

# 汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资 基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工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。

基金托管人中国工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 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	18
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	19
§ 5 托管人报告 .....	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	19
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	19
6.1 资产负债表 .....	19
6.2 利润表 .....	21
6.3 净资产变动表 .....	22
6.4 报表附注 .....	23
§ 7 投资组合报告 .....	49
7.1 期末基金资产组合情况 .....	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
7.12 投资组合报告附注.....	74
§ 8 基金份额持有人信息.....	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	75
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
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.....	76
§ 9 开放式基金份额变动.....	76
§ 10 重大事件揭示.....	76
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
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.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
10.4 基金投资策略的改变.....	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
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.....	77
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
10.8 其他重大事件.....	81
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
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.....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§ 12 备查文件目录.....	82
12.1 备查文件目录.....	82
12.2 存放地点.....	83
12.3 查阅方式.....	83

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富上证综合 ETF
场内简称	上证综合
基金主代码	510980
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 22 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	170,798,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 12 月 01 日

注：扩位证券简称：上证综合 ETF。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金的股票投资主要采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托量化投资方法，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	上证综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	(010) 66105798

注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	李文	廖林

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年01月01日 - 2024年06月30日)
本期已实现收益	7,717,495.77
本期利润	11,673,661.33
加权平均基金份额本期利润	0.0660
本期加权平均净值利润率	6.68%
本期基金份额净值增长率	2.58%
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	1,329,220.92
期末可供分配基金份额利润	0.0078
期末基金资产净值	172,127,220.92
期末基金份额净值	1.0078
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	0.78%

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），

计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

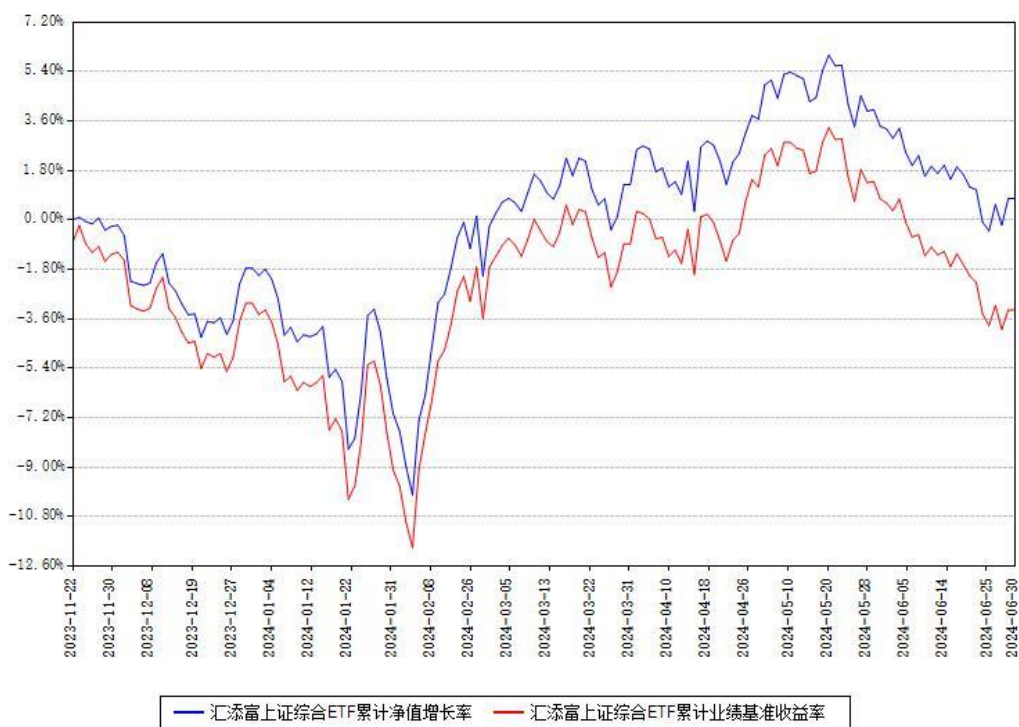
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.45%	0.58%	-3.87%	0.55%	1.42%	0.03%
过去三个月	-0.49%	0.73%	-2.43%	0.72%	1.94%	0.01%
过去六个月	2.58%	0.94%	-0.25%	0.95%	2.83%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	0.78%	0.88%	-3.28%	0.90%	4.06%	-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

汇添富上证综合ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为2023年11月22日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金已完成建仓，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	2023 年 11 月 22 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。2011 年 9 月 16 日至

					<p>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</p>
--	--	--	--	--	---

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

				<p>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联接基金的基金经理。2021年10月29日至今任汇添富MSCI中国A50互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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联接基金的基金经理。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。2022年4月28日</p>
--	--	--	--	---

					<p>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。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。2023 年 6 月 6 日至今任汇添富量化选股混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。</p>
孙浩	本基金的基金经理	2023 年 12 月 12 日	-	4	<p>国籍：中国。学历：北京大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格，CFA。从业经历：2020 年 7 月起任汇添富基金管理股份有限公</p>

					<p>司数量分析师。</p> <p>2023 年 8 月 29 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 9 月 28 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 11 月 28 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 11 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>年 12 月 12 日至今任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 日至今任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 26 日至今任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投</p>
--	--	--	--	--	--

					资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 4 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 20 日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

上半年国内经济总体运行平稳，GDP 同比增长 5.0%，规模以上工业增加值同比增长 6.0%，社零同比增长 3.7%，固定资产投资同比增长 3.9%，出口同比增长 6.9%。经济整体呈现出“外需好于内需、生产强于需求”的格局，国内有效需求依然不足，经济回升向好基础仍需巩固。

国内政策方面，3 月随着“两会”的召开，确立了“稳中求进，以进促稳”的政策基调，并强调了聚焦新质生产力的重要性。4 月新“国九条”颁布，新“国九条”以强监管、防风

