

汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	64
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	64

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	64
§ 8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	66
§ 9 开放式基金份额变动.....	66
§ 10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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.....	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
§ 12 备查文件目录.....	74
12.1 备查文件目录.....	74
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富中证 1000 指数增强	
基金主代码	017953	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 05 月 19 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	295,511,923.39	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 1000 指数增强 A	汇添富中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017953	017954
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	207,075,955.42	88,435,967.97

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.00%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证的投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转债及可交换债投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略和国债期货投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 1000 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	<p>本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>
--------	--

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	中国建设银行股份有限公司
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	021-60637228
传真	021-28932998	021-60635778
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200010	100033
法定代表人	李文	张金良

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指	报告期(2024 年 01 月 01 日 - 2024 年 06 月 30 日)
--------------	--

标	汇添富中证 1000 指数增强 A	汇添富中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-80,556,535.91	-47,318,568.20
本期利润	-61,243,382.35	-78,569,967.95
加权平均基金份额本期利润	-0.2032	-0.4686
本期加权平均净值利润率	-22.80%	-52.38%
本期基金份额净值增长率	-16.06%	-16.18%
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	-35,740,931.85	-15,472,859.85
期末可供分配基金份额利润	-0.1726	-0.1750
期末基金资产净值	175,109,455.21	74,563,886.50
期末基金份额净值	0.8456	0.8431
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	-15.44%	-15.69%

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

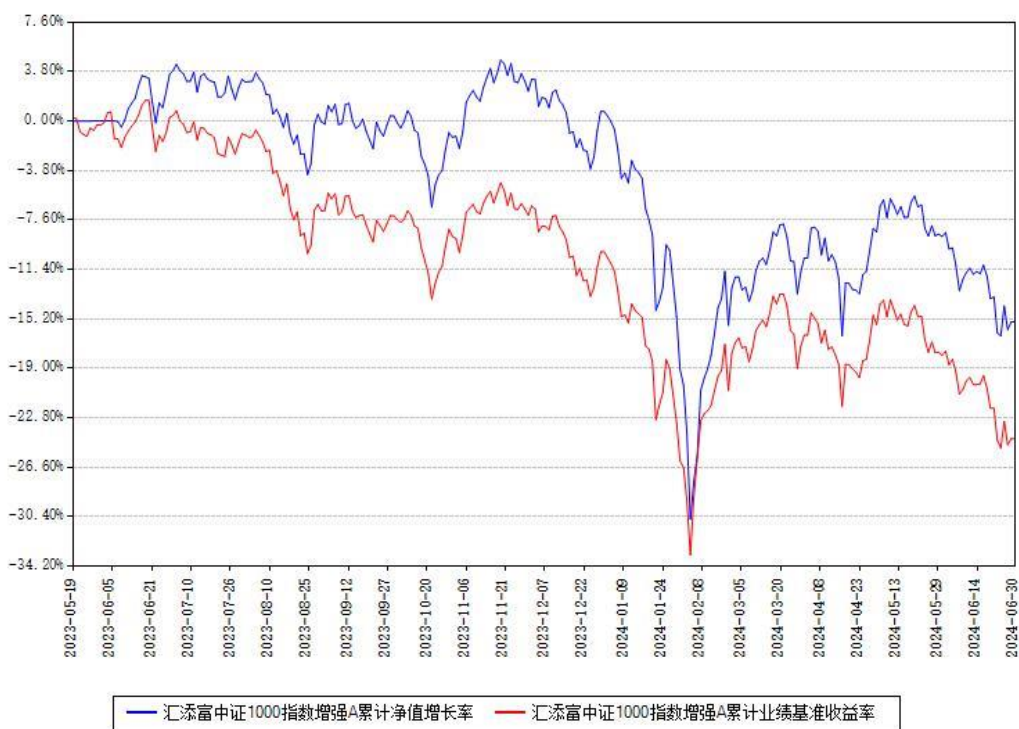
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 1000 指数增强 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	-7.52%	1.38%	-8.15%	1.36%	0.63%	0.02%
过去三	-5.49%	1.52%	-9.51%	1.42%	4.02%	0.10%

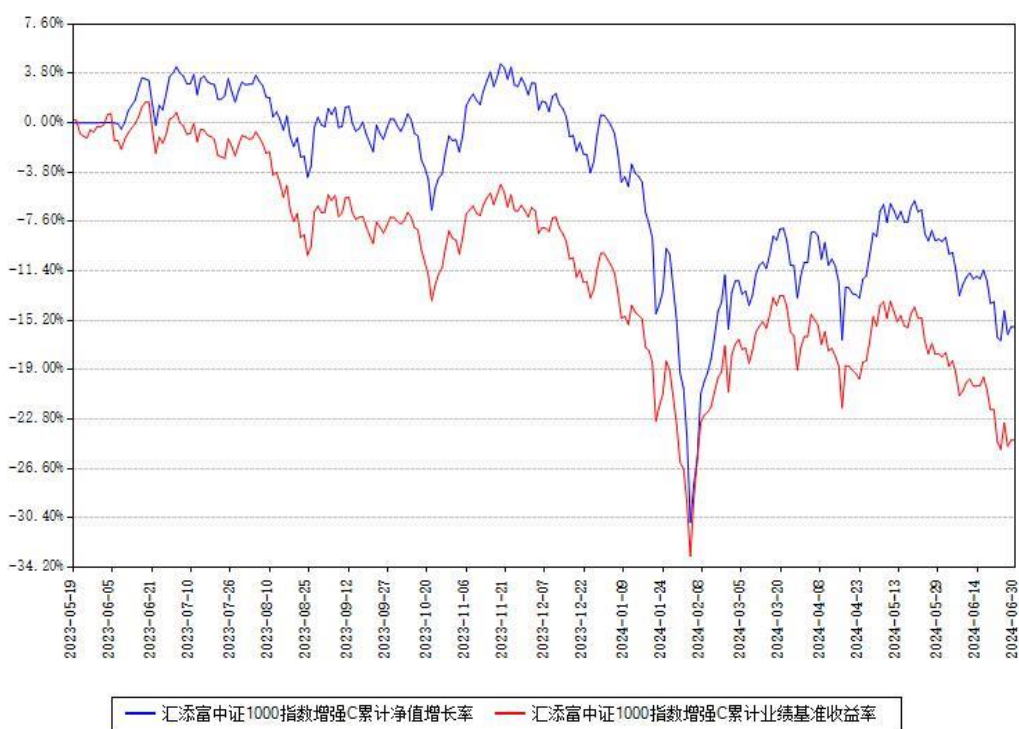
个月						
过去六个月	-16.06%	2.08%	-15.97%	1.87%	-0.09%	0.21%
过去一年	-18.38%	1.60%	-24.61%	1.47%	6.23%	0.13%
自基金合同生效日起至今	-15.44%	1.53%	-24.40%	1.42%	8.96%	0.11%
汇添富中证 1000 指数增强 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.54%	1.38%	-8.15%	1.36%	0.61%	0.02%
过去三个月	-5.56%	1.52%	-9.51%	1.42%	3.95%	0.10%
过去六个月	-16.18%	2.08%	-15.97%	1.87%	-0.21%	0.21%
过去一年	-18.59%	1.60%	-24.61%	1.47%	6.02%	0.13%
自基金合同生效日起至今	-15.69%	1.53%	-24.40%	1.42%	8.71%	0.11%

