001,938,167.54	7.87	737,328.23	7.87	
广发证券	4	932,724,775.75	7.32	686,397.68	7.32	
华安证券	2	797,874,411.58	6.26	587,162.62	6.26	
东方证券	3	727,347,509.83	5.71	535,252.59	5.71	
中泰证券	1	651,008,617.45	5.11	479,080.11	5.11	
申万宏源证券	2	635,748,621.29	4.99	467,839.78	4.99	
德邦证券	2	543,958,494.71	4.27	400,302.22	4.27	
开源证券	2	443,659,912.39	3.48	326,489.76	3.48	
国信证券	2	284,511,950.80	2.23	209,373.75	2.23	
中信证券	2	126,142,728.81	0.99	92,828.73	0.99	
国金证券	2	65,481,870.43	0.51	48,185.52	0.51	
东方	2	-	-	-	-	

财富						
高盛中国	2	-	-	-	-	
国投证券	3	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
民生证券	2	-	-	-	-	
申港证券	2	-	-	-	-	
招商证券	3	-	-	-	-	
中原证券	2	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
国泰君安	37,896,941.68	19.86	429,449,000.00	10.95	-	-	-	-
天风证券	44,879,043.00	23.52	354,687,000.00	9.05	-	-	-	-
海通证券	15,080,550.00	7.90	568,542,000.00	14.50	-	-	-	-

中信建投证券	2,257,452.44	1.18	448,341,000.00	11.44	-	-	-	-
东北证券	22,382,690.00	11.73	184,194,000.00	4.70	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	10,040,000.00	5.26	73,630,000.00	1.88	-	-	-	-
东方证券	24,882,749.05	13.04	711,130,000.00	18.14	-	-	-	-
中泰证券	-	-	125,188,000.00	3.19	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	111,847,000.00	2.85	-	-	-	-
德邦证券	29,505,885.00	15.46	883,501,000.00	22.54	-	-	-	-
开源证券	1,725,789.55	0.90	-	-	-	-	-	-
国信证券	2,176,600.00	1.14	30,000,000.00	0.77	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称

“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内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	关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金第十三次开放申购、赎回和转换业务的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 22 日
5	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	2024 年 03 月 22 日
6	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	2024 年 03 月 29 日

		监会基金电子披露网站	
7	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
8	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富投资管理有限公司股东变更的公告	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 04 月 16 日
9	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
10	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 05 月 24 日
11	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
12	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绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式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、报告期内汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2024 年 08 月 30 日