

中证 800 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
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	21
§ 5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
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	21
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	21
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	21
6.1 资产负债表	21
6.2 利润表	22
6.3 净资产变动表	24
6.4 报表附注	25
§ 7 投资组合报告	55
7.1 期末基金资产组合情况	55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
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	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	92
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	93
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	94
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	94
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	94
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	94

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	94
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	94
7.12 投资组合报告附注.....	94
§ 8 基金份额持有人信息.....	95
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	95
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	96
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	97
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.....	97
§ 9 开放式基金份额变动.....	97
§ 10 重大事件揭示.....	98
10.1 基金份额持有人大会决议.....	98
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.....	98
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	98
10.4 基金投资策略的改变.....	98
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	98
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.....	98
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	99
10.8 其他重大事件.....	101
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	102
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.....	102
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	102
§ 12 备查文件目录.....	102
12.1 备查文件目录.....	103
12.2 存放地点.....	103
12.3 查阅方式.....	103

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 08 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	7,440,187,198.00
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	2019 年 12 月 16 日

注：扩位证券简称：800ETF。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。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%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。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、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 姓名	李鹏	潘琦

负责人	联系电话	021-28932888	0755-22168257
	电子邮箱	service@99fund.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95511-3
传真		021-28932998	0755-82080387
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		200010	518001
法定代表人		李文	谢永林

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	-127,534,061.69
本期利润	-4,286,958.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0006
本期加权平均净值利润率	-0.06%
本期基金份额净值增长率	-0.66%
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	-932,439,570.39
期末可供分配基金份额利润	-0.1253
期末基金资产净值	6,507,747,627.61

期末基金份额净值	0.8747
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	-2.12%

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	-3.55%	0.56%	-4.23%	0.57%	0.68%	-0.01%
过去三个月	-2.21%	0.82%	-3.27%	0.83%	1.06%	-0.01%
过去六个月	-0.66%	1.02%	-1.76%	1.03%	1.10%	-0.01%
过去一年	-10.11%	0.93%	-11.97%	0.93%	1.86%	0.00%
过去三年	-27.24%	1.03%	-32.41%	1.04%	5.17%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-2.12%	1.14%	-7.28%	1.14%	5.16%	0.00%

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

添富中证800ETF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（2019年10月08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		
乐无穹	本基金的基金经理	2019 年 10 月 08 日	-	10	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2024 年 4 月 19 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月 8

				<p>日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添</p>
--	--	--	--	---

				<p>富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2022 年 7 月 29 日至 2024 年 2 月 7 日任汇添富中证 1000 交易</p>
--	--	--	--	--

				<p>型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富中证智能汽车主题交易型开放</p>
--	--	--	--	--

					<p>式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 28 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月 5 日至今任汇添富 MSCI 美国 50 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2024 年 3 月 1 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2024 年 4 月 1 日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p>
过蓓蓓	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2019 年 10 月 08 日	-	13	<p>国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限</p>

				<p>公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 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副总监。2015 年 8 月 3 日至今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。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 13 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。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 6 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。2015 年 8 月 3 日至今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。2015 年 8 月 3 日至今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。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 8 月 29 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</p>
--	--	--	--	--

				<p>理。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 5 月 22 日任深证 300 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生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 12 月 29 日至 2022 年 12 月 1 日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 10 月 23 日至 2023 年 5 月 22 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生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 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的</p>
--	--	--	--	--

				<p>基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2023 年 5 月 18 日任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日任汇添富国证生物医药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 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

				<p>2022 年 10 月 20 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 2 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2023 年 3 月 14 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 3 月 30 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 8 月 2 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司

决议确定的解聘日期。

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 6 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外,为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突,本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面,对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年资本市场经历较大震荡,半年度整体小幅下跌。一季度呈现先跌后涨的 V 形走势,二季度行情以震荡为主,5 月出现小幅回暖行情,6 月再度进入调整。

6 月美联储议息会议维持基准利率不变,已是去年 9 月以来连续第七次维持利率不变。当前美国通胀水平仍略高于政策目标,但今年以来持续改善并不断接近目标水平,市场预计今年晚些有望出现降息及适度放松的政策。

国内经济方面,二季度数据依然存在结构分化,出口高景气,但生产、投资、消费较弱。5 月工业增加值增速 5.6%,环比走弱并弱于预期;5 月固定资产投资同比增速 3.5%,较上月小幅放缓;社会消费品零售总额累计同比增速 3.7%,增速较上月提升,但略低于市场预期。