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1000指数增强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1000指数增强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（2023年05月19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		
许一尊	本基金的基金经理	2023 年 05 月 19 日	-	14	国籍：中国。 学历：上海财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经

					<p>历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 2 日至今任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至今任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 800 指数增强型证</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 7 月 19 日至今任汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 11 月 14 日至今任汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳元回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2024 年 3 月 28 日至今任汇添富稳兴回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
王星星	本基金的基金经理	2023 年 06 月 29 日	-	9	<p>国籍：中国。</p> <p>学历：中国人民大学金融工程硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2015 年 8 月至 2023 年 2 月任东方证券股份有限公司</p>

					<p>证券研究所研究员、高级研究员、高级分析师、业务总监（研究）。</p> <p>2023 年 2 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。</p> <p>2023 年 6 月 29 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p> <p>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。</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

报告期内，中证 1000 指数出现较大幅度震荡，受市场风格和 Alpha 波动影响，本基金相对基准的超额收益在报告期初出现了较大幅度的回撤，后期随着市场平稳，超额收益有所修复，整个报告期产品收益和基准基本持平。

本基金采用量化指数增强的方式运作，在控制组合相对基准跟踪误差的基础上，力争实

现超越业绩比较基准的投资回报。具体操作上，我们采用多因子模型和 AI 量化选股相结合的方式评价个股，在严控组合和基准之间风格和行业偏离的条件下，超配评价较高的个股、低配评价较低的个股以实现超额收益。报告期内组合持仓相对分散，以降低组合对个股的依赖，提升组合超额稳定性，同时对风险事件实时监控，及时剔除风险个股，降低组合尾部风险。

投资管理过程中我们尽量避免对组合持仓的直接干预，将投资观点和思想转化为规则化的量化投资策略，审慎地调整量化策略去间接调整组合持仓，以保证投资管理的可复制性，同时避免情绪波动对组合投资的负面影响。在后续的投资研究过程中，我们将进一步加强量化策略的多样性，均衡配置各类策略，力争为持有人带来更好的持有体验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 1000 指数增强 A 类份额净值增长率为-16.06%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%。本报告期汇添富中证 1000 指数增强 C 类份额净值增长率为-16.18%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前 A 股整体估值处于历史低位，具有较高的估值性价比和安全边际，向下空间有限。随着经济复苏和市场信心修复，市场很可能迎来较好的投资机会。市场风格上，小盘股经过前期的风险释放，后期有望企稳，中证 1000 等小盘股指数的投资价值凸显。本基金将继续严格遵守基金合同，追求相对业绩比较基准的较为稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

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，中国建设银行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，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、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 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	15,859,344.13	50,905,371.30
结算备付金		1,132,263.93	3,032,752.86
存出保证金		220,673.79	189,131.11
交易性金融资产	6.4.7.2	233,637,440.55	690,251,500.65
其中：股票投资		233,637,440.55	690,251,500.65
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		816,553.98	-
应收股利		-	-
应收申购款		539,554.16	2,002,007.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		252,205,830.54	746,380,763.53
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,369,120.75	11,037,115.34
应付赎回款		372,410.38	1,037,206.03
应付管理人报酬		255,306.67	702,531.42
应付托管费		42,551.12	117,088.56
应付销售服务费		16,509.17	55,432.16
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	476,590.74	1,001,628.22
负债合计		2,532,488.83	13,951,001.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	295,511,923.39	727,528,856.05
未分配利润	6.4.7.9	-45,838,581.68	4,900,905.75
净资产合计		249,673,341.71	732,429,761.80
负债和净资产总计		252,205,830.54	746,380,763.53

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 295,511,923.39 份。本基金下属汇添富中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.8456 元，基金份额总额 207,075,955.42 份；本基金下属汇添富中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.8431 元，基金份额总额 88,435,967.97 份。

2、本基金合同于 2023 年 05 月 19 日生效，上年度实际报告期间为 2023 年 05 月 19 日至 2023 年 12 月 31 日，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日 (基金合同生效 日)至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-136,634,337.65	5,353,274.75
1. 利息收入		67,498.46	414,973.15
其中：存款利息收入	6.4.7.10	67,498.46	414,973.15
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）		-124,851,892.95	3,528,944.26
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-127,671,411.90	3,265,039.84
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	27,077.98	-
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	2,792,440.97	263,904.42
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	-11,938,246.19	1,408,868.20
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	88,303.03	489.14
减：二、营业总支出		3,179,012.65	503,284.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,482,467.20	379,369.82
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	413,744.52	63,228.32
3. 销售服务费		183,070.53	36,780.51
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	99,730.40	23,905.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-139,813,350.30	4,849,990.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-139,813,350.30	4,849,990.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-139,813,350.30	4,849,990.20

