

# 汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
§ 4 管理人报告 .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	17
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 .....	18
§ 5 托管人报告 .....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	18
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 .....	18
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 .....	18
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计) .....	18
6.1 资产负债表 .....	18
6.2 利润表 .....	20
6.3 净资产变动表 .....	21
6.4 报表附注 .....	23
§ 7 投资组合报告 .....	54
7.1 期末基金资产组合情况 .....	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	55
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 .....	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	78
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	80
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 .....	80
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 .....	81
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 .....	81
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 .....	81

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	81
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	81
7.12 投资组合报告附注.....	81
§ 8 基金份额持有人信息.....	82
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	82
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	83
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	83
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.....	84
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	84
§ 9 开放式基金份额变动.....	84
§ 10 重大事件揭示.....	85
10.1 基金份额持有人大会决议.....	85
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.....	85
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
10.4 基金投资策略的改变.....	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
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.....	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
10.8 其他重大事件.....	87
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
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.....	88
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
§ 12 备查文件目录.....	88
12.1 备查文件目录.....	88
12.2 存放地点.....	88
12.3 查阅方式.....	88

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 08 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	405,854,329.45	
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	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数（LOF）A	汇添富中证 500 指数（LOF）C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	263,031,748.46	142,822,580.99

注：汇添富中证 500 指数（LOF）A 类份额扩位证券简称：中证 500LOF；汇添富中证 500 指数（LOF）C 类份额扩位证券简称：中证 500LOFC。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。

业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	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，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，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	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95565
传真	021-28932998	0755-82960794
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区 (东座) 6 楼 H686 室	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	200010	518000
法定代表人	李文	霍达

## 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	报告期(2024 年 01 月 01 日 - 2024 年 06 月 30 日)
--------------	--

标	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	-6,419,058.98	-3,758,856.64
本期利润	-20,063,562.76	-11,672,132.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0771	-0.0820
本期加权平均净值利润率	-7.74%	-8.34%
本期基金份额净值增长率	-7.72%	-7.81%
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	-13,044,184.70	-9,209,045.48
期末可供分配基金份额利润	-0.0496	-0.0645
期末基金资产净值	249,987,563.76	133,613,535.51
期末基金份额净值	0.9504	0.9355
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	-4.96%	-6.45%

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

汇添富中证 500 指数 (LOF) 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	-5.94%	0.91%	-6.55%	0.91%	0.61%	0.00%
过去三	-5.06%	1.08%	-6.16%	1.09%	1.10%	-0.01%

个月						
过去六个月	-7.72%	1.50%	-8.46%	1.53%	0.74%	-0.03%
过去一年	-15.33%	1.19%	-16.71%	1.21%	1.38%	-0.02%
过去三年	-20.79%	1.12%	-26.00%	1.14%	5.21%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-4.96%	1.24%	-20.40%	1.26%	15.44%	-0.02%
汇添富中证 500 指数 (LOF) 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	-5.95%	0.92%	-6.55%	0.91%	0.60%	0.01%
过去三个月	-5.11%	1.08%	-6.16%	1.09%	1.05%	-0.01%
过去六个月	-7.81%	1.50%	-8.46%	1.53%	0.65%	-0.03%
过去一年	-15.52%	1.19%	-16.71%	1.21%	1.19%	-0.02%
过去三年	-21.35%	1.12%	-26.00%	1.14%	4.65%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-6.45%	1.24%	-20.40%	1.26%	13.95%	-0.02%

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



汇添富中证500指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数（LOF）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08月10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		
吴振翔	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2017 年 08 月 10 日	-	18	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基

				<p>金管理有限公司 金融工程研究 员、上投摩根基 金管理有限公司 产品开发高级经 理。2008 年 3 月加入汇添富基 基金管理股份有 限公司, 历任产 品开发高级经理、 数量投资高级分 析师、基金经理 助理, 现任指数 与量化投资部副 总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇 添富上证综合指 数证券投资基金的 基金经理。</p> <p>2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放 式指数证券投资 基金的基金经 理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任 汇添富深证 300 交易型开放式指 数证券投资基金 联接基金的基金 经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任 中证金融地产交 易型开放式指数 证券投资基金的 基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交 易型开放式指数 证券投资基金的</p>
--	--	--	--	---

				<p>基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的</p>
--	--	--	--	--

				<p>基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13</p>
--	--	--	--	--

				<p>日任汇添富中证 500 指数 (LOF) 基金基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富中证 500 指数 (LOF) 基金基金经理。</p> <p>2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 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的基金经理。</p> <p>2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日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。</p> <p>2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日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。</p> <p>2023 年 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 6 月 6 日至今任汇添富量化选股混</p>
--	--	--	--	---

					合型证券投资基金的基金经理。 2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。 2023 年 11 月 22 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。2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳丰回报债券型发起式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

国家统计局数据显示，2024 年上半年 GDP 同比增长 5.0%。分项来看，社会消费品零售总额同比增长 3.7%；固定资产投资同比增长 3.9%；货物进出口总额同比增长 6.1%。宏观经济整体呈现回升向好态势，经济运行中积极因素增多，动能持续增强，社会预期改善，高质量发展扎实推进，呈现增长较快、结构优化、质效向好的特征。但另一方面，宏观经济仍面



临诸多挑战,主要是有效需求仍然不足,企业经营压力较大,重点领域风险隐患较多,国内大循环不够顺畅,外部环境复杂性、严峻性、不确定性明显上升。

上半年权益市场以震荡行情为主。风格上来看,大中盘表现优于小微盘,小微盘股票波动程度较大;价值、红利优于成长。行业主题方面,能源、有色、银行、电力等行业表现较为稳定,相对于市场取得了较高的超额收益;多数行业仍延续调整。中证 500 指数是 A 股市场代表性宽基指数之一,有着典型的中盘股特征属性,本基金则是这一代表性指数的产品化形式,为投资者提供了配置国内权益资产的优质工具。

报告期内,本基金遵循被动指数投资原则,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 500 指数 (LOF) A 类份额净值增长率为-7.72%,同期业绩比较基准收益率为-8.46%。本报告期汇添富中证 500 指数 (LOF) C 类份额净值增长率为-7.81%,同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

#### 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,党的二十届三中全会将对进一步全面深化改革、推进中国式现代化作出战略部署。随着宏观政策不断落地显效,国内经济有望实现稳健高质量增长。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。

作为被动投资的指数型基金,本基金将严格遵守基金合同,继续坚持既定的投资策略,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差,实现投资目标。

#### 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：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

### § 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 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2024 年 06 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	6.4.7.1	22,733,609.77	21,735,448.98
结算备付金		3,398,400.68	3,695,664.48
存出保证金		861,300.88	940,208.57
交易性金融资产	6.4.7.2	356,315,680.56	361,233,564.12
其中: 股票投资		355,522,921.96	357,976,156.00
基金投资		-	-
债券投资		792,758.60	3,257,408.12
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		-	184.33
应收股利		-	-
应收申购款		1,561,303.29	990,047.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	21,082.85
资产总计		384,870,295.18	388,616,200.73
<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		926.18	-
应付赎回款		849,624.14	749,245.11
应付管理人报酬		167,522.11	165,024.34
应付托管费		33,504.43	33,004.88
应付销售服务费		24,570.14	21,643.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		440.65	2,297.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	192,608.26	265,384.69
负债合计		1,269,195.91	1,236,599.98
<b>净资产:</b>			