政策方面,3 月两会召开。政府工作报告提出,2024 年全年国内生产总值增长 5%左右、居民消费价格涨幅 3%左右、居民收入增长和经济增长同步等发展目标。总体政策基调依然坚持“稳中求进,以进促稳”。在全年主要工作任务中,将“大力推进现代化产业体系建设,加快发展新质生产力”放在第一位,将从产业链优化升级、培育新兴产业和未来产业、深入推进数字经济三个方面来促进社会生产力提升。科教兴国、扩大内需、深化改革等也是重要的工作任务。货币政策方面,2 月央行超预期降准 50bp,并定向降息,释放流动性超万亿。4 月《国务院关于加强监管防范风险推动资本市场高质量发展的若干意见》印发,为资本市场第三个“国九条”。随后,证监会、交易所各项配套制度规则也陆续发布,“1+N”政策体系有望快速推进落地。此次“国九条”围绕“强监管、防风险、推动高质量发展”的主线,有望推动市场改革持续深化、吸引长期资金入市,未来增量政策也值得期待。

结合经济温和修复、交易情绪改善等积极因素,A 股投资机会值得关注。

中证 800 指数是 A 股市场代表性宽基指数,覆盖 A 股数千只个股中市值较大、流动性较好的前 800 只股票,风格均衡,是 A 股市场核心资产的代表。而 800ETF 及其联接基金则是

这一代表性指数的产品化形式，为投资者提供了整体配置国内权益资产的优质工具。

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-0.66%。同期业绩比较基准收益率为-1.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年下半年，全球经济依然面临复杂的发展环境，风险与机遇并存。

国内来看，2024 年经济有望筑底企稳、温和修复。经济结构性转型需要经历新旧动能切换，带来阶段性阵痛。同时，前几年的外部冲击背景下，居民就业及收入预期改善需要时间。三季度二十届三中全会召开在即，有望围绕高质量发展、市场化改革、高水平开放等方面展开讨论并提出新的举措。

资本市场目前仍然面临对经济信心不足、财富效应收缩的问题。在经济修复出现实质性改善之前，交易情绪难以显著回暖。对长期配置来说，当前估值具备吸引力，但仍需关注阶段性震荡波动的风险。

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：中证 800 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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	27,196,594.20	31,664,606.54
结算备付金		36,579,802.84	20,496,024.86
存出保证金		14,565,071.32	11,218,473.50
交易性金融资产	6.4.7.2	6,389,989,845.02	7,092,656,805.20
其中：股票投资		6,389,691,822.81	7,092,532,901.40
基金投资		-	-
债券投资		298,022.21	123,903.80
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	-	-6,390.42
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		56,567,084.60	57,357,928.62
应收股利		-	19,940.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	136,954.82
资产总计		6,524,898,397.98	7,213,544,343.12
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		14,832,007.50	19,898,301.48
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		828,776.69	946,482.10
应付托管费		276,258.87	315,494.03
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,123.15	14,095.58
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,211,604.16	1,253,634.63
负债合计		17,150,770.37	22,428,007.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	7,440,187,198.00	8,166,937,198.00
未分配利润	6.4.7.9	-932,439,570.39	-975,820,862.70
净资产合计		6,507,747,627.61	7,191,116,335.30
负债和净资产总计		6,524,898,397.98	7,213,544,343.12

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额净值0.8747元，基金份额总额7,440,187,198.00份。

6.2 利润表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年01月01日 至2023年06月30 日
一、营业总收入		3,759,262.00	28,449,232.48
1. 利息收入		2,188,671.18	1,155,386.42
其中：存款利息收入	6.4.7.10	431,480.56	192,986.93
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		19,546.04	-
其他利息收入		1,737,644.58	962,399.49
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-123,401,171.43	-3,238,309.27
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-207,296,201.94	-23,868,491.49
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	80,660.03	108,565.09
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	5,359,966.44	-2,076,780.30
股利收益	6.4.7.17	78,454,404.04	22,598,397.43
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	123,247,102.78	30,587,449.10
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	1,724,659.47	-55,293.77
减：二、营业总支出		8,046,220.91	2,400,735.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,152,996.78	1,495,933.84
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,717,665.61	498,644.63
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		39,975.20	12,590.63
8. 其他费用	6.4.7.21	1,135,583.32	393,565.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,286,958.91	26,048,497.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,286,958.91	26,048,497.42
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,286,958.91	26,048,497.42

6.3 净资产变动表

会计主体：中证 800 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	8,166,937,198.00	-975,820,862.70	7,191,116,335.30
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	8,166,937,198.00	-975,820,862.70	7,191,116,335.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-726,750,000.00	43,381,292.31	-683,368,707.69
（一）、综合收益总额	-	-4,286,958.91	-4,286,958.91
（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）	-726,750,000.00	47,668,251.22	-679,081,748.78
其中：1. 基金申购款	1,966,500,000.00	-248,668,606.94	1,717,831,393.06
2. 基金赎回款	-2,693,250,000.00	296,336,858.16	-2,396,913,141.84
（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	7,440,187,198.00	-932,439,570.39	6,507,747,627.61
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,745,437,198.00	129,057,039.83	1,874,494,237.83
加：会计政策变更	-	-	-