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金

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	727,528,856.05	4,900,905.75	732,429,761.80
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	727,528,856.05	4,900,905.75	732,429,761.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-432,016,932.66	-50,739,487.43	-482,756,420.09
（一）、综合收益总额	-	-139,813,350.30	-139,813,350.30

(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)	-432,016,932.66	89,073,862.87	-342,943,069.79
其中: 1. 基金申购款	492,882,058.23	-44,601,284.72	448,280,773.51
2. 基金赎回款	-924,898,990.89	133,675,147.59	-791,223,843.30
(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	295,511,923.39	-45,838,581.68	249,673,341.71
项目	上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日(基金合同生效日)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	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	465,286,355.50	-	465,286,355.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-351,727,405.27	4,077,886.13	-347,649,519.14
(一)、综合收益总额	-	4,849,990.20	4,849,990.20
(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)	-351,727,405.27	-772,104.07	-352,499,509.34
其中: 1. 基金申购款	10,846,283.27	181,052.12	11,027,335.39
2. 基金赎回款	-362,573,688.54	-953,156.19	-363,526,844.73
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-

四、本期期末净资产	113,558,950.23	4,077,886.13	117,636,836.36
-----------	----------------	--------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]2395 号文《关于准予汇添富中证 1000 指数增强型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 5 月 19 日生效。首次设立基金募集规模为 465,286,355.50 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 60466941_B26 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的标的指数为中证 1000 指数及其未来可能发生的变更。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、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）、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、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）。本基金还可根据法律法规参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。其中，投资于港股通标的股票的比例不超过

股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其中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。本基金为股票型指数增强基金,在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,进行积极的组合管理和风险控制,力求实现超越标的指数的业绩表现,谋求基金资产的长期增值。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 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	15,859,344.13
等于：本金	15,857,788.74
加：应计利息	1,555.39
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	15,859,344.13

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	259,666,224.85	-	233,637,440.55	26,028,784.30
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	259,666,224.85	-	233,637,440.55	26,028,784.30

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	0.44
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	392,054.94
其中：交易所市场	392,054.94
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	476,590.74
----	------------

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 1000 指数增强 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	430,552,692.20	430,552,692.20
本期申购	105,285,010.90	105,285,010.90
本期赎回（以“-”号填列）	-328,761,747.68	-328,761,747.68
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	207,075,955.42	207,075,955.42
汇添富中证 1000 指数增强 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	296,976,163.85	296,976,163.85
本期申购	387,597,047.33	387,597,047.33
本期赎回（以“-”号填列）	-596,137,243.21	-596,137,243.21
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	88,435,967.97	88,435,967.97

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 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,055,036.91	-22,866,938.03	3,188,098.88
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	26,055,036.91	-22,866,938.03	3,188,098.88
本期利润	-80,556,535.91	19,313,153.56	-61,243,382.35
本期基金份额交易产生的变动数	18,760,567.15	7,328,216.11	26,088,783.26
其中：基金申购款	-7,835,835.49	-4,499,570.27	-12,335,405.76
基金赎回款	26,596,402.64	11,827,786.38	38,424,189.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-35,740,931.85	3,774,431.64	-31,966,500.21
汇添富中证 1000 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,476,305.78	-15,763,498.91	1,712,806.87
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	17,476,305.78	-15,763,498.91	1,712,806.87
本期利润	-47,318,568.20	-31,251,399.75	-78,569,967.95
本期基金份额交易产生的变动数	14,369,402.57	48,615,677.04	62,985,079.61
其中：基金申购款	-15,667,346.94	-16,598,532.02	-32,265,878.96
基金赎回款	30,036,749.51	65,214,209.06	95,250,958.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,472,859.85	1,600,778.38	-13,872,081.47

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	47,275.31
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	18,367.50
其他	1,855.65
合计	67,498.46

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,541,489,209.93
减：卖出股票成本总额	1,667,007,851.97
减：交易费用	2,152,769.86
买卖股票差价收入	-127,671,411.90

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	7,233.98
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	19,844.00
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	27,077.98

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	16,579,292.45
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	16,448,872.00
减：应计利息总额	110,576.45
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	19,844.00

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

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	2,792,440.97
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	2,792,440.97

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-11,938,246.19
——股票投资	-11,938,246.19
——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	-11,938,246.19

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	88,303.03
替代损益	-
其他	-
合计	88,303.03

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	9,000.00
银行费用	6,174.27
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	20.77
合计	99,730.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日（基金 合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成 交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票成 交总额的比例 （%）
东方证券	-	-	244,178,779.48	90.67

6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

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 (%)
	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	176,128.43	90.67	176,128.43	90.67

注：上述佣金的计算方式按相关协议约定的佣金率计算。上述佣金与应支付非关联方交易佣金的计算方式、佣金计算比率不存在差异，具有公允性。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,482,467.20	379,369.82
其中：应支付销售机构的客户维护费	321,213.01	176,791.46
应支付基金管理人的净管理费	2,161,254.19	202,578.36

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、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 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	上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日（基 金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	413,744.52	63,228.32

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、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 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。

6.4.10.2.3 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 1000 指数增强 A	汇添富中证 1000 指数增强 C	合计
东方证券股份有限公司	-	552.83	552.83
汇添富基金管理股份有限公司	-	96,304.46	96,304.46
中国建设银行股份有限公司	-	9,626.55	9,626.55

合计	-	106,483.84	106,483.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）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 1000 指数增强 A	汇添富中证 1000 指数增强 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	2.95	2.95
中国建设银行股份有限公司	-	32,262.60	32,262.60
合计	-	32,265.55	32,265.55

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、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 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	15,859,344.13	47,275.31	7,257,228.54	29,924.60

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

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	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
-----------------------------	--------	-----------	-----------------	----------	----------	-----	----