险、促高质量发展为主线，有望优化市场环境，推动资本市场的健康发展。

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

上证综合 ETF 跟踪上证指数，上证指数是 A 股历史最悠久的股价指数，是宏观经济的晴雨表，经过 2020 年的修订，在新股延迟纳入、剔除风险警示股和纳入科创板证券三个方面进行了全新升级，具有更好的投资属性。本基金采用抽样复制方法，在严控跟踪误差的前提下，通过量化多因子和风险模型来追求稳健适度的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 2.58%。同期业绩比较基准收益率为-0.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,835,234.53	505,820.82
结算备付金		153,163.73	3,171,430.21
存出保证金		17,852.98	59,245.95
交易性金融资产	6.4.7.2	170,308,483.71	253,003,618.10
其中：股票投资		170,308,483.71	253,003,618.10
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		11,194.24	-
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		172,325,929.19	256,740,115.08
<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		-	288,969.80
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		60,883.01	124,430.09
应付托管费		12,176.57	24,886.04
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	125,648.69	71,195.13
负债合计		198,708.27	509,481.06
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	170,798,000.00	260,798,000.00
未分配利润	6.4.7.9	1,329,220.92	-4,567,365.98
净资产合计		172,127,220.92	256,230,634.02
负债和净资产总计		172,325,929.19	256,740,115.08

注：1、报告截止日2024年06月30日，基金份额净值1.0078元，基金份额总额170,798,000.00份。

2、本基金合同于2023年11月22日生效，上年度实际报告期间为2023年11月22日至2023

年12月31日，特此说明。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		<b>12,289,444.34</b>
1. 利息收入		6,739.65
其中：存款利息收入	6.4.7.10	6,739.65
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,360,527.61
其中：股票投资收益	6.4.7.11	6,268,398.95
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	-
股利收益	6.4.7.17	2,092,128.66
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	3,956,165.56
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	-33,988.48
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>615,783.01</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	442,318.92
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	88,463.73
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.21	85,000.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号</b>		<b>11,673,661.33</b>

填列)		
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>11,673,661.33</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>11,673,661.33</b>

注：本基金合同于 2023 年 11 月 22 日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	260,798,000.00	-4,567,365.98	256,230,634.02
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	260,798,000.00	-4,567,365.98	256,230,634.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-90,000,000.00	5,896,586.90	-84,103,413.10
（一）、综合收益总额	-	11,673,661.33	11,673,661.33
（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）	-90,000,000.00	-5,777,074.43	-95,777,074.43
其中：1. 基金申购款	273,000,000.00	-8,014,511.05	264,985,488.95
2. 基金赎回款	-363,000,000.00	2,237,436.62	-360,762,563.38
（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	170,798,000.00	1,329,220.92	172,127,220.92

注：本基金合同于 2023 年 11 月 22 日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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

汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]1732 号文《关于准予汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2023 年 11 月 22 日生效。首次设立基金募集规模为 464,798,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 70015647\_B10 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、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（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：上证综合指数收益率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

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

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### （2）金融负债分类

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

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效



套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，

且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

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

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法

与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配采用现金分红；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 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

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	1,835,234.53
等于：本金	1,835,081.77
加：应计利息	152.76
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,835,234.53

#### 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	170,269,278.28	-	170,308,483.71	39,205.43
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	170,269,278.28	-	170,308,483.71	39,205.43

#### 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

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 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	41,113.33
其中：交易所市场	41,113.33
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	24,863.02
应付信息披露费	59,672.34
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
其他	-
合计	125,648.69

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	260,798,000.00	260,798,000.00
本期申购	273,000,000.00	273,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-363,000,000.00	-363,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号	-	-

填列)		
本期末	170,798,000.00	170,798,000.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,741,621.27	-2,825,744.71	-4,567,365.98
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	-1,741,621.27	-2,825,744.71	-4,567,365.98
本期利润	7,717,495.77	3,956,165.56	11,673,661.33
本期基金份额交易产生的变动数	8,429,786.06	-14,206,860.49	-5,777,074.43
其中：基金申购款	6,164,535.78	-14,179,046.83	-8,014,511.05
基金赎回款	2,265,250.28	-27,813.66	2,237,436.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,405,660.56	-13,076,439.64	1,329,220.92

#### 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	3,179.94
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	2,953.61
其他	606.10
合计	6,739.65

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,914,711.22
股票投资收益——赎回差价收入	14,183,110.17
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	6,268,398.95

##### 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	95,195,853.68
减：卖出股票成本总额	102,907,166.74
减：交易费用	203,398.16
买卖股票差价收入	-7,914,711.22

#### 6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	360,762,563.38
减：现金支付赎回款总额	860,730.38
减：赎回股票成本总额	345,718,722.83
减：交易费用	-
赎回差价收入	14,183,110.17

#### 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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 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

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,092,128.66
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	2,092,128.66

### 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	3,956,165.56
——股票投资	3,956,165.56
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,956,165.56

### 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	-
替代损益	-33,988.48
其他	-
合计	-33,988.48

### 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	65.00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	400.00
上市费	-
或有管理费	-
其他	-
合计	85,000.36

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东

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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	194,742,689.65	100.00

## 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

## 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

## 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 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	143,311.26	100.00	41,113.33	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
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	442,318.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	21,263.72

应支付基金管理人的净管理费	421,055.20
---------------	------------

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

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

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	88,463.73

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

**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：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

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

注：本基金的基金管理人本报告期末运用自有资金投资本基金。

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

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	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,835,234.53	3,179.94

**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：本基金本报告期末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**

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。



### 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 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	1,835,234.53	-	-	-	-	-	1,835,234.53
结算备付金	153,163.73	-	-	-	-	-	153,163.73
存出保证金	17,852.98	-	-	-	-	-	17,852.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	170,308,483.71	170,308,483.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	11,194.24	11,194.24
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,006,251.24	-	-	-	-	170,319,677.95	172,325,929.19

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	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	60,883.01	60,883.01
应付托管费	-	-	-	-	-	12,176.57	12,176.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-