二、本期期初净资产	1,745,437,198.00	129,057,039.83	1,874,494,237.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	52,000,000.00	30,707,220.36	82,707,220.36
（一）、综合收益总额	-	26,048,497.42	26,048,497.42
（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）	52,000,000.00	4,658,722.94	56,658,722.94
其中：1. 基金申购款	216,000,000.00	24,050,600.93	240,050,600.93
2. 基金赎回款	-164,000,000.00	-19,391,877.99	-183,391,877.99
（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	1,797,437,198.00	159,764,260.19	1,957,201,458.19

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

中证 800 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[2019]162 号文《关于准予中证 800 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 2019 年 10 月 8 日生效。首次设立基金募集规模为 6,601,437,198.00 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（2019）验字第 60466941_A04 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

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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。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。本基金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%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说

明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

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

2. 增值税

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

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

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

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

的基金管理人为增值税纳税人；

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基

金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	27,196,594.20
等于：本金	27,190,717.57
加：应计利息	5,876.63
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	27,196,594.20

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	6,914,981,404.66	-	6,389,691,822.81	-525,289,581.8

					5
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	-
债券	交易所市场	298,000.00	22.21	298,022.21	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	298,000.00	22.21	298,022.21	-
资产支持证券	-	-	-	-	-
基金	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	6,915,279,404.66	22.21	6,389,989,845.02	525,289,581.85	-

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	113,012,380.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	113,012,380.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	113,012,380.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	28	27,538,560.00	-1,364,560.00
IF2407	IF2407	80	82,488,000.00	-1,621,260.00
合计				-2,985,820.00
减：可抵销期货暂收款				-2,985,820.00
净额				-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	600,863.96
其中：交易所市场	600,863.96
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	44,753.80
应付信息披露费	59,672.34
应付指数使用费	506,314.06
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	1,211,604.16

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	8,166,937,198.00	8,166,937,198.00
本期申购	1,966,500,000.00	1,966,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,693,250,000.00	-2,693,250,000.00
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	7,440,187,198.00	7,440,187,198.00

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	1,625,491,389.27	-2,601,312,251.97	-975,820,862.70

加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	1,625,491,389.27	-2,601,312,251.97	-975,820,862.70
本期利润	-127,534,061.69	123,247,102.78	-4,286,958.91
本期基金份额交易产生的变动数	-132,523,102.85	180,191,354.07	47,668,251.22
其中：基金申购款	370,035,645.62	-618,704,252.56	-248,668,606.94
基金赎回款	-502,558,748.47	798,895,606.63	296,336,858.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,365,434,224.73	-2,297,873,795.12	-932,439,570.39

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		133,638.02
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		278,915.26
其他		18,927.28
合计		431,480.56

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		-163,050,147.36
股票投资收益——赎回差价收入		-44,246,054.58
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		-207,296,201.94

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		1,431,375,417.42
减：卖出股票成本总额		1,592,429,537.06
减：交易费用		1,996,027.72
买卖股票差价收入		-163,050,147.36

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	2,396,913,141.84
减：现金支付赎回款总额	970,970,956.84
减：赎回股票成本总额	1,470,188,239.58
减：交易费用	-
赎回差价收入	-44,246,054.58

6.4.7.11.4 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	71.81
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	80,588.22
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	80,660.03

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	462,562.43
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	381,900.00
减：应计利息总额	55.69
减：交易费用	18.52
买卖债券差价收入	80,588.22

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-
股指期货投资收益	5,359,966.44
外汇期货投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	78,454,404.04
其中：证券出借权益补偿收入	1,101,430.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	78,454,404.04

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	126,907,742.78
——股票投资	126,907,742.78
——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	-3,660,640.00
——权证投资	-
——期货投资	-3,660,640.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	123,247,102.78

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	1,724,659.47
其他	-
合计	1,724,659.47

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	1,030,599.33
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	557.85
合计	1,135,583.32

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
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	29,852,376.34	7.12

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成 交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成 交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	524,980.78	77.98

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 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)
东方证券	21,533.97	11.44	9,131.81	6.69

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

当期发生的基金应支付的管理费	5,152,996.78	1,495,933.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	37,484.62	-
应支付基金管理人的净管理费	5,115,512.16	1,495,933.84

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,717,665.61	498,644.63

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

单位：人民币元

本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	6,773,697.00	0.81~3.42	1.91	5,245.06	-	-
上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	4,142,087.00	1.00~3.50	2.29	3,694.84	1,700,430.00	382.83

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	10,815,151.00	0.15	15,420,310.00	0.19

公司				
汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	87,240,200.00	1.17	84,814,400.00	1.04

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	27,196,594.20	133,638.02	48,271,140.80	84,596.55