实收基金	6.4.7.8	405,854,329.45	377,971,777.95
未分配利润	6.4.7.9	-22,253,230.18	9,407,822.80
净资产合计		383,601,099.27	387,379,600.75
负债和净资产总计		384,870,295.18	388,616,200.73

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 405,854,329.45 份。本基金下属汇添富中证 500 指数（LOF）A 基金份额净值 0.9504 元，基金份额总额 263,031,748.46 份；本基金下属汇添富中证 500 指数（LOF）C 基金份额净值 0.9355 元，基金份额总额 142,822,580.99 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

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>-30,279,110.00</b>	<b>16,953,624.19</b>
1. 利息收入		507,467.75	533,093.10
其中：存款利息收入	6.4.7.10	195,527.12	156,676.06
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		311,940.63	376,417.04
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,232,536.09	-3,436,260.72
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-14,204,951.56	-8,033,580.24
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,465.79	58,431.04
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	-156,008.60	123,341.76
股利收益	6.4.7.17	5,120,958.28	4,415,546.72
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	-21,557,779.56	19,853,633.05
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	3,737.90	3,158.76
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,456,585.18</b>	<b>1,559,496.56</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	991,804.81	1,049,660.06
其中：暂估管理人报酬		-	-

2. 托管费	6.4.10.2.2	198,360.96	209,932.05
3. 销售服务费		138,759.86	167,127.23
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		1,125.78	3,022.21
8. 其他费用	6.4.7.21	126,533.77	129,755.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-31,735,695.18</b>	<b>15,394,127.63</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-31,735,695.18</b>	<b>15,394,127.63</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-31,735,695.18</b>	<b>15,394,127.63</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

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	377,971,777.95	9,407,822.80	387,379,600.75
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	377,971,777.95	9,407,822.80	387,379,600.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	27,882,551.50	-31,661,052.98	-3,778,501.48
（一）、综合收益总额	-	-31,735,695.18	-31,735,695.18
（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）	27,882,551.50	74,642.20	27,957,193.70
其中：1. 基金申购款	225,105,933.00	-2,233,488.18	222,872,444.82

2. 基金赎回款	-197,223,381.50	2,308,130.38	-194,915,251.12
(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	405,854,329.45	-22,253,230.18	383,601,099.27
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	394,815,027.56	32,246,300.74	427,061,328.30
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	394,815,027.56	32,246,300.74	427,061,328.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-27,105,064.82	11,067,508.16	-16,037,556.66
(一)、综合收益总额	-	15,394,127.63	15,394,127.63
(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)	-27,105,064.82	-4,326,619.47	-31,431,684.29
其中: 1. 基金申购款	148,223,984.82	20,073,655.99	168,297,640.81
2. 基金赎回款	-175,329,049.64	-24,400,275.46	-199,729,325.10
(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	367,709,962.74	43,313,808.90	411,023,771.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）（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[2017]770 号文《关于准予汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）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 2017 年 8 月 10 日生效。首次设立基金募集规模为 735,804,689.63 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\_B29 号验资报告予以验证。本基金为上市契约型开放式，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，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金的标的指数为中证 500 指数。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，基金还可投资于其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（分离交易可转债）、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、权证、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的相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。本基金进行被动式指数化投资，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 500

指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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	22,733,609.77
等于: 本金	22,724,964.77
加: 应计利息	8,645.00

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	22,733,609.77

#### 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	432,038,215.48	-	355,522,921.96	76,515,293.52	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	778,806.00	6,055.90	792,758.60	7,896.70
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	778,806.00	6,055.90	792,758.60	7,896.70
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	432,817,021.48	6,055.90	356,315,680.56	76,507,396.82	

#### 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	6,171,640.00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	6,171,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,171,640.00	-	-	-

#### 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
IC2407	IC2407	6	5,901,120.00	-270,520.00
合计				-270,520.00
减：可抵销期货暂收款				-270,520.00
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

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	87,363.44
其中：交易所市场	87,363.44
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	20,709.46
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	192,608.26

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) 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	253,598,367.28	253,598,367.28
本期申购	37,971,465.49	37,971,465.49
本期赎回 (以“-”号填列)	-28,538,084.31	-28,538,084.31
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	263,031,748.46	263,031,748.46
汇添富中证 500 指数 (LOF) 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	124,373,410.67	124,373,410.67
本期申购	187,134,467.51	187,134,467.51
本期赎回 (以“-”号填列)	-168,685,297.19	-168,685,297.19
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	142,822,580.99	142,822,580.99

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

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	78,774,176.87	-71,199,390.71	7,574,786.16
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	78,774,176.87	-71,199,390.71	7,574,786.16
本期利润	-6,419,058.98	-13,644,503.78	-20,063,562.76
本期基金份	2,909,474.30	-3,464,882.40	-555,408.10

额交易产生的变动数			
其中：基金申购款	11,675,267.25	-12,498,815.19	-823,547.94
基金赎回款	-8,765,792.95	9,033,932.79	268,139.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,264,592.19	-88,308,776.89	-13,044,184.70
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,418,447.21	-34,585,410.57	1,833,036.64
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	36,418,447.21	-34,585,410.57	1,833,036.64
本期利润	-3,758,856.64	-7,913,275.78	-11,672,132.42
本期基金份额交易产生的变动数	5,580,634.28	-4,950,583.98	630,050.30
其中：基金申购款	53,990,888.20	-55,400,828.44	-1,409,940.24
基金赎回款	-48,410,253.92	50,450,244.46	2,039,990.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,240,224.85	-47,449,270.33	-9,209,045.48

#### 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	167,564.41
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	27,333.28
其他	629.43
合计	195,527.12

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——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	-14,204,951.56
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-14,204,951.56

#### 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	61,114,279.49
减：卖出股票成本总额	75,164,596.56
减：交易费用	154,634.49
买卖股票差价收入	-14,204,951.56

#### 6.4.7.11.3 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	9,985.79
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-2,520.00
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	7,465.79

##### 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	3,163,230.00
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)	3,102,520.00



成本总额	
减：应计利息总额	63,230.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-2,520.00

#### 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
股指期货投资收益	-156,008.60
外汇远期投资收益	-
国债期货投资收益	-
外汇期货投资收益	-

#### 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	5,120,958.28
其中：证券出借权益补偿收入	299,343.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,120,958.28

#### 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	-21,277,379.56
——股票投资	-21,260,978.36
——债券投资	-16,401.20
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-280,400.00
——权证投资	-
——期货投资	-280,400.00
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	-21,557,779.56

#### 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	3,737.90
替代损益	-
其他	-
合计	3,737.90

#### 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	2,222.99
指数使用费	39,672.24
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	103.18
合计	126,533.77

#### 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, 基金发起人
招商证券股份有限公司 (“招商证券”)	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	成交金额	占当期股票成交总额的

		比例 (%)		比例 (%)
招商证券	155,086,620.37	100.00	161,071,840.89	100.00

#### 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 (%)
招商证券	701,806.00	100.00	11,114,396.00	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 (%)
招商证券	114,131.75	100.00	87,363.44	100.00
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 (%)
招商证券	116,182.49	100.00	93,869.41	100.00