其他 负债	-	-	-	-	-	125,648.69	125,648.69
负债 总计	-	-	-	-	-	198,708.27	198,708.27
利率 敏感 度缺 口	2,006,251.24	-	-	-	-	170,120,969.68	172,127,220.92
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	505,820.82	-	-	-	-	-	505,820.82
结算 备付 金	3,171,430.21	-	-	-	-	-	3,171,430.21
存出 保证 金	59,245.95	-	-	-	-	-	59,245.95
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	253,003,618.10	253,003,618.10
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,736,496.98	-	-	-	-	253,003,618.10	256,740,115.08
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	-	-	-	-	-	288,969.80	288,969.80
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	124,430.09	124,430.09
应付托管费	-	-	-	-	-	24,886.04	24,886.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	71,195.13	71,195.13
负债总计	-	-	-	-	-	509,481.06	509,481.06
利率敏感度缺口	3,736,496.98	-	-	-	-	252,494,137.04	256,230,634.02

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	170,308,483.71	98.94	253,003,618.10	98.74

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	170,308,483.71	98.94	253,003,618.10	98.74

#### 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
	上证综合指数 上涨 5%	8,316,790.92	10,934,664.46
	上证综合指数 下跌 5%	-8,316,790.92	-10,934,664.46

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	170,308,483.71
第二层次	-
第三层次	-
合计	170,308,483.71

#### 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	170,308,483.71	98.83
	其中：股票	170,308,483.71	98.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,988,398.26	1.15
8	其他各项资产	29,047.22	0.02
9	合计	172,325,929.19	100.00

注：此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”章节的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	226,069.00	0.13
B	采矿业	17,734,159.50	10.30
C	制造业	70,752,260.33	41.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,870,436.00	6.32
E	建筑业	5,150,607.00	2.99
F	批发和零售业	2,354,725.68	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	10,190,040.80	5.92
H	住宿和餐饮业	75,834.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,964,029.01	5.21
J	金融业	38,640,568.00	22.45
K	房地产业	1,394,657.00	0.81
L	租赁和商务服务业	1,401,718.28	0.81
M	科学研究和技术服务业	650,767.32	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	1,034,069.79	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	235,431.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	633,775.00	0.37
S	综合	-	-
	合计	170,309,147.71	98.94

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

### 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	600519	贵州茅台	4,800	7,043,472.00	4.09
2	601857	中国石油	658,300	6,793,656.00	3.95
3	601288	农业银行	1,323,600	5,770,896.00	3.35
4	601988	中国银行	844,900	3,903,438.00	2.27
5	601088	中国神华	64,500	2,861,865.00	1.66
6	600900	长江电力	97,500	2,819,700.00	1.64
7	600036	招商银行	79,500	2,718,105.00	1.58
8	601628	中国人寿	79,100	2,456,055.00	1.43
9	600028	中国石化	371,000	2,344,720.00	1.36
10	601939	建设银行	283,800	2,100,120.00	1.22
11	601138	工业富联	75,100	2,057,740.00	1.20
12	601728	中国电信	313,700	1,929,255.00	1.12
13	601318	中国平安	41,000	1,695,760.00	0.99
14	601658	邮储银行	306,600	1,554,462.00	0.90
15	601899	紫金矿业	82,100	1,442,497.00	0.84
16	601166	兴业银行	81,600	1,437,792.00	0.84
17	603639	海利尔	108,587	1,321,503.79	0.77
18	601231	环旭电子	79,500	1,275,975.00	0.74
19	600512	腾达建	645,000	1,219,050.00	0.71

		设			
20	601328	交通银行	154,800	1,156,356.00	0.67
21	601816	京沪高铁	189,400	1,017,078.00	0.59
22	601225	陕西煤业	38,800	999,876.00	0.58
23	601998	中信银行	146,300	980,210.00	0.57
24	600809	山西汾酒	4,600	970,048.00	0.56
25	600309	万华化学	11,900	962,234.00	0.56
26	688219	会通股份	122,040	948,250.80	0.55
27	600276	恒瑞医药	24,500	942,270.00	0.55
28	600000	浦发银行	113,100	930,813.00	0.54
29	603676	卫信康	109,300	875,493.00	0.51
30	601668	中国建筑	162,500	862,875.00	0.50
31	600030	中信证券	46,800	853,164.00	0.50
32	603328	依顿电子	104,400	820,584.00	0.48
33	600406	国电南瑞	32,500	811,200.00	0.47
34	601985	中国核电	75,000	799,500.00	0.46
35	605066	天正电气	143,125	797,206.25	0.46
36	600025	华能水电	73,100	788,018.00	0.46
37	688093	世华科技	42,138	765,647.46	0.44
38	601919	中远海控	49,300	763,657.00	0.44
39	688589	力合微电子	30,176	760,736.96	0.44
40	603288	海天味业	21,900	754,893.00	0.44
41	603757	大元泵	37,800	721,980.00	0.42

		业			
42	603160	汇顶科技	10,400	715,000.00	0.42
43	601766	中国中车	93,900	705,189.00	0.41
44	601601	中国太保	25,300	704,858.00	0.41
45	601319	中国人保	136,100	700,915.00	0.41
46	600150	中国船舶	17,000	692,070.00	0.40
47	600690	海尔智家	24,000	681,120.00	0.40
48	600887	伊利股份	26,100	674,424.00	0.39
49	688041	海光信息	9,307	654,468.24	0.38
50	600104	上汽集团	46,700	647,262.00	0.38
51	601375	中原证券	183,100	624,371.00	0.36
52	603228	景旺电子	19,400	616,920.00	0.36
53	601633	长城汽车	24,300	614,790.00	0.36
54	603456	九洲药业	44,200	606,424.00	0.35
55	600563	法拉电子	7,900	601,822.00	0.35
56	600019	宝钢股份	90,300	600,495.00	0.35
57	603993	洛阳钼业	70,473	599,020.50	0.35
58	600050	中国联通	125,000	587,500.00	0.34
59	600866	星湖科技	105,800	584,016.00	0.34
60	600919	江苏银行	77,500	575,825.00	0.33
61	601818	光大银行	180,400	571,868.00	0.33
62	601127	赛力斯	6,200	564,944.00	0.33
63	603920	世运电	28,200	556,668.00	0.32