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

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券，和基金托管人平安银行发行的股票平安银行。于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 1,414,044.00 股，持有平安银行 2,629,567.00 股。（于上年度可比期间，本基金按照指数权重比例持有东方证券 379,944.00 股，持有平安银行 706,967.00 股。）

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升 24 转债	2024 年 06 月 17 日	17 个交易日	新债流通受限	100.00	100.01	2,980	298,000.00	298,022.21	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天 3	2023 年 08 月 30 日	重大事项停牌	0.01		-	371,600	952,476.03	3,716.00	

注：截止 2024 年 6 月 30 日，本基金合计持有中天 3（在深圳证券交易所退市时的股票简称为*ST 中天，证券代码为 000540）371,600 股。根据中天金融集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 6 月 29 日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市

暨摘牌的公告》，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。

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

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动

性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	27,196,594.20	-	-	-	-	-	27,196,594.20
结算备付金	36,579,802.84	-	-	-	-	-	36,579,802.84
存出保证	1,361,884.12	-	-	-	-	13,203,187.20	14,565,071.32

金							
交易性金融资产	-	-	298,022.21	-	-	6,389,691,822.81	6,389,989,845.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	56,567,084.60	56,567,084.60
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得	-	-	-	-	-	-	-

税资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	65,138,281.16	-	298,022.21	-	-	6,459,462,094.61	6,524,898,397.98
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	-	-	-	-	-	14,832,007.50	14,832,007.50

应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	828,776.69	828,776.69
应付托管费	-	-	-	-	-	276,258.87	276,258.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	2,123.15	2,123.15
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税	-	-	-	-	-	-	-

负债							
其他负债	-	-	-	-	-	1,211,604.16	1,211,604.16
负债总计	-	-	-	-	-	17,150,770.37	17,150,770.37
利率敏感度缺口	65,138,281.16	-	298,022.21	-	-	6,442,311,324.24	6,507,747,627.61
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	31,664,606.54	-	-	-	-	-	31,664,606.54
结算备付金	20,496,024.86	-	-	-	-	-	20,496,024.86
存出保证金	2,932,451.90	-	-	-	-	8,286,021.60	11,218,473.50
交	-	-	123,903.8	-	-	7,092,532,901.4	7,092,656,805.2

易性金融资产			0			0	0
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-6,390.42	-	-	-	-	-	-6,390.42
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	57,357,928.62	57,357,928.62
应收股利	-	-	-	-	-	19,940.00	19,940.00
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资	-	-	-	-	-	-	-

产							
其他资产	-	-	-	-	-	136,954.82	136,954.82
资产总计	55,086,692.88	-	123,903.80	-	-	7,158,333,746.44	7,213,544,343.12
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	-	-	-	-	-	19,898,301.48	19,898,301.48
应付	-	-	-	-	-	-	-

赎回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	946,482.10	946,482.10
应付托管费	-	-	-	-	-	315,494.03	315,494.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	14,095.58	14,095.58
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	1,253,634.63	1,253,634.63
负债总计	-	-	-	-	-	22,428,007.82	22,428,007.82
利率敏感度缺口	55,086,692.88	-	123,903.80	-	-	7,135,905,738.62	7,191,116,335.30

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	6,389,691,822.81	98.19	7,092,532,901.40	98.63
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	298,022.21	0.00	123,903.80	0.00
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	6,389,989.84 5.02	98.19	7,092,656.80 5.20	98.63

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 800 指数 上涨 5%	323,190,681.29	357,728,458.96
	中证 800 指数 下跌 5%	-323,190,681.29	-357,728,458.96

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	6,389,688,106.81
第二层次	298,022.21
第三层次	3,716.00
合计	6,389,989,845.02

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	6,389,691,822.81	97.93
	其中：股票	6,389,691,822.81	97.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	298,022.21	0.00
	其中：债券	298,022.21	0.00
	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	63,776,397.04	0.98
8	其他各项资产	71,132,155.92	1.09
9	合计	6,524,898,397.98	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	70,959,298.60	1.09
B	采矿业	368,404,367.56	5.66
C	制造业	3,493,704,780.89	53.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	290,073,180.01	4.46
E	建筑业	124,267,004.40	1.91
F	批发和零售业	46,576,394.79	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	212,816,511.20	3.27
H	住宿和餐饮业	5,088,888.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	332,053,587.13	5.10
J	金融业	1,224,242,433.34	18.81
K	房地产业	62,529,659.66	0.96
L	租赁和商务服务业	50,933,968.58	0.78
M	科学研究和技术服务业	49,709,214.87	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	7,316,478.50	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,804,329.00	0.03
Q	卫生和社会工作	22,991,811.68	0.35
R	文化、体育和娱乐业	23,328,563.60	0.36
S	综合	2,887,808.00	0.04

	合计	6,389,688,279.81	98.19
--	----	------------------	-------

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,716.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,716.00	0.00