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	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管理费	991,804.81	1,049,660.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	297,241.85	323,719.21
应支付基金管理人的净管理费	694,562.96	725,940.85

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 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	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	198,360.96	209,932.05

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

**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		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
招商证券股份有限公司	-	143.78	143.78
东方证券股份有限公司	-	4,644.65	4,644.65
汇添富基金管理股份有限公司	-	20,220.46	20,220.46
合计	-	25,008.89	25,008.89
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
招商证券股份有限公司	-	119.81	119.81
东方证券股份有限公司	-	6,080.26	6,080.26
汇添富基金管理股份有限公司	-	28,899.29	28,899.29
合计	-	35,099.36	35,099.36

注：自 2023 年 9 月 26 日起，本基金 C 类基金份额销售服务费率由 0.25%/年下调为 0.20%/年。

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 0.20%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次

性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 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

单位：人民币元

本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	1,013,232.00	833.46	-	-
招商证券	485,594.00	321.03	-	-

#### 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

单位：人民币元

本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	1,254,963.00	0.81~3.50	2.00	988.22	-	-
招商证券	219,390.00	1.70~2.40	2.35	207.12	-	-
上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日						

关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	5,358,216.00	1.00~3.90	2.32	4,893.27	1,938,210.00	441.90
招商证券	410,084.00	3.20~3.60	3.45	550.36	62,780.00	22.56

#### 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

注：本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额，本报告期及上年度可比期间均未有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

#### 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
400174	中天 3	2023 年 08 月 30 日	重 大 事 项 停 牌	0.01		-	283,500	738,496.28	2,835.00	

注：截止 2024 年 6 月 30 日，本基金合计持有中天 3（在深圳证券交易所退市时的股票简称为\*ST 中天，证券代码为 000540）283,500 股。根据中天金融集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 6 月 29 日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市暨摘牌的公告》，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。

于 2023 年 6 月 17 日起，为维护基金持有人利益，根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定，依据中天金融集团股份有限公司公开披露的信息，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，将本基金所持有\*ST 中天（000540.SZ）按每股 0.01 元人民币估值。

根据公司于 2023 年 8 月 28 日发布的《中天金融集团股份有限公司股票转让公告》，公司可在全国中小企业股份转让系统有限责任公司依托原证券公司代办股份转让系统设立并代为管理的两网公司及退市公司板块（以下简称“退市板块”）转让仅限于原在深圳证券交易所（以下简称“深交所”）挂牌交易的流通股份，确权代码（即挂牌退市板块后的股票代码）：400174，开始转让日为 2023 年 8 月 30 日。根据公司于同日发布的《中天金融集团股份有限公司关于公司股票挂牌当日即暂停转让的公告》，因公司正在进行重整事项，经向全国股转公司申请，公司股票自 2023 年 8 月 30 日起暂停转让。

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险

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

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

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

本报告期内, 本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本 期 末 202 4 年	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
---------------------------	--------	-----------------------	----------	------------------	------------------	-----	----

06 月 30 日							
资产							
货币资金	22,733,609.77	-	-	-	-	-	22,733,609.77
结算备付金	3,398,400.68	-	-	-	-	-	3,398,400.68
存出保证金	35,144.08	-	-	-	-	826,156.80	861,300.88
交易性金融资产	85,247.12	-	707,511.48	-	-	355,522,921.96	356,315,680.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投	-	-	-	-	-	-	-

资							
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	169,753.63	-	-	-	-	1,391,549.66	1,561,303.29
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	26,422,155.28	-	707,511.48	-	-	357,740,628.42	384,870,295.18
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	-	-	-	-	-	926.18	926.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	849,624.14	849,624.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	167,522.11	167,522.11
应付托管费	-	-	-	-	-	33,504.43	33,504.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	24,570.14	24,570.14
应	-	-	-	-	-	-	-

付投资顾问费							
应交税费	-	-	-	-	-	440.65	440.65
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	192,608.26	192,608.26
负债总计	-	-	-	-	-	1,269,195.91	1,269,195.91
利率敏感度缺口	26,422,155.28	-	707,511.48	-	-	356,471,432.51	383,601,099.27
上年度末 2023 年 12 月	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

31 日							
资产							
货币资金	21,735,448.98	-	-	-	-	-	21,735,448.98
结算备付金	3,695,664.48	-	-	-	-	-	3,695,664.48
存出保证金	26,826.17	-	-	-	-	913,382.40	940,208.57
交易性金融资产	2,244,190.58	-	1,013,217.54	-	-	357,976,156.00	361,233,564.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应	-	-	-	-	-	184.33	184.33



收清算款							
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	108,839.69	-	-	-	-	881,207.71	990,047.40
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	21,082.85	21,082.85
资产总计	27,810,969.90	-	1,013,217.54	-	-	359,792,013.29	388,616,200.73
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-

融 负 债							
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付 清 算 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	749,245.11	749,245.11
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	165,024.34	165,024.34
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	33,004.88	33,004.88
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	21,643.35	21,643.35
应 付 投	-	-	-	-	-	-	-

资 顾 问 费							
应 交 税 费	-	-	-	-	-	2,297.61	2,297.61
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
递 延 所 得 税 负 债	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	265,384.69	265,384.69
负 债 总 计	-	-	-	-	-	1,236,599.98	1,236,599.98
利 率 敏 感 度 缺 口	27,810,969.9 0	-	1,013,217.5 4	-	-	358,555,413.3 1	387,379,600.7 5

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	1,016.52	1,164.04
	基准利率增加 25 个基点	-1,013.59	-1,162.12

#### 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	355,522,921.96	92.68	357,976,156.00	92.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	792,758.60	0.21	3,257,408.12	0.84
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	356,315,680.	92.89	361,233,564.	93.25

	56	12
--	----	----

#### 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 500 指数上涨 5%	17,972,321.17	18,248,780.88
	中证 500 指数下跌 5%	-17,972,321.17	-18,248,780.88

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	355,605,334.08
第二层次	707,511.48

第三层次	2,835.00
合计	356,315,680.56

#### 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	355,522,921.96	92.37
	其中：股票	355,522,921.96	92.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	792,758.60	0.21
	其中：债券	792,758.60	0.21
	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	-	-
	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	26,132,010.45	6.79
8	其他各项资产	2,422,604.17	0.63
9	合计	384,870,295.18	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,245,279.00	0.59
B	采矿业	16,747,394.36	4.37
C	制造业	226,096,333.29	58.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,777,493.31	3.33
E	建筑业	3,646,493.00	0.95
F	批发和零售业	7,587,198.90	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	6,650,698.10	1.73
H	住宿和餐饮业	1,134,423.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,453,996.14	6.64
J	金融业	33,283,047.41	8.68
K	房地产业	4,051,559.91	1.06
L	租赁和商务服务业	2,704,273.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	2,869,373.12	0.75
N	水利、环境和公共设施管理业	1,625,752.42	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	398,871.00	0.10
Q	卫生和社会工作	2,221,647.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	5,385,614.00	1.40
S	综合	640,640.00	0.17
	合计	355,520,086.96	92.68

### 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	-	-
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	2,835.00	0.00
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	2,835.00	0.00