日							
资产							
货币资金	15,859,344.13	-	-	-	-	-	15,859,344.13
结算备付金	1,132,263.93	-	-	-	-	-	1,132,263.93
存出保证金	220,673.79	-	-	-	-	-	220,673.79
交易性金融资产	-	-	-	-	-	233,637,440.55	233,637,440.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	816,553.98	816,553.98
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	539,554.16	539,554.16
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,212,281.85	-	-	-	-	234,993,548.69	252,205,830.54
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金	-	-	-	-	-	-	-

融负 债							
衍生 金融 负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 清算 款	-	-	-	-	-	1,369,120.75	1,369,120.75
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	372,410.38	372,410.38
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	255,306.67	255,306.67
应付 托管 费	-	-	-	-	-	42,551.12	42,551.12
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	16,509.17	16,509.17
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	-	-	-	-	-	476,590.74	476,590.74
负债 总计	-	-	-	-	-	2,532,488.83	2,532,488.83
利率	17,212,281.85	-	-	-	-	232,461,059.86	249,673,341.71

敏感 度缺 口							
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	50,905,371.30	-	-	-	-	-	50,905,371.30
结算 备付 金	3,032,752.86	-	-	-	-	-	3,032,752.86
存出 保证 金	189,131.11	-	-	-	-	-	189,131.11
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	690,251,500.65	690,251,500.65
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	-	-	-	-	-	2,002,007.61	2,002,007.61
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-

资产							
资产总计	54,127,255.27	-	-	-	-	692,253,508.26	746,380,763.53
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	-	-	-	-	-	11,037,115.34	11,037,115.34
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,037,206.03	1,037,206.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	702,531.42	702,531.42
应付托管费	-	-	-	-	-	117,088.56	117,088.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	55,432.16	55,432.16
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	-	-	-	-	-	1,001,628.22	1,001,628.22
负债总计	-	-	-	-	-	13,951,001.73	13,951,001.73
利率敏感度缺口	54,127,255.27	-	-	-	-	678,302,506.53	732,429,761.80

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	233,637,440.55	93.58	690,251,500.65	94.24
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	233,637,440.55	93.58	690,251,500.65	94.24
----	----------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	中证 1000 指数上涨 5%	12,501,293.74	32,928,268.81
	中证 1000 指数下跌 5%	-12,501,293.74	-32,928,268.81

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	233,637,440.55

第二层次	-
第三层次	-
合计	233,637,440.55

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	233,637,440.55	92.64
	其中：股票	233,637,440.55	92.64
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	16,991,608.06	6.74
8	其他各项资产	1,576,781.93	0.63
9	合计	252,205,830.54	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	345,967.00	0.14
B	采矿业	3,723,518.00	1.49
C	制造业	128,015,035.45	51.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,125,223.14	2.05
E	建筑业	1,397,566.00	0.56
F	批发和零售业	9,416,411.50	3.77
G	交通运输、仓储和邮政业	7,860,975.60	3.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,915,288.00	6.77
J	金融业	6,699,838.00	2.68
K	房地产业	4,498,475.00	1.80
L	租赁和商务服务业	3,221,710.26	1.29
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,422,662.00	0.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,369,042.00	0.95
R	文化、体育和娱乐业	1,700,788.00	0.68
S	综合	-	-
	合计	193,712,499.95	77.59

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	711,680.00	0.29

C	制造业	30,507,238.60	12.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,510,163.00	0.60
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,720,644.00	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	420,168.00	0.17
H	住宿和餐饮业	92,820.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,055,843.00	0.82
J	金融业	1,127,748.00	0.45
K	房地产业	486,502.00	0.19
L	租赁和商务服务业	1,275,952.00	0.51
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	16,182.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	39,924,940.60	15.99

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	688578	艾利斯医药科技	21,000	1,338,540.00	0.54
2	605589	圣泉集团	64,700	1,312,763.00	0.53
3	002139	拓邦股份	123,400	1,310,508.00	0.52
4	600685	中船防务	44,100	1,230,390.00	0.49
5	002126	银轮股	70,400	1,225,664.00	0.49

		份			
6	000403	派林生物	45,353	1,209,110.98	0.48
7	000034	神州数码	52,000	1,190,280.00	0.48
8	600323	瀚蓝环境	55,900	1,168,310.00	0.47
9	600559	老白干酒	62,300	1,132,614.00	0.45
10	605090	九丰能源	38,400	1,113,600.00	0.45
11	000682	东方电子	99,800	1,101,792.00	0.44
12	002745	木林森	136,200	1,097,772.00	0.44
13	601222	林洋能源	174,600	1,094,742.00	0.44
14	601375	中原证券	320,800	1,093,928.00	0.44
15	002332	仙琚制药	95,000	1,083,950.00	0.43
16	000860	顺鑫农业	63,700	1,066,338.00	0.43
17	300857	协创数据	18,600	1,060,200.00	0.42
18	600718	东软集团	128,100	1,059,387.00	0.42
19	002773	康弘药业	48,400	1,047,860.00	0.42
20	600850	电科数字	57,500	1,040,750.00	0.42
21	002100	天康生物	149,000	1,032,570.00	0.41
22	603766	隆鑫通用	150,600	1,021,068.00	0.41
23	000049	德赛电池	43,200	1,013,040.00	0.41
24	002036	联创电子	149,700	1,010,475.00	0.40
25	002249	大洋电机	212,700	1,006,071.00	0.40
26	300303	聚飞光电	206,400	1,003,104.00	0.40
27	600575	淮河能	257,700	1,002,453.00	0.40