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅	170,415	250,065,266.85	3.84

		台			
2	300750	宁德时代	715,140	128,746,654.20	1.98
3	601318	中国平安	2,917,156	120,653,572.16	1.85
4	600036	招商银行	3,354,700	114,697,193.00	1.76
5	600900	长江电力	3,317,540	95,943,256.80	1.47
6	000333	美的集团	1,323,261	85,350,334.50	1.31
7	601899	紫金矿业	4,467,100	78,486,947.00	1.21
8	601166	兴业银行	3,941,500	69,449,230.00	1.07
9	000858	五粮液	526,329	67,391,165.16	1.04
10	002594	比亚迪	245,240	61,371,310.00	0.94
11	601328	交通银行	7,453,500	55,677,645.00	0.86
12	601398	工商银行	9,504,300	54,174,510.00	0.83
13	002475	立讯精密	1,362,884	53,574,970.04	0.82
14	600030	中信证券	2,644,950	48,217,438.50	0.74
15	000651	格力电器	1,221,240	47,897,032.80	0.74
16	300760	迈瑞医疗	164,400	47,825,604.00	0.73
17	600276	恒瑞医药	1,210,642	46,561,291.32	0.72
18	600887	伊利股份	1,727,100	44,628,264.00	0.69
19	600309	万华化学	511,100	41,327,546.00	0.64
20	000725	京东方 A	10,016,900	40,969,121.00	0.63
21	601088	中国神华	893,340	39,637,495.80	0.61
22	601288	农业银行	8,656,400	37,741,904.00	0.58
23	300059	东方财富	3,422,028	36,136,615.68	0.56

		富			
24	601816	京沪高铁	6,660,500	35,766,885.00	0.55
25	300308	中际旭创	242,800	33,477,264.00	0.51
26	002714	牧原股份	740,958	32,305,768.80	0.50
27	601857	中国石油	3,072,700	31,710,264.00	0.49
28	002415	海康威视	1,010,900	31,246,919.00	0.48
29	601668	中国建筑	5,646,800	29,984,508.00	0.46
30	600919	江苏银行	3,981,150	29,579,944.50	0.45
31	601138	工业富联	1,077,100	29,512,540.00	0.45
32	600690	海尔智家	1,025,600	29,106,528.00	0.45
33	000568	泸州老窖	199,902	28,683,937.98	0.44
34	300498	温氏股份	1,444,240	28,624,836.80	0.44
35	600809	山西汾酒	132,060	27,848,812.80	0.43
36	002371	北方华创	86,008	27,513,099.12	0.42
37	601985	中国核电	2,558,500	27,273,610.00	0.42
38	600406	国电南瑞	1,089,774	27,200,759.04	0.42
39	601225	陕西煤业	1,051,900	27,107,463.00	0.42
40	601919	中远海控	1,731,060	26,814,119.40	0.41
41	603259	药明康德	684,181	26,813,053.39	0.41
42	000001	平安银行	2,629,567	26,690,105.05	0.41
43	600031	三一重工	1,611,000	26,581,500.00	0.41
44	601988	中国银行	5,708,800	26,374,656.00	0.41

45	600941	中国移动	244,700	26,305,250.00	0.40
46	600000	浦发银行	3,185,738	26,218,623.74	0.40
47	300124	汇川技术	508,250	26,073,225.00	0.40
48	601728	中国电信	4,208,411	25,881,727.65	0.40
49	601601	中国太保	926,900	25,823,434.00	0.40
50	000792	盐湖股份	1,473,600	25,714,320.00	0.40
51	600028	中国石化	3,960,200	25,028,464.00	0.38
52	601766	中国中车	3,300,000	24,783,000.00	0.38
53	688981	中芯国际	535,533	24,688,071.30	0.38
54	600150	中国船舶	605,468	24,648,602.28	0.38
55	300274	阳光电源	392,680	24,357,940.40	0.37
56	600050	中国联通	5,176,100	24,327,670.00	0.37
57	000063	中兴通讯	864,450	24,178,666.50	0.37
58	000338	潍柴动力	1,469,200	23,859,808.00	0.37
59	002352	顺丰控股	663,844	23,692,592.36	0.36
60	601169	北京银行	4,014,500	23,444,680.00	0.36
61	601012	隆基绿能	1,643,232	23,038,112.64	0.35
62	603501	韦尔股份	231,142	22,968,580.54	0.35
63	600837	海通证券	2,614,100	22,376,696.00	0.34
64	000100	TCL 科技	5,092,490	21,999,556.80	0.34
65	600016	民生银行	5,773,500	21,881,565.00	0.34
66	002230	科大讯飞	501,900	21,556,605.00	0.33