### 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	300502	新易盛	42,900	4,528,095.00	1.18
2	002028	思源电气	37,177	2,487,141.30	0.65
3	601058	赛轮轮胎	158,800	2,223,200.00	0.58
4	688169	石头科技	5,540	2,175,004.00	0.57
5	600066	宇通客车	80,200	2,069,160.00	0.54
6	002340	格林美	310,100	1,975,337.00	0.51
7	000933	神火股份	95,100	1,923,873.00	0.50



8	601077	渝农商行	373,800	1,876,476.00	0.49
9	000988	华工科技	60,700	1,816,751.00	0.47
10	601168	西部矿业	100,700	1,807,565.00	0.47
11	300394	天孚通信	20,040	1,771,936.80	0.46
12	002384	东山精密	82,600	1,709,820.00	0.45
13	000423	东阿阿胶	27,200	1,702,720.00	0.44
14	000630	铜陵有色	463,400	1,672,874.00	0.44
15	600418	江淮汽车	105,500	1,671,120.00	0.44
16	600988	赤峰黄金	100,500	1,642,170.00	0.43
17	601233	桐昆股份	101,900	1,626,324.00	0.42
18	002625	光启技术	91,100	1,580,585.00	0.41
19	600096	云天化	77,500	1,505,050.00	0.39
20	601567	三星医疗	42,600	1,491,000.00	0.39
21	000400	许继电气	43,100	1,483,071.00	0.39
22	688777	中控技术	38,200	1,440,140.00	0.38
23	002156	通富微电	64,000	1,432,960.00	0.37
24	002128	电投能源	67,700	1,428,470.00	0.37
25	002273	水晶光电	83,981	1,425,997.38	0.37
26	601555	东吴证券	239,990	1,415,941.00	0.37
27	002078	太阳纸业	101,200	1,411,740.00	0.37
28	600885	宏发股份	50,318	1,392,802.24	0.36
29	601128	常熟银行	182,060	1,378,194.20	0.36

30	002532	天山铝业	168,500	1,366,535.00	0.36
31	300207	欣旺达	90,000	1,365,300.00	0.36
32	002223	鱼跃医疗	36,300	1,364,880.00	0.36
33	600352	浙江龙盛	157,100	1,349,489.00	0.35
34	600398	海澜之家	145,000	1,339,800.00	0.35
35	002138	顺络电子	48,700	1,337,302.00	0.35
36	002966	苏州银行	177,140	1,328,550.00	0.35
37	002353	杰瑞股份	37,091	1,301,152.28	0.34
38	601108	财通证券	196,250	1,297,212.50	0.34
39	600765	中航重机	62,620	1,277,448.00	0.33
40	688617	惠泰医疗	2,800	1,277,080.00	0.33
41	002185	华天科技	154,800	1,261,620.00	0.33
42	002517	恺英网络	130,000	1,241,500.00	0.32
43	600879	航天电子	159,400	1,238,538.00	0.32
44	603606	东方电缆	24,900	1,215,369.00	0.32
45	301236	软通动力	34,500	1,214,745.00	0.32
46	600873	梅花生物	120,600	1,208,412.00	0.32
47	688099	晶晨半导体	20,174	1,196,721.68	0.31
48	600177	雅戈尔	167,700	1,194,024.00	0.31
49	601577	长沙银行	145,700	1,191,826.00	0.31
50	600079	人福医药	69,000	1,184,730.00	0.31
51	600109	国金证券	156,900	1,184,595.00	0.31
52	002738	中矿资	44,020	1,179,736.00	0.31

		源			
53	600060	海信视像	47,300	1,170,202.00	0.31
54	300017	网宿科技	147,400	1,164,460.00	0.30
55	300003	乐普医疗	77,700	1,153,068.00	0.30
56	600497	驰宏锌锗	215,200	1,149,168.00	0.30
57	300136	信维通信	58,400	1,143,472.00	0.30
58	603160	汇顶科技	16,600	1,141,250.00	0.30
59	603979	金诚信	22,400	1,131,872.00	0.30
60	002202	金风科技	166,700	1,120,224.00	0.29
61	002739	万达电影	92,100	1,113,489.00	0.29
62	689009	九号公司	30,185	1,111,109.85	0.29
63	000932	华菱钢铁	250,280	1,108,740.40	0.29
64	688120	华海清科	5,813	1,102,028.54	0.29
65	000683	远兴能源	157,700	1,089,707.00	0.28
66	600985	淮北矿业	65,014	1,088,334.36	0.28
67	600536	中国软件	36,360	1,087,891.20	0.28
68	002465	海格通信	104,900	1,086,764.00	0.28
69	600348	华阳股份	108,950	1,085,142.00	0.28
70	002409	雅克科技	17,200	1,082,052.00	0.28
71	002444	巨星科技	43,600	1,076,920.00	0.28
72	002281	光迅科技	28,805	1,076,442.85	0.28
73	000009	中国宝安	124,540	1,071,044.00	0.28
74	002008	大族激光	50,800	1,056,640.00	0.28

		光			
75	000878	云南铜业	84,700	1,055,362.00	0.28
76	688122	西部超导	27,525	1,054,758.00	0.27
77	300474	景嘉微	16,650	1,052,779.50	0.27
78	002436	兴森科技	102,000	1,052,640.00	0.27
79	601615	明阳智能	109,700	1,035,568.00	0.27
80	002797	第一创业	203,000	1,033,270.00	0.27
81	000039	中集集团	111,200	1,029,712.00	0.27
82	300054	鼎龙股份	45,300	1,027,404.00	0.27
83	601990	南京证券	133,500	1,025,280.00	0.27
84	600298	安琪酵母	36,700	1,025,031.00	0.27
85	000066	中国长城	116,900	1,022,875.00	0.27
86	300012	华测检测	101,600	1,022,096.00	0.27
87	600529	山东药玻	40,100	1,016,134.00	0.26
88	600642	申能股份	114,400	1,010,152.00	0.26
89	601666	平煤股份	89,700	1,004,640.00	0.26
90	002673	西部证券	161,900	1,002,161.00	0.26
91	600839	四川长虹	223,000	1,001,270.00	0.26
92	688525	佰维存储	15,600	1,000,740.00	0.26
93	603596	伯特利	25,600	995,840.00	0.26
94	601179	中国西电	123,800	995,352.00	0.26
95	000831	中国稀土	38,400	973,440.00	0.25
96	300395	菲利华	31,431	966,503.25	0.25
97	603816	顾家家	29,800	962,242.00	0.25

		居			
98	300002	神州泰岳	118,400	961,408.00	0.25
99	002432	九安医疗	23,700	960,798.00	0.25
100	000783	长江证券	198,500	958,755.00	0.25
101	000728	国元证券	158,100	958,086.00	0.25
102	000738	航发控制	47,600	955,332.00	0.25
103	600862	中航高科	50,501	948,408.78	0.25
104	000703	恒逸石化	132,800	941,552.00	0.25
105	688180	君实生物	32,342	939,535.10	0.24
106	601198	东兴证券	117,100	932,116.00	0.24
107	601997	贵阳银行	176,600	930,682.00	0.24
108	603338	浙江鼎力	15,300	924,426.00	0.24
109	002595	豪迈科技	24,200	923,714.00	0.24
110	601717	郑煤机	62,400	923,520.00	0.24
111	000960	锡业股份	59,600	923,204.00	0.24
112	603345	安井食品	12,400	921,444.00	0.24
113	002155	湖南黄金	50,800	919,480.00	0.24
114	600863	内蒙华电	197,000	914,080.00	0.24
115	601696	中银证券	100,600	913,448.00	0.24
116	601162	天风证券	418,600	912,548.00	0.24
117	300037	新宙邦	31,860	909,921.60	0.24
118	688188	上海柏楚电子科技	4,924	908,724.20	0.24
119	600038	中直股	22,100	908,531.00	0.24