		路			
64	688571	杭华油墨股份	102,267	540,992.43	0.31
65	600886	国投电力	29,600	539,904.00	0.31
66	600018	上港集团	92,800	536,384.00	0.31
67	600031	三一重工	32,500	536,250.00	0.31
68	600016	民生银行	140,500	532,495.00	0.31
69	600300	维维股份	220,400	528,960.00	0.31
70	601390	中国中铁	80,000	521,600.00	0.30
71	603758	秦安股份	65,700	499,320.00	0.29
72	603730	岱美股份	49,610	493,123.40	0.29
73	601006	大秦铁路	68,400	489,744.00	0.28
74	601888	中国中免	7,800	487,422.00	0.28
75	600905	三峡能源	111,700	487,012.00	0.28
76	601169	北京银行	82,900	484,136.00	0.28
77	600989	宝丰能源	27,500	476,575.00	0.28
78	603589	口子窖	12,100	474,199.00	0.28
79	601066	中信建投	24,500	471,380.00	0.27
80	603501	韦尔股份	4,600	457,102.00	0.27
81	600436	片仔癀	2,200	455,774.00	0.26
82	601009	南京银行	43,700	454,043.00	0.26
83	603128	华贸物流	77,000	444,290.00	0.26
84	600776	东方通信	44,200	434,486.00	0.25
85	601898	中煤能源	34,700	433,056.00	0.25

86	688111	金山办公	1,900	432,250.00	0.25
87	601989	中国重工	87,400	430,882.00	0.25
88	600481	双良节能	91,600	427,772.00	0.25
89	600015	华夏银行	66,800	427,520.00	0.25
90	600760	中航沈飞	10,600	425,060.00	0.25
91	688223	晶科能源	59,668	423,642.80	0.25
92	600011	华能国际	43,600	419,432.00	0.24
93	600795	国电电力	69,100	413,909.00	0.24
94	601800	中国交建	45,800	409,452.00	0.24
95	601229	上海银行	56,000	406,560.00	0.24
96	601012	隆基绿能	28,800	403,776.00	0.23
97	600999	招商证券	28,900	401,999.00	0.23
98	600029	南方航空	67,600	398,164.00	0.23
99	600188	兖矿能源	17,500	397,775.00	0.23
100	601211	国泰君安	29,300	397,015.00	0.23
101	688012	中微半导体设备	2,800	395,528.00	0.23
102	600048	保利发展	45,000	394,200.00	0.23
103	600346	恒力石化	27,800	387,810.00	0.23
104	600941	中国移动	3,600	387,000.00	0.22
105	603259	药明康德	9,800	384,062.00	0.22
106	600547	山东黄金	14,000	383,320.00	0.22
107	600660	福耀玻	8,000	383,200.00	0.22

		璃			
108	601600	中国铝业	49,900	380,737.00	0.22
109	603195	公牛集团	4,925	379,816.00	0.22
110	600585	海螺水泥	16,100	379,799.00	0.22
111	601186	中国铁建	44,100	377,937.00	0.22
112	600893	航发动力	10,200	372,810.00	0.22
113	600282	南钢股份	74,800	372,504.00	0.22
114	601669	中国电建	66,600	372,294.00	0.22
115	603885	吉祥航空	33,400	367,066.00	0.21
116	600642	申能股份	41,000	362,030.00	0.21
117	600601	方正科技	120,030	360,090.00	0.21
118	688271	联影医疗	3,254	356,963.80	0.21
119	600845	宝信软件	11,140	355,700.20	0.21
120	601168	西部矿业	19,800	355,410.00	0.21
121	600787	中储股份	73,800	354,978.00	0.21
122	601688	华泰证券	28,600	354,354.00	0.21
123	600489	中金黄金	23,600	349,280.00	0.20
124	600219	南山铝业	91,500	348,615.00	0.20
125	600483	福能股份	29,800	347,468.00	0.20
126	688036	传音控股	4,490	343,664.60	0.20
127	600438	通威股份	17,900	342,069.00	0.20
128	600761	安徽合力	15,800	341,912.00	0.20



129	601111	中国国航	46,300	341,694.00	0.20
130	600575	淮河能源	87,600	340,764.00	0.20
131	603323	苏农银行	70,500	339,105.00	0.20
132	600726	华电能源	170,300	338,897.00	0.20
133	603444	吉比特	1,900	338,219.00	0.20
134	600875	东方电气	18,200	335,790.00	0.20
135	603408	建霖家居	25,400	335,026.00	0.19
136	601995	中金公司	11,300	334,593.00	0.19
137	688127	蓝特光学	17,944	329,990.16	0.19
138	601058	赛轮轮胎	23,400	327,600.00	0.19
139	600926	杭州银行	25,100	327,555.00	0.19
140	600863	内蒙华电	70,400	326,656.00	0.19
141	600183	生益科技	15,300	322,218.00	0.19
142	603927	中科软	17,580	318,022.20	0.18
143	600323	瀚蓝环境	15,100	315,590.00	0.18
144	600009	上海机场	9,700	312,825.00	0.18
145	600897	厦门空港	24,600	310,206.00	0.18
146	600368	五洲交通	86,660	309,376.20	0.18
147	688029	南微医学科技	5,008	308,292.48	0.18
148	603855	华荣股份	13,900	307,329.00	0.18
149	601298	青岛港	32,100	306,876.00	0.18
150	600098	广州发展	47,800	305,920.00	0.18
151	600674	川投能源	16,300	305,625.00	0.18