		源			
28	600420	国药现代	93,800	1,001,784.00	0.40
29	688596	正帆科技	29,886	986,238.00	0.40
30	002171	楚江新材	149,200	983,228.00	0.39
31	600717	天津港	230,100	982,527.00	0.39
32	000758	中色股份	192,900	979,932.00	0.39
33	002048	宁波华翔	75,700	979,558.00	0.39
34	600641	万业企业	83,100	976,425.00	0.39
35	002237	恒邦股份	84,700	974,897.00	0.39
36	002396	星网锐捷	73,600	972,256.00	0.39
37	002351	漫步者	73,900	971,785.00	0.39
38	600320	振华重工	283,500	969,570.00	0.39
39	300482	万孚生物	39,700	968,680.00	0.39
40	600459	贵研铂业	71,500	965,965.00	0.39
41	002948	青岛银行	286,600	965,842.00	0.39
42	300035	中科电气	113,200	963,332.00	0.39
43	600572	康恩贝	215,400	962,838.00	0.39
44	002839	张家港行	239,100	961,182.00	0.38
45	600864	哈投股份	202,300	960,925.00	0.38
46	002192	融捷股份	31,900	957,638.00	0.38
47	000915	华特达因	31,700	956,072.00	0.38
48	002635	安洁科技	61,700	952,648.00	0.38
49	002123	梦网科技	135,400	951,862.00	0.38
50	600158	中体产	123,700	951,253.00	0.38

		业			
51	000012	南玻 A	188,300	949,032.00	0.38
52	603997	继峰股份	92,600	947,298.00	0.38
53	600125	铁龙物流	157,800	942,066.00	0.38
54	002214	大立科技	83,400	940,752.00	0.38
55	600577	精达股份	236,900	940,493.00	0.38
56	002174	游族网络	123,900	940,401.00	0.38
57	603920	世运电路	47,600	939,624.00	0.38
58	600480	凌云股份	95,200	935,816.00	0.37
59	002276	万马股份	130,400	934,968.00	0.37
60	300470	中密控股	27,500	929,775.00	0.37
61	002099	海翔药业	181,800	928,998.00	0.37
62	002043	兔宝宝	89,100	923,967.00	0.37
63	000810	创维数字	107,500	922,350.00	0.37
64	002145	中核钛白	279,900	918,072.00	0.37
65	300113	顺网科技	89,300	914,432.00	0.37
66	600267	海正药业	129,758	910,901.16	0.36
67	601369	陕鼓动力	113,300	908,666.00	0.36
68	000969	安泰科技	114,300	906,399.00	0.36
69	600409	三友化工	180,500	906,110.00	0.36
70	603328	依顿电子	114,900	903,114.00	0.36
71	603368	柳药集团	51,600	903,000.00	0.36

72	300348	长亮科技	132,200	901,604.00	0.36
73	002079	苏州固锝	105,700	900,564.00	0.36
74	002993	奥海科技	24,200	900,240.00	0.36
75	600266	城建发展	240,700	900,218.00	0.36
76	002498	汉缆股份	273,100	898,499.00	0.36
77	600037	歌华有线	150,200	898,196.00	0.36
78	600206	有研新材	100,800	897,120.00	0.36
79	300773	拉卡拉	72,000	894,960.00	0.36
80	002550	千红制药	165,800	893,662.00	0.36
81	601528	瑞丰银行	189,200	893,024.00	0.36
82	002416	爱施德	100,600	890,310.00	0.36
83	000503	国新健康	133,100	887,777.00	0.36
84	600595	中孚实业	355,700	885,693.00	0.35
85	002011	盾安环境	90,000	884,700.00	0.35
86	600751	海航科技	397,700	882,894.00	0.35
87	000795	英洛华	159,200	881,968.00	0.35
88	300820	英杰电气	22,400	881,216.00	0.35
89	600623	华谊集团	152,200	879,716.00	0.35
90	600490	鹏欣资源	337,500	877,500.00	0.35
91	300687	赛意信息	62,900	875,568.00	0.35
92	300432	富临精工	135,900	875,196.00	0.35
93	603306	华懋科技	48,400	874,588.00	0.35
94	300226	上海钢联	51,500	872,410.00	0.35

95	000828	东莞控股	96,100	865,861.00	0.35
96	002004	华邦健康	227,550	864,690.00	0.35
97	688127	蓝特光学	47,000	864,330.00	0.35
98	688362	甬矽电子	44,400	864,024.00	0.35
99	603348	文灿股份	31,200	863,928.00	0.35
100	600649	城投控股	259,200	860,544.00	0.34
101	000950	重药控股	176,450	859,311.50	0.34
102	002125	湘潭电化	88,300	859,159.00	0.34
103	002467	二六三	257,100	858,714.00	0.34
104	600366	宁波韵升	164,200	857,124.00	0.34
105	002274	华昌化工	115,100	854,042.00	0.34
106	600391	航发科技	55,800	850,950.00	0.34
107	301291	明阳电气	28,300	850,415.00	0.34
108	002267	陕天然气	112,400	849,744.00	0.34
109	000913	钱江摩托	53,700	846,312.00	0.34
110	002390	信邦制药	255,400	845,374.00	0.34
111	600812	华北制药	204,900	844,188.00	0.34
112	603699	纽威股份	49,300	844,016.00	0.34
113	000848	承德露露	107,300	843,378.00	0.34
114	600929	雪天盐业	159,000	842,700.00	0.34
115	002053	云南能投	69,700	842,673.00	0.34
116	600055	万东医疗	68,200	842,270.00	0.34

117	603595	东尼电子	40,900	842,131.00	0.34
118	300143	盈康生命	111,600	840,348.00	0.34
119	002488	金固股份	191,395	840,224.05	0.34
120	600874	创业环保	150,300	840,177.00	0.34
121	300323	华灿光电	192,200	836,070.00	0.33
122	001213	中铁特货	211,600	835,820.00	0.33
123	300463	迈克生物	73,400	835,292.00	0.33
124	000968	蓝焰控股	131,300	835,068.00	0.33
124	300587	天铁股份	206,700	835,068.00	0.33
126	002204	大连重工	195,500	834,785.00	0.33
127	603919	金徽酒	45,800	832,186.00	0.33
128	603162	海通发展	89,480	832,164.00	0.33
129	002378	章源钨业	144,450	829,143.00	0.33
130	603025	大豪科技	59,900	827,818.00	0.33
131	301078	孩子王	163,500	827,310.00	0.33
132	002068	黑猫股份	116,500	827,150.00	0.33
133	688158	优刻得科技	80,536	823,883.28	0.33
134	002516	旷达科技	226,300	823,732.00	0.33
135	603985	恒润股份	69,000	821,100.00	0.33
136	300183	东软载波	70,900	821,022.00	0.33
137	000029	深深房 A	77,200	820,636.00	0.33
138	600458	时代新材	81,200	820,120.00	0.33
139	002291	遥望科	190,700	820,010.00	0.33