		份			
120	300866	安克创新	12,750	907,927.50	0.24
121	300724	捷佳伟创	16,800	907,368.00	0.24
122	600521	华海药业	53,100	905,355.00	0.24
123	000921	海信家电	28,011	903,074.64	0.24
124	603939	益丰药房	36,624	899,119.20	0.23
125	002472	双环传动	40,800	898,416.00	0.23
126	002294	信立泰	33,700	897,431.00	0.23
127	300001	特锐德	44,601	897,372.12	0.23
128	002984	森麒麟	37,200	896,148.00	0.23
129	600141	兴发集团	46,640	889,891.20	0.23
130	600549	厦门钨业	51,400	886,650.00	0.23
131	600699	均胜电子	59,500	881,790.00	0.23
132	002407	多氟多	72,020	880,804.60	0.23
133	600546	山煤国际	59,800	874,276.00	0.23
134	300699	光威复材	35,100	871,533.00	0.23
135	002850	科达利	11,400	870,732.00	0.23
136	600820	隧道股份	132,900	867,837.00	0.23
137	002262	恩华药业	36,500	866,510.00	0.23
138	600895	张江高科	46,800	864,864.00	0.23
139	301358	湖南裕能	27,400	862,004.00	0.22
140	600369	西南证券	240,700	861,706.00	0.22
141	002195	岩山科技	343,001	860,932.51	0.22
142	300285	国瓷材料	48,200	860,370.00	0.22
143	600872	中炬高	37,900	859,951.00	0.22

		新			
144	002064	华峰化学	119,900	859,683.00	0.22
145	603589	口子窖	21,704	850,579.76	0.22
146	000021	深科技	56,000	846,720.00	0.22
147	601000	唐山港	178,930	840,971.00	0.22
148	600021	上海电力	85,000	840,650.00	0.22
149	300073	当升科技	24,500	840,595.00	0.22
150	603087	甘李药业	18,100	838,392.00	0.22
151	300146	汤臣倍健	61,600	834,680.00	0.22
152	600486	扬农化工	14,690	829,250.50	0.22
153	000513	丽珠集团	22,264	828,443.44	0.22
154	601966	玲珑轮胎	44,500	817,465.00	0.21
155	300058	蓝色光标	150,200	817,088.00	0.21
156	600704	物产中大	188,100	816,354.00	0.21
157	002756	永兴材料	22,760	814,352.80	0.21
158	600153	建发股份	90,700	809,951.00	0.21
159	600155	华创云信	136,500	806,715.00	0.21
160	300114	中航电测	17,800	805,450.00	0.21
161	000830	鲁西化工	69,393	804,264.87	0.21
162	603179	新泉股份	20,400	800,496.00	0.21
163	688065	凯赛生物	17,600	798,864.00	0.21
164	300529	健帆生物	29,300	797,253.00	0.21
165	600118	中国卫星	35,700	793,611.00	0.21
166	600583	海油工	133,500	788,985.00	0.21

		程			
167	002558	巨人网络	83,400	787,296.00	0.21
168	002152	广电运通	75,000	784,500.00	0.20
169	601156	东航物流	38,300	779,405.00	0.20
170	000591	太阳能	165,200	778,092.00	0.20
171	000623	吉林敖东	57,800	774,520.00	0.20
172	002025	航天电器	16,600	769,908.00	0.20
173	600970	中材国际	63,800	769,428.00	0.20
174	300373	扬杰科技	19,700	766,330.00	0.20
175	002385	大北农	198,600	764,610.00	0.20
176	300144	宋城演艺	94,900	762,047.00	0.20
177	002439	启明星辰	44,100	761,166.00	0.20
178	600380	健康元	67,608	755,181.36	0.20
179	601216	君正集团	203,800	752,022.00	0.20
180	000729	燕京啤酒	85,100	751,433.00	0.20
181	605358	立昂微	32,400	749,736.00	0.20
182	600143	金发科技	112,900	746,269.00	0.19
183	000723	美锦能源	156,700	745,892.00	0.19
184	300251	光线传媒	88,600	745,126.00	0.19
185	600998	九州通	152,251	742,984.88	0.19
186	600282	南钢股份	148,900	741,522.00	0.19
187	600637	东方明珠	121,800	740,544.00	0.19
188	000519	中兵红箭	50,400	739,368.00	0.19
189	600516	方大炭素	170,200	733,562.00	0.19
190	300383	光环新	86,800	733,460.00	0.19



		网			
191	300677	英科医疗	27,340	732,985.40	0.19
192	000636	风华高科	55,900	730,054.00	0.19
193	600392	盛和资源	84,660	729,769.20	0.19
194	600763	通策医疗	13,500	729,675.00	0.19
195	300024	机器人	74,900	729,526.00	0.19
196	000818	航锦科技	32,800	724,224.00	0.19
197	002958	青农商行	268,400	719,312.00	0.19
198	601665	齐鲁银行	146,000	716,860.00	0.19
199	600909	华安证券	170,170	716,415.70	0.19
200	002044	美年健康	189,100	714,798.00	0.19
201	600008	首创环保	265,940	712,719.20	0.19
202	000883	湖北能源	118,100	709,781.00	0.19
203	688213	思特威电子科技	14,600	708,100.00	0.18
204	600511	国药股份	22,802	702,073.58	0.18
205	000629	钒钛股份	280,600	701,500.00	0.18
206	600867	通化东宝	83,800	701,406.00	0.18
207	601016	节能风电	234,550	701,304.50	0.18
208	600566	济川药业	22,000	697,620.00	0.18
209	300088	长信科技	148,200	696,540.00	0.18
210	601456	国联证券	72,100	695,044.00	0.18
211	000997	新大陆	49,900	694,109.00	0.18

212	600170	上海建工	321,900	692,085.00	0.18
213	600582	天地科技	100,000	689,000.00	0.18
214	600499	科达制造	81,100	683,673.00	0.18
215	600498	烽火通信	42,900	682,110.00	0.18
216	600129	太极集团	23,566	681,528.72	0.18
217	600535	天士力	54,100	680,578.00	0.18
218	601933	永辉超市	274,000	679,520.00	0.18
219	002120	韵达股份	87,500	677,250.00	0.18
220	600004	白云机场	71,400	676,872.00	0.18
221	601991	大唐发电	224,500	675,745.00	0.18
222	000750	国海证券	231,350	673,228.50	0.18
223	600580	卧龙电驱	55,400	673,110.00	0.18
224	000598	兴蓉环境	89,400	672,288.00	0.18
225	000060	中金岭南	158,000	669,920.00	0.17
226	002261	拓维信息	60,500	669,735.00	0.17
227	603000	人民网	33,400	667,666.00	0.17
228	300567	精测电子	11,800	666,818.00	0.17
229	300118	东方日升	55,100	666,710.00	0.17
230	300568	星源材质	81,200	665,840.00	0.17
231	002430	杭氧股份	29,700	660,825.00	0.17
232	002429	兆驰股份	136,700	657,527.00	0.17
233	603486	科沃斯	13,900	655,802.00	0.17
234	603658	安图生物	14,200	654,194.00	0.17