67	600660	福耀玻璃	434,400	20,807,760.00	0.32
68	300502	新易盛	192,800	20,350,040.00	0.31
69	002142	宁波银行	896,070	19,767,304.20	0.30
70	601229	上海银行	2,698,400	19,590,384.00	0.30
71	600089	特变电工	1,370,351	19,006,768.37	0.29
72	600938	中国海油	566,600	18,697,800.00	0.29
73	601390	中国中铁	2,782,800	18,143,856.00	0.28
74	000625	长安汽车	1,347,092	18,091,445.56	0.28
75	688041	海光信息	252,047	17,723,945.04	0.27
76	600104	上汽集团	1,253,800	17,377,668.00	0.27
77	603986	兆易创新	180,968	17,304,160.16	0.27
78	601688	华泰证券	1,389,300	17,213,427.00	0.26
79	600048	保利发展	1,948,500	17,068,860.00	0.26
80	601006	大秦铁路	2,381,304	17,050,136.64	0.26
81	600905	三峡能源	3,874,971	16,894,873.56	0.26
82	600436	片仔癀	81,500	16,884,355.00	0.26
83	688012	中微半导体设备	118,340	16,716,708.40	0.26
84	002027	分众传媒	2,738,000	16,592,280.00	0.25
85	601211	国泰君安	1,222,300	16,562,165.00	0.25
86	601888	中国中免	264,242	16,512,482.58	0.25
87	603019	中科曙光	397,120	16,480,480.00	0.25
88	601600	中国铝业	2,151,800	16,418,234.00	0.25

89	603993	洛阳钼业	1,915,800	16,284,300.00	0.25
90	600019	宝钢股份	2,400,900	15,965,985.00	0.25
91	601818	光大银行	5,029,400	15,943,198.00	0.24
92	603288	海天味业	451,555	15,565,100.85	0.24
93	600585	海螺水泥	650,300	15,340,577.00	0.24
94	601658	邮储银行	3,010,678	15,264,137.46	0.23
95	601989	中国重工	3,092,700	15,247,011.00	0.23
96	600886	国投电力	807,300	14,725,152.00	0.23
97	601009	南京银行	1,402,800	14,575,092.00	0.22
98	600795	国电电力	2,416,100	14,472,439.00	0.22
99	688111	金山办公	62,806	14,288,365.00	0.22
100	688008	澜起科技	247,590	14,152,244.40	0.22
101	601628	中国人寿	452,113	14,038,108.65	0.22
102	600999	招商证券	1,004,510	13,972,734.10	0.21
103	600438	通威股份	730,700	13,963,677.00	0.21
104	000938	紫光股份	621,060	13,880,691.00	0.21
105	000425	徐工机械	1,916,900	13,705,835.00	0.21
106	601939	建设银行	1,817,000	13,445,800.00	0.21
107	600547	山东黄金	490,900	13,440,842.00	0.21
108	300014	亿纬锂能	333,583	13,316,633.36	0.20
109	600893	航发动力	361,695	13,219,952.25	0.20
110	002304	洋河股份	163,500	13,200,990.00	0.20

111	002179	中航光电	345,450	13,144,372.50	0.20
112	601669	中国电建	2,340,200	13,081,718.00	0.20
113	300015	爱尔眼科	1,264,949	13,054,273.68	0.20
114	000002	万科A	1,847,800	12,805,254.00	0.20
115	002241	歌尔股份	650,100	12,683,451.00	0.19
116	600926	杭州银行	962,160	12,556,188.00	0.19
117	000538	云南白药	241,160	12,335,334.00	0.19
118	600584	长电科技	388,700	12,325,677.00	0.19
119	600760	中航沈飞	299,480	12,009,148.00	0.18
120	600111	北方稀土	687,100	11,818,120.00	0.18
121	600489	中金黄金	789,800	11,689,040.00	0.18
122	002050	三花智控	605,580	11,554,466.40	0.18
123	600011	华能国际	1,191,700	11,464,154.00	0.18
124	601916	浙商银行	4,082,300	11,267,148.00	0.17
125	688256	寒武纪科技	56,695	11,263,595.65	0.17
126	002252	上海莱士	1,438,100	11,245,942.00	0.17
127	002028	思源电气	166,800	11,158,920.00	0.17
128	600015	华夏银行	1,724,500	11,036,800.00	0.17
129	600009	上海机场	338,300	10,910,175.00	0.17
130	600426	华鲁恒升	403,560	10,750,838.40	0.17
131	600958	东方证券	1,414,044	10,746,734.40	0.17
132	601186	中国铁建	1,248,900	10,703,073.00	0.16