		技			
140	002265	建设工业	95,000	819,850.00	0.33
141	603229	奥翔药业	81,440	818,472.00	0.33
142	688586	中航飞机装备	87,800	816,540.00	0.33
143	603299	苏盐井神	85,900	816,050.00	0.33
144	300850	新强联	54,300	815,586.00	0.33
145	000517	荣安地产	304,100	814,988.00	0.33
146	688166	博瑞生物医药	23,200	812,000.00	0.33
147	002705	新宝股份	57,700	811,839.00	0.33
148	300821	东岳硅材	118,600	811,224.00	0.32
149	600810	神马股份	130,700	810,340.00	0.32
150	002837	英维克	37,830	809,183.70	0.32
151	001338	永顺泰	82,000	803,600.00	0.32
152	300039	上海凯宝	150,200	803,570.00	0.32
153	688800	瑞可达连接系统	28,600	803,088.00	0.32
154	688232	国泰新点软件	40,601	800,651.72	0.32
155	301239	普瑞眼科	22,600	798,458.00	0.32
156	000791	甘肃能源	129,100	796,547.00	0.32
157	688380	中微半导	47,598	795,838.56	0.32
158	300841	康华生物	15,700	795,048.00	0.32
159	600556	天下秀	218,000	793,520.00	0.32
160	301327	华宝新能	13,800	790,740.00	0.32
161	688209	英集芯科技	63,600	789,276.00	0.32
162	600662	外服控	196,026	786,064.26	0.31

		股			
163	603123	翠微股份	132,300	785,862.00	0.31
164	002088	鲁阳节能	65,000	785,850.00	0.31
165	002461	珠江啤酒	105,800	785,036.00	0.31
166	600651	飞乐音响	283,800	783,288.00	0.31
167	002250	联化科技	163,000	782,400.00	0.31
168	600618	氯碱化工	89,000	781,420.00	0.31
169	688484	南芯科技	21,000	779,100.00	0.31
170	603906	龙蟠科技	99,400	774,326.00	0.31
171	002534	西子洁能	77,300	773,773.00	0.31
172	601609	金田股份	135,600	767,496.00	0.31
173	002034	旺能环境	58,600	762,386.00	0.31
174	000061	农产品	156,800	762,048.00	0.31
175	000030	富奥股份	154,600	759,086.00	0.30
176	301308	江波龙	8,000	757,920.00	0.30
177	600882	妙可蓝多	60,700	756,929.00	0.30
178	000557	西部创业	201,000	755,760.00	0.30
179	603055	台华新材	74,100	750,633.00	0.30
180	002651	利君股份	136,700	750,483.00	0.30
181	601811	新华文轩	53,500	749,535.00	0.30
182	605365	立达信	47,200	749,064.00	0.30
183	002320	海峡股份	144,800	747,168.00	0.30
184	002646	天佑德酒	72,900	745,767.00	0.30

185	001236	弘业期货	104,500	742,995.00	0.30
186	688776	国光电气	13,400	742,360.00	0.30
187	002911	佛燃能源	81,001	740,349.14	0.30
188	603938	三孚股份	63,000	740,250.00	0.30
189	002549	凯美特气	143,200	731,752.00	0.29
190	002219	新里程	392,600	730,236.00	0.29
191	002183	怡亚通	256,800	729,312.00	0.29
192	002287	奇正藏药	36,900	722,502.00	0.29
193	603915	国茂股份	69,900	719,271.00	0.29
194	600835	上海机电	62,400	718,224.00	0.29
195	603098	森特股份	90,700	712,902.00	0.29
196	603439	贵州三力	54,900	700,524.00	0.28
197	000597	东北制药	178,600	691,182.00	0.28
198	300741	华宝股份	45,300	690,372.00	0.28
199	301015	百洋医药	29,300	689,429.00	0.28
200	601886	江河集团	140,300	684,664.00	0.27
201	603093	南华期货	78,700	681,542.00	0.27
202	600691	阳煤化工	396,100	677,331.00	0.27
203	605222	起帆电缆	43,800	671,892.00	0.27
204	300382	斯莱克	112,200	663,102.00	0.27
205	002901	大博医疗	25,300	653,499.00	0.26
206	300973	立高食品	23,000	646,070.00	0.26
207	300679	电连技	16,000	643,680.00	0.26

		术			
208	601279	英利汽车	170,000	634,100.00	0.25
209	603871	嘉友国际	35,840	634,009.60	0.25
210	002782	可立克	56,200	622,696.00	0.25
211	600966	博汇纸业	125,000	597,500.00	0.24
212	300140	节能环保	97,900	584,463.00	0.23
213	300783	三只松鼠	25,900	566,433.00	0.23
214	600475	华光环能	60,000	522,600.00	0.21
215	603505	金石资源	18,000	502,740.00	0.20
216	600916	中国黄金	50,500	485,810.00	0.19
217	301316	慧博云通	32,600	478,568.00	0.19
218	688798	艾为电子	8,000	452,960.00	0.18
219	000426	兴业银锡	33,000	448,140.00	0.18
220	600100	同方股份	87,300	444,357.00	0.18
221	603638	艾迪精密	31,500	441,945.00	0.18
222	000627	天茂集团	228,800	400,400.00	0.16
223	300079	数码视讯	86,400	350,784.00	0.14
224	000735	罗牛山	79,900	345,967.00	0.14
225	300085	银之杰	42,600	344,208.00	0.14
226	603896	寿仙谷	14,600	342,662.00	0.14
227	688388	嘉元科技	32,800	319,800.00	0.13
228	002091	江苏国泰	45,700	311,217.00	0.12
229	002777	久远银海	19,300	289,307.00	0.12
230	601975	招商南	73,300	263,147.00	0.11