152	603871	嘉友国际	17,240	304,975.60	0.18
153	601916	浙商银行	109,700	302,772.00	0.18
154	601018	宁波港	88,700	301,580.00	0.18
155	601827	三峰环境	35,500	301,395.00	0.18
156	603019	中科曙光	7,200	298,800.00	0.17
157	600499	科达制造	35,300	297,579.00	0.17
158	601077	渝农商行	59,100	296,682.00	0.17
159	600362	江西铜业	12,200	288,896.00	0.17
160	600997	开滦股份	42,000	288,120.00	0.17
161	600269	赣粤高速	55,200	285,384.00	0.17
162	600233	圆通速递	18,000	281,700.00	0.16
163	600115	中国东航	70,100	281,101.00	0.16
164	601860	紫金银行	112,300	280,750.00	0.16
165	600023	浙能电力	39,300	279,423.00	0.16
166	600039	四川路桥	35,300	278,517.00	0.16
167	600177	雅戈尔	38,900	276,968.00	0.16
168	600699	均胜电子	18,600	275,652.00	0.16
169	601222	林洋能源	43,800	274,626.00	0.16
170	603383	顶点软件	8,540	273,877.80	0.16
171	601117	中国化学	32,700	269,448.00	0.16
172	600820	隧道股份	41,100	268,383.00	0.16
173	601717	郑煤机	18,100	267,880.00	0.16
174	601607	上海医药	14,000	267,540.00	0.16

175	603650	彤程新材	9,000	265,950.00	0.15
176	600153	建发股份	29,700	265,221.00	0.15
177	600035	楚天高速	61,500	263,835.00	0.15
178	600908	无锡银行	49,500	263,340.00	0.15
179	600522	中天科技	16,600	263,110.00	0.15
180	600803	新奥股份	12,600	262,080.00	0.15
181	601886	江河集团	53,600	261,568.00	0.15
182	600089	特变电工	18,800	260,756.00	0.15
183	600901	江苏金租	51,600	260,580.00	0.15
184	601577	长沙银行	31,800	260,124.00	0.15
185	600033	福建高速	77,500	259,625.00	0.15
186	600332	白云山	8,800	258,104.00	0.15
187	600064	南京高科	42,200	256,154.00	0.15
188	688019	安集科技	2,030	255,374.00	0.15
189	600021	上海电力	25,600	253,184.00	0.15
190	603236	移远通信	5,400	252,342.00	0.15
191	603948	建业股份	15,400	250,712.00	0.15
192	600377	宁沪高速	19,800	249,480.00	0.14
193	688400	凌云光技术	14,922	248,898.96	0.14
194	600548	深高速	23,400	248,742.00	0.14
195	600497	驰宏锌锗	46,500	248,310.00	0.14
196	600020	中原高速	69,800	247,092.00	0.14
197	601369	陕鼓动	30,700	246,214.00	0.14

		力			
198	603171	税友股份	9,100	246,064.00	0.14
199	600741	华域汽车	15,000	245,700.00	0.14
200	688368	晶丰明源半导体	4,425	245,145.00	0.14
201	600549	厦门钨业	14,100	243,225.00	0.14
202	600251	冠农股份	33,400	241,816.00	0.14
203	600528	中铁工业	33,000	241,560.00	0.14
204	601366	利群股份	53,400	240,300.00	0.14
205	600717	天津港	56,200	239,974.00	0.14
206	603367	辰欣药业	17,200	239,768.00	0.14
207	600704	物产中大	55,200	239,568.00	0.14
208	600885	宏发股份	8,600	238,048.00	0.14
209	600584	长电科技	7,500	237,825.00	0.14
210	600469	风神股份	40,300	235,352.00	0.14
211	601868	中国能建	109,200	231,504.00	0.13
212	601866	中远海发	89,700	231,426.00	0.13
213	603809	豪能股份	28,572	230,861.76	0.13
214	600057	厦门象屿	33,900	230,520.00	0.13
215	600420	国药现代	21,400	228,552.00	0.13
216	601139	深圳燃气	34,200	228,456.00	0.13
217	600598	北大荒	18,100	226,069.00	0.13
218	600755	厦门国贸	31,484	225,740.28	0.13
219	600600	青岛啤酒	3,100	225,587.00	0.13

		酒			
220	688599	天合光能	13,309	225,188.28	0.13
221	600132	重庆啤酒	3,700	224,590.00	0.13
222	603225	新风鸣	14,400	224,496.00	0.13
223	605090	九丰能源	7,600	220,400.00	0.13
224	601512	中新集团	28,900	220,218.00	0.13
225	601788	光大证券	15,000	219,300.00	0.13
226	603301	振德医疗	10,500	219,030.00	0.13
227	601311	骆驼股份	27,300	218,946.00	0.13
228	600909	华安证券	51,700	217,657.00	0.13
229	601238	广汽集团	28,100	217,494.00	0.13
230	600570	恒生电子	12,300	217,218.00	0.13
231	601811	新华文轩	15,500	217,155.00	0.13
232	600380	健康元	19,400	216,698.00	0.13
233	600017	日照港	81,000	216,270.00	0.13
234	603899	晨光股份	6,900	215,832.00	0.13
235	600928	西安银行	66,000	215,820.00	0.13
236	688018	乐鑫科技	2,160	213,148.80	0.12
237	601966	玲珑轮胎	11,600	213,092.00	0.12
238	600529	山东药玻	8,400	212,856.00	0.12
239	600352	浙江龙盛	24,700	212,173.00	0.12
240	600918	中泰证券	37,200	210,924.00	0.12
241	600623	华谊集团	36,400	210,392.00	0.12
242	603368	柳药集	12,000	210,000.00	0.12