133	002311	海大集团	226,500	10,656,825.00	0.16
134	300408	三环集团	363,600	10,613,484.00	0.16
135	000166	申万宏源	2,444,800	10,537,088.00	0.16
136	601901	方正证券	1,341,900	10,372,887.00	0.16
137	000157	中联重科	1,350,100	10,368,768.00	0.16
138	600989	宝丰能源	597,600	10,356,408.00	0.16
139	000977	浪潮信息	279,600	10,169,052.00	0.16
140	601058	赛轮轮胎	714,300	10,000,200.00	0.15
141	003816	中国广核	2,139,100	9,904,033.00	0.15
142	600674	川投能源	527,319	9,887,231.25	0.15
143	300433	蓝思科技	540,500	9,864,125.00	0.15
144	688271	联影医疗	89,747	9,845,245.90	0.15
145	688169	石头科技	24,909	9,779,273.40	0.15
146	000776	广发证券	801,900	9,759,123.00	0.15
147	002049	紫光国微	184,780	9,719,428.00	0.15
148	002001	新和成	500,988	9,618,969.60	0.15
149	601377	兴业证券	1,876,112	9,493,126.72	0.15
150	688036	传音控股	123,202	9,429,881.08	0.14
151	000596	古井贡酒	44,500	9,392,615.00	0.14
152	600066	宇通客车	361,459	9,325,642.20	0.14
153	601111	中国国航	1,259,600	9,295,848.00	0.14
154	600115	中国东航	2,316,800	9,290,368.00	0.14

155	300122	智飞生物	325,400	9,120,962.00	0.14
156	000768	中航西飞	377,700	9,076,131.00	0.14
157	002340	格林美	1,397,300	8,900,801.00	0.14
158	002460	赣锋锂业	306,580	8,783,517.00	0.13
159	000933	神火股份	428,200	8,662,486.00	0.13
160	601800	中国交建	967,300	8,647,662.00	0.13
161	600010	包钢股份	6,172,900	8,642,060.00	0.13
162	001979	招商蛇口	980,400	8,617,716.00	0.13
163	600029	南方航空	1,461,200	8,606,468.00	0.13
164	601633	长城汽车	336,462	8,512,488.60	0.13
165	600188	兖矿能源	373,512	8,489,927.76	0.13
166	601077	渝农商行	1,681,600	8,441,632.00	0.13
167	002466	天齐锂业	280,000	8,374,800.00	0.13
168	002601	龙佰集团	450,900	8,373,213.00	0.13
169	002236	大华股份	536,800	8,298,928.00	0.13
170	002648	卫星化学	457,640	8,228,367.20	0.13
171	000988	华工科技	273,500	8,185,855.00	0.13
172	601117	中国化学	992,900	8,181,496.00	0.13
173	000786	北新建材	274,700	8,147,602.00	0.13
174	603799	华友钴业	367,370	8,129,898.10	0.12
175	601168	西部矿业	452,000	8,113,400.00	0.12
176	000661	长春高新	87,747	8,052,542.19	0.12

177	600346	恒力石化	574,400	8,012,880.00	0.12
178	002493	荣盛石化	823,550	7,955,493.00	0.12
179	000983	山西焦煤	771,400	7,953,134.00	0.12
180	300394	天孚通信	89,660	7,927,737.20	0.12
181	601838	成都银行	517,600	7,862,344.00	0.12
182	603369	今世缘	170,157	7,861,253.40	0.12
183	600372	中航机载	656,137	7,853,959.89	0.12
184	300782	卓胜微	101,020	7,853,294.80	0.12
185	600161	天坛生物	321,646	7,848,162.40	0.12
186	600023	浙能电力	1,092,200	7,765,542.00	0.12
187	601788	光大证券	531,100	7,764,682.00	0.12
188	688223	晶科能源	1,086,716	7,715,683.60	0.12
189	002384	东山精密	371,300	7,685,910.00	0.12
190	000423	东阿阿胶	122,500	7,668,500.00	0.12
191	000807	云铝股份	566,300	7,650,713.00	0.12
192	600196	复星医药	344,200	7,620,588.00	0.12
193	002129	TCL 中环	878,650	7,600,322.50	0.12
194	300418	昆仑万维	233,800	7,537,712.00	0.12
195	600418	江淮汽车	475,300	7,528,752.00	0.12
196	000630	铜陵有色	2,080,100	7,509,161.00	0.12
197	002938	鹏鼎控股	188,300	7,486,808.00	0.12
198	601021	春秋航空	132,500	7,463,725.00	0.11
199	601868	中国能	3,516,665	7,455,329.80	0.11