235	002939	长城证 券	97,400	652,580.00	0.17
236	600166	福田汽 车	290,000	652,500.00	0.17
237	603156	养元饮 品	30,600	650,862.00	0.17
238	600325	华发股 份	99,700	648,050.00	0.17
239	603228	景旺电 子	20,301	645,571.80	0.17
240	600816	建元信 托	237,800	644,438.00	0.17
241	601231	环旭电 子	40,000	642,000.00	0.17
242	300765	新诺威	25,400	640,842.00	0.17
243	600673	东阳光	91,000	640,640.00	0.17
244	300487	蓝晓科 技	15,250	636,840.00	0.17
245	603568	伟明环 保	30,899	635,901.42	0.17
246	603927	中科软	35,108	635,103.72	0.17
247	000893	亚钾国 际	39,300	635,088.00	0.17
248	002508	老板电 器	28,700	634,270.00	0.17
249	600754	锦江酒 店	27,600	634,248.00	0.17
250	300601	康泰生 物	40,500	632,205.00	0.16
251	000027	深圳能 源	86,160	628,968.00	0.16
252	601636	旗滨集 团	97,200	626,940.00	0.16
253	002926	华西证 券	95,100	626,709.00	0.16
254	000998	隆平高 科	63,600	625,188.00	0.16
255	600563	法拉电 子	8,201	624,752.18	0.16
256	002624	完美世 界	82,000	623,200.00	0.16
257	002497	雅化集 团	69,600	620,832.00	0.16

258	603298	杭叉集团	31,600	620,624.00	0.16
259	002653	海思科	20,200	620,140.00	0.16
260	603290	斯达半导	7,200	619,992.00	0.16
261	600737	中粮糖业	64,600	619,514.00	0.16
262	601866	中远海发	239,100	616,878.00	0.16
263	300604	长川科技	22,700	616,759.00	0.16
264	688052	纳芯微电子	6,000	616,680.00	0.16
265	603077	和邦生物	373,300	615,945.00	0.16
266	300253	卫宁健康	104,300	615,370.00	0.16
267	002299	圣农发展	45,000	613,800.00	0.16
268	002065	东华软件	135,500	612,460.00	0.16
269	600131	国网信通	36,300	612,381.00	0.16
270	002056	横店东磁	49,100	612,277.00	0.16
271	002500	山西证券	130,010	611,047.00	0.16
272	300390	天华新能	35,440	608,859.20	0.16
273	601958	金钼股份	58,400	607,944.00	0.16
274	688772	珠海冠宇电池	40,769	607,458.10	0.16
275	002414	高德红外	103,100	607,259.00	0.16
276	600373	中文传媒	40,900	606,956.00	0.16
277	688385	复旦微电	19,337	606,795.06	0.16
278	688002	睿创微纳	21,677	606,305.69	0.16
279	600655	豫园股份	117,600	605,640.00	0.16

280	300009	安科生物	70,876	605,281.04	0.16
281	300763	锦浪科技	14,500	603,780.00	0.16
282	603893	瑞芯微	10,100	597,617.00	0.16
283	002507	涪陵榨菜	48,750	597,187.50	0.16
284	688114	华大智造	12,535	594,284.35	0.15
285	002372	伟星新材	38,480	593,361.60	0.15
286	002368	太极股份	26,302	593,110.10	0.15
287	600707	彩虹股份	86,700	590,427.00	0.15
288	601611	中国核建	72,900	589,761.00	0.15
289	603885	吉祥航空	53,500	587,965.00	0.15
290	000887	中鼎股份	47,700	583,848.00	0.15
291	002203	海亮股份	72,400	577,752.00	0.15
292	603379	三美股份	14,700	575,358.00	0.15
293	002831	裕同科技	22,480	575,263.20	0.15
294	603225	新凤鸣	36,820	574,023.80	0.15
295	688390	固德威电源	10,206	572,760.72	0.15
296	600859	王府井	48,002	563,543.48	0.15
297	688521	芯原微电子	21,063	563,435.25	0.15
298	600995	南网储能	57,900	559,314.00	0.15
299	600801	华新水泥	40,600	558,250.00	0.15
300	600329	达仁堂	17,200	557,108.00	0.15
301	600416	湘电股份	56,000	556,640.00	0.15
302	600884	杉杉股份	68,200	553,784.00	0.14
303	002683	广东宏	27,500	553,575.00	0.14

		大			
304	300070	碧水源	131,300	550,147.00	0.14
305	600390	五矿资本	135,800	549,990.00	0.14
306	300296	利亚德	122,200	549,900.00	0.14
307	002019	亿帆医药	44,400	548,784.00	0.14
308	002506	协鑫集成	282,600	548,244.00	0.14
309	600435	北方导航	63,400	546,508.00	0.14
310	002244	滨江集团	75,100	545,226.00	0.14
311	600739	辽宁成大	64,700	541,539.00	0.14
312	600755	厦门国贸	75,500	541,335.00	0.14
313	600483	福能股份	46,400	541,024.00	0.14
314	000050	深天马 A	74,200	540,176.00	0.14
315	601098	中南传媒	43,400	539,028.00	0.14
316	300803	指南针	14,800	538,868.00	0.14
317	300748	金力永磁	41,480	537,580.80	0.14
318	600399	抚顺特钢	95,300	536,539.00	0.14
319	601598	中国外运	95,200	535,976.00	0.14
320	600598	北大荒	42,900	535,821.00	0.14
321	002572	索菲亚	34,900	535,017.00	0.14
322	002568	百润股份	31,700	533,511.00	0.14
323	600901	江苏金租	105,500	532,775.00	0.14
324	000155	川能动力	49,200	529,884.00	0.14
325	300676	华大基因	15,100	528,651.00	0.14
326	002487	大金重工	23,100	528,528.00	0.14
327	600848	上海临	57,800	526,558.00	0.14

		港			
328	002080	中材科技	40,500	522,450.00	0.14
329	002240	盛新锂能	38,900	522,038.00	0.14
330	002373	千方科技	57,200	518,804.00	0.14
331	002557	洽洽食品	18,400	518,696.00	0.14
332	002936	郑州银行	298,865	517,036.45	0.13
333	001286	陕西能源	44,500	513,085.00	0.13
334	688301	奕瑞科技股份	4,428	510,238.44	0.13
335	300595	欧普康视	32,500	509,600.00	0.13
336	000563	陕国投 A	185,220	509,355.00	0.13
337	603712	七一二	27,976	508,883.44	0.13
338	002268	电科网安	35,730	508,437.90	0.13
339	603858	步长制药	33,400	506,010.00	0.13
340	600968	海油发展	122,800	505,936.00	0.13
341	601928	凤凰传媒	46,100	505,256.00	0.13
342	000778	新兴铸管	144,500	502,860.00	0.13
343	688017	绿的谐波	6,095	500,399.50	0.13
344	600258	首旅酒店	40,500	500,175.00	0.13
345	688538	和辉光电	251,082	497,142.36	0.13
346	601212	白银有色	178,800	497,064.00	0.13
347	300558	贝达药业	15,200	494,760.00	0.13
348	600271	航天信息	67,100	493,856.00	0.13
349	603883	老百姓	26,811	492,249.96	0.13