		油			
231	002649	博彦科技	29,300	233,228.00	0.09
232	600075	新疆天业	67,200	231,840.00	0.09
233	002697	红旗连锁	38,700	179,181.00	0.07
234	603100	川仪股份	7,600	178,676.00	0.07
235	603583	捷昌驱动	7,800	158,964.00	0.06
236	301301	川宁生物	12,000	153,360.00	0.06
237	000718	苏宁环球	74,800	125,664.00	0.05
238	300451	创业慧康	34,700	120,062.00	0.05
239	603033	三维股份	9,700	113,490.00	0.05
240	000927	中国铁物	30,200	71,876.00	0.03
241	300674	宇信科技	5,500	60,940.00	0.02
242	002421	达实智能	19,900	46,367.00	0.02
243	002537	海联金汇	4,700	24,299.00	0.01
244	600780	通宝能源	3,800	22,420.00	0.01
245	002349	精华制药	1,700	11,152.00	0.00
246	002158	汉钟精机	200	3,344.00	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

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	688772	珠海冠宇电池	49,400	736,060.00	0.29

2	002296	辉煌科技	70,500	726,855.00	0.29
3	688226	威腾电气集团股份	41,400	723,672.00	0.29
4	002112	三变科技	81,000	719,280.00	0.29
5	001331	胜通能源	51,700	716,045.00	0.29
6	300976	达瑞电子	15,600	715,260.00	0.29
7	300514	友讯达	47,200	714,136.00	0.29
8	002449	国星光电	100,200	713,424.00	0.29
9	002380	科远智慧	38,900	711,870.00	0.29
10	601020	华钰矿业	55,600	711,680.00	0.29
11	002138	顺络电子	25,900	711,214.00	0.28
12	601231	环旭电子	44,300	711,015.00	0.28
13	002026	山东威达	84,800	703,840.00	0.28
14	600469	风神股份	120,300	702,552.00	0.28
15	603225	新凤鸣	45,000	701,550.00	0.28
16	603015	弘讯科技	92,700	700,812.00	0.28
17	688519	南亚新材料	27,400	700,618.00	0.28
18	300566	激智科技	50,000	699,500.00	0.28
19	603296	华勤技术	12,640	698,107.20	0.28
20	603380	易德龙	34,600	694,768.00	0.28
21	300381	溢多利	112,700	691,978.00	0.28
22	000159	国际实业	132,500	691,650.00	0.28
23	300905	宝丽迪	24,300	690,363.00	0.28
24	300488	恒锋工具	33,800	687,830.00	0.28
25	002866	传艺科	53,300	685,971.00	0.27

		技			
26	601633	长城汽车	27,000	683,100.00	0.27
27	002282	博深股份	106,700	681,813.00	0.27
28	002768	国恩股份	35,800	669,460.00	0.27
29	002001	新和成	34,700	666,240.00	0.27
30	603501	韦尔股份	6,700	665,779.00	0.27
31	002376	新北洋	123,200	664,048.00	0.27
32	600479	千金药业	64,600	656,982.00	0.26
33	601318	中国平安	15,700	649,352.00	0.26
34	002529	海源复材	124,800	643,968.00	0.26
35	300707	威唐工业	52,000	643,760.00	0.26
36	300662	科锐国际	39,400	635,522.00	0.25
37	300018	中元股份	137,800	633,880.00	0.25
38	001313	粤海饲料	84,000	631,680.00	0.25
39	002153	石基信息	108,500	621,705.00	0.25
40	600617	国新能源	243,460	608,650.00	0.24
41	002084	海鸥住工	239,800	587,510.00	0.24
42	000757	浩物股份	233,000	584,830.00	0.23
43	603213	镇洋发展	77,200	577,456.00	0.23
44	301066	万事利	69,400	562,140.00	0.23
45	601700	风范股份	126,800	556,652.00	0.22
46	300193	佳士科技	71,700	532,014.00	0.21
47	600526	菲达环保	143,100	530,901.00	0.21

48	600228	返利科技	105,300	511,758.00	0.20
49	000921	海信家电	15,600	502,944.00	0.20
50	601198	东兴证券	60,100	478,396.00	0.19
51	301383	天键股份	17,220	449,786.40	0.18
52	002462	嘉事堂	40,600	444,164.00	0.18
53	688516	奥特维科技	10,600	443,186.00	0.18
54	603052	可川科技	15,500	436,325.00	0.17
55	601518	吉林高速	172,200	420,168.00	0.17
56	300752	隆利科技	28,800	391,104.00	0.16
57	600152	维科技术	76,900	369,120.00	0.15
58	002483	润邦股份	80,200	361,702.00	0.14
59	601138	工业富联	13,200	361,680.00	0.14
60	000514	渝开发	105,500	331,270.00	0.13
61	600790	轻纺城	101,500	326,830.00	0.13
62	300864	南大环境	16,000	313,600.00	0.13
63	603051	鹿山新材	13,700	299,071.00	0.12
64	603949	雪龙集团	21,800	245,468.00	0.10
65	688148	芳源股份	50,000	210,500.00	0.08
66	603399	吉翔股份	31,000	191,890.00	0.08
67	688365	光云科技	31,800	191,436.00	0.08
68	000593	德龙汇能	39,800	185,468.00	0.07
69	300241	瑞丰光电	39,900	163,590.00	0.07
70	600663	陆家嘴	17,600	155,232.00	0.06