		团			
243	603321	梅轮电 梯	30,700	209,681.00	0.12
244	600757	长江传 媒	26,000	209,560.00	0.12
245	603187	海容冷 链	17,800	207,548.00	0.12
246	688268	广东华 特气体	4,000	206,440.00	0.12
247	601108	财通证 券	30,900	204,249.00	0.12
248	600330	天通股 份	30,020	204,136.00	0.12
249	600061	国投资 本	36,100	203,965.00	0.12
250	601689	拓普集 团	3,800	203,718.00	0.12
251	600426	华鲁恒 升	7,600	202,464.00	0.12
252	688078	龙软科 技	8,736	201,190.08	0.12
253	600835	上海机 电	17,400	200,274.00	0.12
254	603898	好莱客	27,200	199,920.00	0.12
255	601158	重庆水 务	41,300	198,240.00	0.12
256	688128	中国电 器研究 院	11,508	198,052.68	0.12
257	601882	海天精 工	8,600	197,026.00	0.11
258	600308	华泰股 份	62,500	196,250.00	0.11
259	601997	贵阳银 行	37,100	195,517.00	0.11
260	600363	联创光 电	7,100	195,392.00	0.11
261	605499	东鹏饮 料	900	194,175.00	0.11
262	601016	节能风 电	64,900	194,051.00	0.11
263	688006	浙江杭 可科技	11,120	194,044.00	0.11

264	600998	九州通	39,686	193,667.68	0.11
265	601677	明泰铝业	16,700	193,052.00	0.11
266	601877	正泰电器	10,100	192,506.00	0.11
267	600745	闻泰科技	6,800	192,100.00	0.11
268	600109	国金证券	25,400	191,770.00	0.11
269	603053	成都燃气	19,800	191,268.00	0.11
270	601360	三六零	24,900	191,232.00	0.11
271	605358	立昂微	8,200	189,748.00	0.11
272	603010	万盛股份	21,000	189,210.00	0.11
273	601963	重庆银行	24,300	188,325.00	0.11
274	688366	昊海生物科技	3,038	187,383.84	0.11
275	603816	顾家家居	5,800	187,282.00	0.11
276	688601	力芯微股份	4,270	186,556.30	0.11
277	600763	通策医疗	3,400	183,770.00	0.11
278	600643	爱建集团	48,700	183,599.00	0.11
279	601336	新华保险	6,100	183,183.00	0.11
280	600711	盛屯矿业	49,900	183,133.00	0.11
281	601555	东吴证券	31,000	182,900.00	0.11
282	603309	维力医疗	16,600	182,766.00	0.11
283	603290	斯达半导	2,120	182,553.20	0.11
284	601101	昊华能源	19,800	181,962.00	0.11
285	600372	中航机载	15,200	181,944.00	0.11
286	600582	天地科技	26,400	181,896.00	0.11

287	601377	兴业证券	35,500	179,630.00	0.10
288	688276	长春百克生物科技	6,329	179,553.73	0.10
289	600597	光明乳业	23,100	179,487.00	0.10
290	600298	安琪酵母	6,400	178,752.00	0.10
291	603797	联泰环保	57,000	177,840.00	0.10
292	600740	山西焦化	45,000	176,400.00	0.10
293	600196	复星医药	7,900	174,906.00	0.10
294	600859	王府井	14,800	173,752.00	0.10
295	600655	豫园股份	33,500	172,525.00	0.10
296	603986	兆易创新	1,800	172,116.00	0.10
297	688016	心脉医疗	1,745	171,097.25	0.10
298	600790	轻纺城	52,900	170,338.00	0.10
299	600739	辽宁成大	20,300	169,911.00	0.10
300	600230	沧州大化	16,700	169,171.00	0.10
301	601615	明阳智能	17,900	168,976.00	0.10
302	601865	福莱特	8,400	168,840.00	0.10
303	601137	博威合金	11,000	167,640.00	0.10
304	603506	南都物业	19,900	166,762.00	0.10
305	688028	沃尔德金刚石	10,100	165,943.00	0.10
306	603989	艾华集团	11,700	164,502.00	0.10
307	603599	广信股份	13,500	163,755.00	0.10
308	603345	安井食品	2,200	163,482.00	0.09
309	601107	四川成	31,100	163,275.00	0.09



		渝			
310	603681	永冠新材	12,800	163,200.00	0.09
311	600612	老凤祥	2,800	162,932.00	0.09
312	600987	航民股份	23,000	162,380.00	0.09
313	603339	四方科技	17,900	162,353.00	0.09
314	600197	伊力特	9,100	162,071.00	0.09
315	600641	万业企业	13,700	160,975.00	0.09
316	600261	阳光照明	59,100	159,570.00	0.09
317	600713	南京医药	37,700	159,094.00	0.09
318	600208	新湖中宝	100,600	158,948.00	0.09
319	688621	阳光诺和	3,700	157,990.00	0.09
320	603025	大豪科技	11,400	157,548.00	0.09
321	688258	江苏卓易信息科技	4,692	156,712.80	0.09
322	601991	大唐发电	51,900	156,219.00	0.09
323	600456	宝钛股份	6,100	155,733.00	0.09
324	603893	瑞芯微	2,600	153,842.00	0.09
325	600681	百川能源	45,100	151,987.00	0.09
326	600837	海通证券	17,700	151,512.00	0.09
327	688625	呈和科技	4,151	150,930.36	0.09
328	600780	通宝能源	25,500	150,450.00	0.09
329	603198	迎驾贡酒	2,600	149,500.00	0.09
330	603678	火炬电子	6,000	148,140.00	0.09
331	600633	浙数文化	16,700	147,127.00	0.09

332	603043	广州酒家	9,200	146,924.00	0.09
333	600862	中航高科	7,800	146,484.00	0.09
334	688439	振华风光	2,198	146,057.10	0.08
335	603387	基蛋生物	18,800	145,888.00	0.08
336	603886	元祖股份	9,675	145,705.50	0.08
337	600486	扬农化工	2,574	145,302.30	0.08
338	688596	正帆科技	4,400	145,200.00	0.08
339	600195	中牧股份	19,300	144,557.00	0.08
340	603638	艾迪精密	10,300	144,509.00	0.08
341	600141	兴发集团	7,500	143,100.00	0.08
342	600588	用友网络	14,300	143,000.00	0.08
343	601933	永辉超市	57,200	141,856.00	0.08
344	603233	大参林	9,900	141,570.00	0.08
345	603416	信捷电气	4,900	140,042.00	0.08
346	600586	金晶科技	24,100	139,780.00	0.08
347	600143	金发科技	21,100	139,471.00	0.08
348	603365	水星家纺	8,900	139,285.00	0.08
349	603297	永新光学	2,300	139,127.00	0.08
350	688619	罗普特科技	19,790	139,123.70	0.08
351	603113	金能科技	25,400	138,938.00	0.08
352	603987	康德莱	22,200	135,642.00	0.08
353	688370	从麟环保科技	8,470	135,181.20	0.08
354	603063	禾望电	8,800	134,904.00	0.08