350	688234	天岳先进	10,478	491,627.76	0.13
351	600062	华润双鹤	25,100	491,458.00	0.13
352	600528	中铁工业	67,100	491,172.00	0.13
353	600977	中国电影	45,100	485,276.00	0.13
354	002531	天顺风能	54,200	484,548.00	0.13
355	000709	河钢股份	249,700	484,418.00	0.13
356	601155	新城控股	54,593	484,239.91	0.13
357	603688	石英股份	16,350	484,123.50	0.13
358	002408	齐翔腾达	85,820	480,592.00	0.13
359	688536	思瑞浦股份	4,904	479,660.24	0.13
360	000739	普洛药业	35,300	479,021.00	0.12
361	600959	江苏有线	181,200	478,368.00	0.12
362	600378	昊华科技	16,500	476,850.00	0.12
363	688220	翱捷科技	12,716	476,341.36	0.12
364	688005	容百科技	20,419	475,354.32	0.12
365	601118	海南橡胶	103,400	470,470.00	0.12
366	000825	太钢不锈	138,100	466,778.00	0.12
367	603444	吉比特	2,600	462,826.00	0.12
368	603737	三棵树	12,760	462,805.20	0.12
369	603882	金域医学	17,000	462,230.00	0.12
370	688331	荣昌生物	10,656	460,339.20	0.12
371	000987	越秀资本	90,925	450,988.00	0.12
372	688200	华峰测	4,900	449,575.00	0.12



		控			
373	601399	国机重 装	174,200	449,436.00	0.12
374	600906	财达证 券	78,400	449,232.00	0.12
375	600517	国网英 大	103,600	448,588.00	0.12
376	600612	老凤祥	7,700	448,063.00	0.12
377	603456	九洲药 业	32,600	447,272.00	0.12
378	600056	中国医 药	44,160	446,899.20	0.12
379	601019	山东出 版	37,800	446,796.00	0.12
380	300212	易华录	26,180	440,609.40	0.11
381	002266	浙富控 股	157,600	439,704.00	0.11
382	600316	洪都航 空	26,001	432,396.63	0.11
383	000937	冀中能 源	64,000	428,800.00	0.11
384	603650	彤程新 材	14,500	428,475.00	0.11
385	600871	石化油 服	245,800	427,692.00	0.11
386	603529	爱玛科 技	15,600	426,348.00	0.11
387	688567	孚能科 技	44,258	424,876.80	0.11
388	600925	苏能股 份	83,200	420,160.00	0.11
389	002423	中粮资 本	55,600	416,444.00	0.11
390	000032	深桑达 A	27,500	411,950.00	0.11
391	001227	兰州银 行	171,900	409,122.00	0.11
392	688063	派能科 技	10,300	409,013.00	0.11
393	601965	中国汽 研	24,200	408,738.00	0.11
394	603728	鸣志电 器	10,100	406,323.00	0.11

395	600208	新湖中宝	256,900	405,902.00	0.11
396	601298	青岛港	42,300	404,388.00	0.11
397	688297	中航无人 机	12,224	403,758.72	0.11
398	601608	中信重 工	104,800	399,288.00	0.10
399	002607	中公教 育	260,700	398,871.00	0.10
400	002670	国盛金 控	46,698	395,532.06	0.10
401	600663	陆家嘴	44,800	395,136.00	0.10
402	688516	奥特维 科技	9,449	395,062.69	0.10
403	603233	大参林	27,552	393,993.60	0.10
404	600578	京能电 力	121,300	393,012.00	0.10
405	688561	奇安信 集团	16,600	392,092.00	0.10
406	300438	鹏辉能 源	21,300	390,642.00	0.10
407	600098	广州发 展	60,900	389,760.00	0.10
408	300357	我武生 物	19,000	384,180.00	0.10
409	601106	中国一 重	165,600	382,536.00	0.10
410	600377	宁沪高 速	30,000	378,000.00	0.10
411	600500	中化国 际	108,300	377,967.00	0.10
412	300776	帝尔激 光	8,220	377,791.20	0.10
413	003031	中瓷电 子	8,140	376,393.60	0.10
414	002865	钧达股 份	9,700	372,286.00	0.10
415	600967	内蒙一 机	51,400	370,080.00	0.10
416	000785	居然之 家	151,800	368,874.00	0.10
417	600315	上海家 化	20,400	362,712.00	0.09

418	688349	三一重能	14,575	362,043.00	0.09
419	600350	山东高速	40,900	361,965.00	0.09
420	300888	稳健医疗	14,160	358,248.00	0.09
421	600827	百联股份	48,400	357,192.00	0.09
422	000958	电投产融	97,500	356,850.00	0.09
423	000537	中绿电	37,400	356,422.00	0.09
424	000559	万向钱潮	79,800	355,908.00	0.09
425	688425	铁建重工	96,674	355,760.32	0.09
426	002608	江苏国信	45,600	353,400.00	0.09
427	601568	北元集团	94,890	352,041.90	0.09
428	002690	美亚光电	21,330	351,945.00	0.09
429	000156	华数传媒	55,900	351,052.00	0.09
430	603707	健友股份	29,259	347,596.92	0.09
431	603517	绝味食品	22,500	346,500.00	0.09
432	002867	周大生	26,500	346,090.00	0.09
433	688029	南微医学科技	5,620	345,967.20	0.09
434	601992	金隅集团	251,700	344,829.00	0.09
435	603826	坤彩科技	11,840	343,004.80	0.09
436	688032	禾迈股份	2,931	336,420.18	0.09
437	600126	杭钢股份	81,520	335,047.20	0.09
438	300682	朗新集团	39,300	334,443.00	0.09
439	003022	联泓新科	24,200	331,782.00	0.09
440	688475	萤石网	9,600	327,456.00	0.09

		络			
441	000967	盈峰环境	76,800	324,864.00	0.08
442	603218	日月股份	31,120	319,602.40	0.08
443	688520	神州细胞集团公司	8,120	319,522.00	0.08
444	688778	厦钨新能源	10,205	318,804.20	0.08
445	600032	浙江新能	43,600	317,408.00	0.08
446	600481	双良节能	67,800	316,626.00	0.08
447	600361	创新新材	78,500	316,355.00	0.08
448	600339	中油工程	101,100	315,432.00	0.08
449	301267	华夏眼科	15,200	314,944.00	0.08
450	603786	科博达	4,900	314,335.00	0.08
451	600095	湘财股份	51,800	308,728.00	0.08
452	000898	鞍钢股份	144,400	306,128.00	0.08
453	688248	南方电网电力科技	10,300	305,189.00	0.08
454	603127	昭衍新药	22,856	303,299.12	0.08
455	003035	南网能源	68,500	301,400.00	0.08
456	688281	华秦科技实业	3,580	298,285.60	0.08
457	600808	马钢股份	145,200	293,304.00	0.08
458	002563	森马服饰	48,800	283,528.00	0.07
459	002153	石基信息	49,478	283,508.94	0.07
460	603185	弘元绿能	16,400	280,276.00	0.07
461	601228	广州港	91,100	277,855.00	0.07