71	002722	物产金轮	12,300	138,990.00	0.06
72	002480	新筑股份	37,800	117,936.00	0.05
73	688371	菲沃泰纳米科技	10,800	108,432.00	0.04
74	300259	新天科技	39,000	98,670.00	0.04
75	002979	雷赛智能	5,100	92,820.00	0.04
75	301073	君亭酒店	5,100	92,820.00	0.04
77	603897	长城科技	4,400	77,220.00	0.03
78	688036	传音控股	400	30,616.00	0.01
79	601999	出版传媒	3,100	16,182.00	0.01
80	002322	理工能科	900	14,418.00	0.01
81	688213	思特威电子科技	96	4,656.00	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	000032	深桑达 A	6,550,619.00	0.89
2	300158	振东制药	6,254,935.00	0.85
3	002174	游族网络	6,029,543.60	0.82
4	600577	精达股份	5,814,892.00	0.79
5	601126	四方股份	5,272,349.00	0.72
6	603118	共进股份	5,072,776.00	0.69
7	688326	经纬恒润	5,062,623.98	0.69
8	688152	麒麟信安	5,009,079.72	0.68
9	002837	英维克	4,981,115.89	0.68
10	603306	华懋科技	4,948,872.00	0.68
11	300735	光弘科技	4,904,776.20	0.67

12	000685	中山公用	4,890,099.59	0.67
13	002378	章源钨业	4,875,185.90	0.67
14	688166	博瑞生物医 药	4,692,514.55	0.64
15	002467	二六三	4,668,101.00	0.64
16	601369	陕鼓动力	4,645,075.00	0.63
17	603530	神马电力	4,574,871.00	0.62
18	600217	中再资环	4,475,967.00	0.61
19	603678	火炬电子	4,333,415.02	0.59
20	603595	东尼电子	4,246,036.00	0.58

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	002456	欧菲光	8,998,525.00	1.23
2	300735	光弘科技	7,939,080.22	1.08
3	603530	神马电力	7,719,143.00	1.05
4	000032	深桑达 A	7,481,742.00	1.02
5	688166	博瑞生物医 药	7,217,605.44	0.99
6	600246	万通发展	6,022,794.00	0.82
7	601137	博威合金	6,015,318.00	0.82
8	688152	麒麟信安	5,761,150.27	0.79
9	300158	振东制药	5,641,600.00	0.77
10	300476	胜宏科技	5,641,369.00	0.77
11	301301	川宁生物	5,496,512.00	0.75
12	603556	海兴电力	5,340,952.40	0.73
13	600675	中华企业	5,316,145.00	0.73
14	601126	四方股份	5,216,305.00	0.71
15	603118	共进股份	5,043,423.00	0.69
16	688322	奥比中光	5,034,724.67	0.69
17	603108	润达医疗	5,012,724.00	0.68
18	688031	星环科技	5,007,077.85	0.68
19	600577	精达股份	4,936,145.00	0.67
20	688326	经纬恒润	4,921,900.55	0.67

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	1,222,332,038.06
卖出股票收入（成交）总额	1,541,489,209.93

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：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	220,673.79
2	应收清算款	816,553.98
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	539,554.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,576,781.93

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：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
汇添 富中 证 1000 指数 增强 A	5,474	37,829.00	114,985,413.06	55.53	92,090,542.36	44.47

汇添富中证 1000 指数增强 C	13,928	6,349.51	43,683,360.02	49.40	44,752,607.95	50.60
合计	19,402	15,231.00	158,668,773.08	53.69	136,843,150.31	46.31

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富中证 1000 指数增强 A	1,494,168.44	0.72
	汇添富中证 1000 指数增强 C	133,904.29	0.15
	合计	1,628,072.73	0.55

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证 1000 指数增强 A	0
	汇添富中证 1000 指数增强 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 1000 指数增强 A	10~50
	汇添富中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 1000 指数增强 A	汇添富中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 05 月 19 日）基金份额总额	209,388,299.59	255,898,055.91

本报告期期初基金份额总额	430,552,692.20	296,976,163.85
本报告期基金总申购份额	105,285,010.90	387,597,047.33
减：本报告期基金总赎回份额	328,761,747.68	596,137,243.21
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	207,075,955.42	88,435,967.97

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未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	3	2,763,821,247.99	100.00	1,204,752.33	100.00	
财通证券	2	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
川财证券	2	-	-	-	-	
大和证券	2	-	-	-	-	
东北证券	1	-	-	-	-	
东方证券	2	-	-	-	-	
东吴证券	3	-	-	-	-	
方正证券	2	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国联证券	2	-	-	-	-	
国投证券	2	-	-	-	-	
海通证券	4	-	-	-	-	

华安 证券	1	-	-	-	-	
华泰 证券	2	-	-	-	-	
华兴 证券	2	-	-	-	-	
开源 证券	2	-	-	-	-	
摩根 大通 证券	2	-	-	-	-	
平安 证券	2	-	-	-	-	
上海 证券	2	-	-	-	-	
申万 宏源 证券	3	-	-	-	-	
太平 洋证 券	1	-	-	-	-	
天风 证券	2	-	-	-	-	
西部 证券	2	-	-	-	-	
西南 证券	1	-	-	-	-	
野村 东方 国际	2	-	-	-	-	
粤开 证券	1	-	-	-	-	
招商 证券	2	-	-	-	-	
浙商 证券	1	-	-	-	-	
中泰 证券	2	-	-	-	-	
中信 建投 证券	4	-	-	-	-	
中邮 证券	2	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中信证券	32,917,588.00	100.00	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根 大通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村 东方 国际	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 4 家证券公司的 7 个交易单元：华安证券（深交所单元）、财通证券（深交所单元，上交所单元）、摩根大通证券（深交所单元，上交所单元）、国联证券（上交所单元，深交所单元）。

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	上证报, 公司网站, 中	2024 年 04 月 03 日

	关于提醒投资者持续完善客户身份信息资料的公告	中国证监会基金电子披露网站	
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 05 月 24 日
9	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
10	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024 年 3 月 13 日至 2024 年 3 月 14 日, 2024 年 3 月 25 日至 2024 年 4 月 15 日	97,095,834.55	-	97,095,834.55	-	-
产品持有风险							

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2024 年 08 月 30 日