		气			
355	603700	宁水集团	14,300	134,134.00	0.08
356	603517	绝味食品	8,600	132,440.00	0.08
357	688205	德科立光电子	4,583	132,036.23	0.08
358	601900	南方传媒	10,600	131,758.00	0.08
359	688303	大全能源	6,400	130,496.00	0.08
360	688686	奥普特科技	2,000	128,060.00	0.07
361	600779	水井坊	3,400	127,942.00	0.07
362	601636	旗滨集团	19,800	127,710.00	0.07
363	601990	南京证券	16,400	125,952.00	0.07
364	603515	欧普照明	7,200	124,848.00	0.07
365	600508	上海能源	8,800	124,520.00	0.07
366	600590	泰豪科技	32,200	122,682.00	0.07
367	688099	晶晨半导体	2,065	122,495.80	0.07
368	603039	泛微网络	3,800	120,688.00	0.07
369	601956	东贝集团	26,000	119,080.00	0.07
370	600012	皖通高速	8,500	118,745.00	0.07
371	688007	光峰科技	7,300	117,530.00	0.07
372	603185	弘元绿能	6,800	116,212.00	0.07
373	603596	伯特利	2,980	115,922.00	0.07
374	600271	航天信息	15,600	114,816.00	0.07
375	688001	苏州华兴源创科技	5,078	114,661.24	0.07
376	603238	诺邦股	11,500	114,540.00	0.07

		份			
377	603035	常熟汽饰	8,900	112,852.00	0.07
378	600976	健民集团	2,200	111,100.00	0.06
379	603605	珀莱雅	1,000	110,990.00	0.06
380	605033	美邦股份	8,700	108,054.00	0.06
381	688628	优利德科技	3,297	108,042.69	0.06
382	600827	百联股份	14,500	107,010.00	0.06
383	601518	吉林高速	42,700	104,188.00	0.06
384	600461	洪城环境	8,800	101,904.00	0.06
385	688766	普冉半导体	1,044	101,445.48	0.06
386	601908	京运通	39,900	100,947.00	0.06
387	600223	福瑞达	13,900	98,273.00	0.06
388	688536	思瑞浦股份	1,000	97,810.00	0.06
389	603519	立霸股份	8,400	95,004.00	0.06
390	601198	东兴证券	11,900	94,724.00	0.06
391	601368	绿城水务	23,400	94,536.00	0.05
392	600705	中航产融	42,500	94,350.00	0.05
393	601881	中国银河	8,600	93,396.00	0.05
394	600211	西藏药业	2,850	92,853.00	0.05
395	603369	今世缘	2,000	92,400.00	0.05
396	603208	江山欧派	4,800	91,872.00	0.05
397	603833	欧派家居	1,700	91,052.00	0.05
398	688002	睿创微纳	3,241	90,650.77	0.05
399	688386	泛亚微透	3,227	90,549.62	0.05

400	603680	今创集团	13,700	90,420.00	0.05
401	600100	同方股份	17,200	87,548.00	0.05
402	600742	一汽富维	11,600	86,420.00	0.05
403	600168	武汉控股	21,700	85,064.00	0.05
404	688318	财富趋势	1,069	84,354.79	0.05
405	688106	金宏气体	4,533	79,418.16	0.05
406	605123	派克新材	1,400	78,652.00	0.05
407	600754	锦江酒店	3,300	75,834.00	0.04
408	688678	福立旺精密	6,935	75,106.05	0.04
409	600611	大众交通	26,800	74,772.00	0.04
410	688256	寒武纪科技	365	72,514.55	0.04
411	603385	惠达卫浴	13,100	71,919.00	0.04
412	600536	中国软件	2,300	68,816.00	0.04
413	688107	安路科技	2,657	67,540.94	0.04
414	601878	浙商证券	6,100	65,392.00	0.04
415	600229	城市传媒	9,400	64,766.00	0.04
416	688200	华峰测控	700	64,225.00	0.04
417	600120	浙江东方	18,000	60,120.00	0.03
418	688489	三未信安	2,211	58,901.04	0.03
419	688101	三达膜环境技术	5,100	58,038.00	0.03
420	600718	东软集团	7,000	57,890.00	0.03
421	600170	上海建	26,900	57,835.00	0.03

		工			
422	688777	中控技术	1,486	56,022.20	0.03
423	688480	赛恩斯环保	2,000	55,720.00	0.03
424	688202	美迪西生物医药	2,100	54,705.00	0.03
425	688315	诺禾致源科技	4,946	54,010.32	0.03
426	603882	金域医学	1,900	51,661.00	0.03
427	603227	雪峰科技	7,800	48,360.00	0.03
428	688178	万德斯环保	4,689	48,343.59	0.03
429	603239	浙江仙通	3,400	46,614.00	0.03
430	601619	嘉泽新能	14,700	44,541.00	0.03
431	600206	有研新材	4,800	42,720.00	0.02
432	603578	三星新材	3,400	41,140.00	0.02
433	688526	武汉科前生物	2,604	38,252.76	0.02
434	688273	麦澜德医疗	1,926	38,134.80	0.02
435	600173	卧龙地产	10,000	37,400.00	0.02
436	603180	金牌家居	1,900	36,309.00	0.02
437	603889	新澳股份	4,600	35,604.00	0.02
438	600487	亨通光电	2,200	34,694.00	0.02
439	603659	璞泰来	2,300	32,499.00	0.02
440	603165	荣晟环保	3,000	31,860.00	0.02
441	601059	信达证券	2,200	31,262.00	0.02
442	688365	光云科技	4,646	27,968.92	0.02