462	000539	粤电力 A	53,800	273,304.00	0.07
463	001872	招商港口	14,000	269,500.00	0.07
464	688779	长远锂科	58,177	269,359.51	0.07
465	600928	西安银行	80,500	263,235.00	0.07
466	001203	大中矿业	27,300	262,353.00	0.07
467	000401	冀东水泥	64,200	260,652.00	0.07
468	688006	浙江杭可科技	14,696	256,445.20	0.07
469	000959	首钢股份	94,100	255,952.00	0.07
470	600764	中国海防	12,900	253,227.00	0.07
471	002518	科士达	14,200	251,340.00	0.07
472	603056	德邦股份	18,601	243,673.10	0.06
473	603305	旭升集团	22,500	237,600.00	0.06
474	600299	安迪苏	24,300	235,710.00	0.06
475	688172	燕东微电子股份	14,400	232,992.00	0.06
476	601139	深圳燃气	34,700	231,796.00	0.06
477	300861	美畅股份	11,600	224,460.00	0.06
478	603317	天味食品	19,316	220,395.56	0.06
479	688276	长春百克生物科技	7,570	214,760.90	0.06
480	688375	国博电子	3,000	211,920.00	0.06
481	688387	中信科移动	41,245	207,874.80	0.05
482	301029	怡合达	10,460	205,643.60	0.05
483	002791	坚朗五金	7,800	201,786.00	0.05

484	688819	天能电 池集团 股份	8,325	198,634.50	0.05
485	600927	永安期 货	17,600	196,240.00	0.05
486	688153	唯捷创 芯	5,100	188,700.00	0.05
487	688107	安路科 技	7,378	187,548.76	0.05
488	601858	中国科 传	9,500	181,640.00	0.05
489	000031	大悦城	77,600	181,584.00	0.05
490	601158	重庆水 务	34,800	167,040.00	0.04
491	601828	美凯龙	65,500	167,025.00	0.04
492	002945	华林证 券	16,300	162,674.00	0.04
493	688348	昱能科 技	2,700	159,300.00	0.04
494	600956	新天绿 能	18,533	151,414.61	0.04
495	688295	中复神 鹰碳纤 维	6,040	122,612.00	0.03
496	301165	锐捷网 络	4,100	122,344.00	0.03
497	603868	飞科电 器	2,900	111,360.00	0.03

### 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	400174	中天 3	283,500	2,835.00	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	688777	中控技术	1,650,072.16	0.43
2	601567	三星医疗	1,466,888.00	0.38
3	002202	金风科技	1,281,645.00	0.33
4	688617	惠泰医疗	1,238,072.03	0.32
5	601615	明阳智能	1,210,834.00	0.31
6	002436	兴森科技	1,188,742.00	0.31
7	603979	金诚信	1,173,223.00	0.30
8	301358	湖南裕能	1,142,336.00	0.29
9	300002	神州泰岳	1,114,871.00	0.29
10	000921	海信家电	1,095,685.37	0.28
11	300054	鼎龙股份	1,067,770.00	0.28
12	600872	中炬高新	1,018,552.00	0.26
13	603345	安井食品	1,018,305.00	0.26
14	002984	森麒麟	954,618.00	0.25
15	688525	佰维存储	910,612.79	0.24
16	603179	新泉股份	890,394.00	0.23
17	603087	甘李药业	868,130.00	0.22
18	000818	航锦科技	832,648.00	0.21
19	688065	凯赛生物	823,169.85	0.21
20	600763	通策医疗	800,298.00	0.21

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	002463	沪电股份	3,091,717.00	0.80
2	002422	科伦药业	2,625,929.00	0.68
3	000975	银泰黄金	2,092,662.44	0.54
4	600160	巨化股份	1,922,504.00	0.50
5	300418	昆仑万维	1,866,144.00	0.48
6	600157	永泰能源	1,705,880.00	0.44
7	600161	天坛生物	1,646,218.00	0.42
8	600415	小商品城	1,444,792.00	0.37
9	600482	中国动力	1,279,763.00	0.33
10	688072	拓荆科技	1,227,725.92	0.32
11	601880	辽港股份	1,199,755.00	0.31
12	002600	领益智造	906,505.00	0.23
13	600022	山东钢铁	805,782.00	0.21

14	688728	格科微有限公司	665,761.88	0.17
15	002131	利欧股份	588,837.64	0.15
16	000581	威孚高科	556,753.00	0.14
17	002032	苏泊尔	539,006.00	0.14
18	000547	航天发展	523,274.00	0.14
19	300026	红日药业	497,143.00	0.13
20	002092	ST 中泰	492,266.00	0.13

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	93,972,340.88
卖出股票收入（成交）总额	61,114,279.49

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	707,511.48	0.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	85,247.12	0.02
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	792,758.60	0.21

### 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	019733	24 国债 02	7,000	707,511.48	0.18



2	118030	睿创转债	770	85,247.12	0.02
---	--------	------	-----	-----------	------

### 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,以降低交易成本和组合风险,提高投资效率。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

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

#### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	861,300.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,561,303.29

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,422,604.17

#### 7.12.4 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	118030	睿创转债	85,247.12	0.02

#### 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	400174	中天 3	2,835.00	0.00	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

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 (%)
汇添富中证 500 指数 (LOF)	13,505	19,476.62	10,014,906.28	3.81	253,016,842.18	96.19

A						
汇添富 中证 500 指数 (LOF) C	16,401	8,708.16	12,289,353.43	8.60	130,533,227.56	91.40
合计	29,906	13,571.00	22,304,259.71	5.50	383,550,069.74	94.50

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	王增有	1,048,431.00	13.15
2	谢晓明	235,700.00	2.96
3	钟爱民	166,061.00	2.08
4	施丽丽	139,900.00	1.75
5	高明英	137,684.00	1.73
6	何涛	130,000.00	1.63
7	余建萍	125,300.00	1.57
8	郑凯鹏	124,120.00	1.56
9	王轶轮	104,512.00	1.31
10	毕艳	103,205.00	1.29
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	黄晖	1,567,210.00	43.09
2	赵丽妹	200,018.00	5.50
3	郑凯鹏	178,829.00	4.92
4	欧阳东	150,000.00	4.12
5	吴斌珍	100,000.00	2.75
6	顾奔驰	99,018.00	2.72
7	殷彭深	55,000.00	1.51
8	曲吉武	51,000.00	1.40
9	吴玉兰	50,500.00	1.39
10	程婕	50,029.00	1.38

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

## 8.3 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	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	429,534.44	0.16
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	353.06	0.00
	合计	429,887.50	0.11

#### 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	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	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0

#### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,002,700.27 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 08 月 10 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	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份额总额	253,598,367.28	124,373,410.67
本报告期基金总申购份额	37,971,465.49	187,134,467.51
减：本报告期基金总赎回份额	28,538,084.31	168,685,297.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	263,031,748.46	142,822,580.99

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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期无涉及公募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，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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 (%)	
招商证券	3	155,086,620.37	100.00	114,131.75	100.00	

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 (%)
招商证券	701,806.00	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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

## § 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 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）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