443	688112	鼎阳科技	1,022	27,583.78	0.02
444	600729	重庆百货	1,200	26,832.00	0.02
445	600123	兰花科创	2,780	24,881.00	0.01
446	688369	致远互联	1,581	24,869.13	0.01
447	603056	德邦股份	1,800	23,580.00	0.01
448	688561	奇安信集团	934	22,061.08	0.01
449	601828	美凯龙	8,500	21,675.00	0.01
450	600732	爱旭股份	2,300	20,815.00	0.01
451	605287	德才股份	1,600	20,144.00	0.01
452	601686	友发集团	3,600	18,108.00	0.01
453	688138	清溢光电	841	18,081.50	0.01
454	600390	五矿资本	4,200	17,010.00	0.01
455	605333	沪光股份	600	16,710.00	0.01
456	605009	豪悦护理	400	15,776.00	0.01
457	688055	昆山龙腾光电	4,538	14,385.46	0.01
458	688283	坤恒顺维	413	14,198.94	0.01
459	603260	合盛硅业	300	14,013.00	0.01
460	603156	养元饮品	600	12,762.00	0.01
461	688403	汇成股份	1,355	11,490.40	0.01
462	603737	三棵树	300	10,881.00	0.01
463	601699	潞安环能	600	10,878.00	0.01
464	600576	祥源文旅	2,400	10,536.00	0.01
465	603590	康辰药	300	7,662.00	0.00

		业			
466	603100	川仪股份	300	7,053.00	0.00
467	603105	芯能科技	400	3,520.00	0.00
468	600737	中粮糖业	300	2,877.00	0.00
469	600125	铁龙物流	200	1,194.00	0.00
470	600167	联美控股	200	1,042.00	0.00
471	600662	外服控股	200	802.00	0.00
472	600267	海正药业	100	702.00	0.00

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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	600519	贵州茅台	4,366,823.00	1.70
2	603758	秦安股份	3,724,492.00	1.45
3	603639	海利尔	2,900,599.04	1.13
4	600512	腾达建设	2,655,135.00	1.04
5	603303	得邦照明	2,450,611.00	0.96
6	688093	世华科技	1,858,232.48	0.73
7	688219	会通股份	1,849,191.39	0.72
8	688571	杭华油墨股份	1,653,891.16	0.65
9	600481	双良节能	1,617,404.00	0.63
10	603676	卫信康	1,606,337.00	0.63
11	601939	建设银行	1,584,898.00	0.62
12	605066	天正电气	1,584,648.25	0.62
13	603757	大元泵业	1,485,345.00	0.58
14	688589	力合微电子	1,366,055.42	0.53
15	603328	依顿电子	1,239,155.00	0.48



16	600436	片仔癀	1,232,964.00	0.48
17	601288	农业银行	1,043,750.00	0.41
18	601857	中国石油	1,012,983.00	0.40
19	600866	星湖科技	969,309.00	0.38
20	688036	传音控股	838,243.15	0.33

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	600519	贵州茅台	2,450,127.00	0.96
2	601288	农业银行	1,463,554.00	0.57
3	601988	中国银行	1,368,195.00	0.53
4	603758	秦安股份	1,296,629.00	0.51
5	603303	得邦照明	1,254,477.00	0.49
6	600436	片仔癀	951,117.00	0.37
7	688036	传音控股	912,836.50	0.36
8	688271	联影医疗	826,071.47	0.32
9	688111	金山办公	796,915.87	0.31
10	603661	恒林股份	746,613.00	0.29
11	688981	中芯国际	723,925.59	0.28
12	600182	S佳通	665,808.00	0.26
13	600893	航发动力	654,324.00	0.26
14	688012	中微半导体设备	642,019.75	0.25
15	601995	中金公司	641,386.00	0.25
16	601127	赛力斯	639,936.00	0.25
17	600030	中信证券	593,863.00	0.23
18	600547	山东黄金	578,546.00	0.23
19	600373	中文传媒	564,261.00	0.22
20	603556	海兴电力	559,949.00	0.22

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	99,546,835.97
卖出股票收入（成交）总额	95,195,853.68

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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，中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国建设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	17,852.98
2	应收清算款	11,194.24
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	29,047.22

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
8,513	20,063.20	14,872,699.00	8.71	155,925,301.00	91.29

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中信证券股份有限公司	5,026,300.00	2.94
2	童玲华	4,513,200.00	2.64
3	国信证券股份有限公司	4,489,699.00	2.63
4	徐国云	3,040,200.00	1.78
5	王淑琴	3,000,000.00	1.76
6	毕玉华	3,000,000.00	1.76
7	麦华莉	2,288,800.00	1.34

8	李兵	2,010,000.00	1.18
9	刘华	2,000,000.00	1.17
10	李桂芹	1,977,700.00	1.16

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023年11月22日） 基金份额总额	464,798,000.00
本报告期期初基金份额总额	260,798,000.00
本报告期基金总申购份额	273,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	363,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	170,798,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	4	194,742,689.65	100.00	143,311.26	100.00	
财信证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
东吴证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	
高盛中国	1	-	-	-	-	
光大证券	1	-	-	-	-	

广发证券	1	-	-	-	-	
国都证券	1	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国泰君安	2	-	-	-	-	
国投证券	2	-	-	-	-	
国新证券	2	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
华鑫证券	3	-	-	-	-	
上海证券	1	-	-	-	-	
申万宏源证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	2	-	-	-	-	
银河证券	3	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
中金财富	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	

中银国际	1	-	-	-	-	
------	---	---	---	---	---	--

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

### 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 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/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：

本基金本报告期内退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：中泰证券（上交所单元）。

## 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关于旗下部分基金增加华金证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 08 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源证券和申万宏源西部证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 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 15 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关于旗下部分基金增加华福证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024年04月24日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加渤海证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 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20日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华源证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024年05月20日
11	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
12	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	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
13	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上证综合交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

## 12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2024 年 08 月 30 日