		建			
200	600845	宝信软件	233,073	7,442,020.89	0.11
201	601360	三六零	967,500	7,430,400.00	0.11
202	601872	招商轮船	877,860	7,417,917.00	0.11
203	300661	圣邦股份	88,795	7,350,450.10	0.11
204	600988	赤峰黄金	449,800	7,349,732.00	0.11
205	600233	圆通速递	468,400	7,330,460.00	0.11
206	601233	桐昆股份	455,900	7,276,164.00	0.11
207	600219	南山铝业	1,903,700	7,253,097.00	0.11
208	600570	恒生电子	410,610	7,251,372.60	0.11
209	600176	中国巨石	648,923	7,170,599.15	0.11
210	600085	同仁堂	186,900	7,141,449.00	0.11
211	600157	永泰能源	6,029,800	7,115,164.00	0.11
212	002180	纳思达	268,700	7,099,054.00	0.11
213	300896	爱美客	41,200	7,090,520.00	0.11
214	002625	光启技术	408,100	7,080,535.00	0.11
215	605499	东鹏饮料	32,700	7,055,025.00	0.11
216	601995	中金公司	237,600	7,035,336.00	0.11
217	600741	华域汽车	427,000	6,994,260.00	0.11
218	600600	青岛啤酒	95,725	6,965,908.25	0.11
219	300347	泰格医药	140,400	6,823,440.00	0.10
220	601336	新华保险	226,465	6,800,743.95	0.10
221	601100	恒立液压	145,948	6,798,257.84	0.10
222	002736	国信证券	780,100	6,779,069.00	0.10

223	601066	中信建投	352,300	6,778,252.00	0.10
224	600183	生益科技	321,520	6,771,211.20	0.10
225	601689	拓普集团	126,300	6,770,943.00	0.10
226	603392	万泰生物	102,678	6,764,426.64	0.10
227	002271	东方雨虹	547,300	6,753,682.00	0.10
228	600096	云天化	347,700	6,752,334.00	0.10
229	000895	双汇发展	281,102	6,681,794.54	0.10
230	600745	闻泰科技	236,400	6,678,300.00	0.10
231	601567	三星医疗	190,400	6,664,000.00	0.10
232	600362	江西铜业	280,900	6,651,712.00	0.10
233	000400	许继电气	193,200	6,648,012.00	0.10
234	000963	华东医药	237,400	6,602,094.00	0.10
235	001965	招商公路	551,700	6,543,162.00	0.10
236	002920	德赛西威	74,600	6,496,914.00	0.10
237	002156	通富微电	286,900	6,423,691.00	0.10
238	002273	水晶光电	378,200	6,421,836.00	0.10
239	002128	电投能源	304,300	6,420,730.00	0.10
240	688777	中控技术	170,200	6,416,540.00	0.10
241	601881	中国银河	588,300	6,388,938.00	0.10
242	600027	华电国际	918,100	6,371,614.00	0.10
243	601555	东吴证券	1,077,802	6,359,031.80	0.10
244	002078	太阳纸业	455,400	6,352,830.00	0.10

245	600885	宏发股份	226,634	6,273,229.12	0.10
246	688126	上海硅产业集团	448,601	6,195,179.81	0.10
247	601128	常熟银行	815,650	6,174,470.50	0.09
248	601898	中煤能源	493,400	6,157,632.00	0.09
249	002532	天山铝业	757,300	6,141,703.00	0.09
250	002223	鱼跃医疗	163,000	6,128,800.00	0.09
251	300207	欣旺达	403,400	6,119,578.00	0.09
252	300033	同花顺	58,600	6,076,820.00	0.09
253	600398	海澜之家	654,600	6,048,504.00	0.09
254	600352	浙江龙盛	701,300	6,024,167.00	0.09
255	002459	晶澳科技	537,236	6,017,043.20	0.09
256	002138	顺络电子	218,700	6,005,502.00	0.09
257	601618	中国中冶	1,931,900	5,988,890.00	0.09
258	002966	苏州银行	792,970	5,947,275.00	0.09
259	002916	深南电路	56,100	5,933,697.00	0.09
260	600026	中远海能	379,000	5,916,190.00	0.09
261	601699	潞安环能	325,900	5,908,567.00	0.09
262	000999	华润三九	138,610	5,902,013.80	0.09
263	002353	杰瑞股份	166,900	5,854,852.00	0.09
264	688617	惠泰医疗	12,800	5,838,080.00	0.09
265	600515	海南机场	1,856,533	5,829,513.62	0.09
266	601108	财通证券	880,180	5,817,989.80	0.09

267	601607	上海医药	302,700	5,784,597.00	0.09
268	600765	中航重机	282,360	5,760,144.00	0.09
269	300832	新产业	85,000	5,732,400.00	0.09
270	000301	东方盛虹	714,700	5,696,159.00	0.09
271	002185	华天科技	696,200	5,674,030.00	0.09
272	601878	浙商证券	527,400	5,653,728.00	0.09
273	000876	新希望	617,900	5,647,606.00	0.09
274	600039	四川路桥	712,040	5,617,995.60	0.09
275	600332	白云山	190,600	5,590,298.00	0.09
276	601998	中信银行	833,300	5,583,110.00	0.09
277	601877	正泰电器	292,351	5,572,210.06	0.09
278	002074	国轩高科	290,500	5,563,075.00	0.09
279	600879	航天电子	715,900	5,562,543.00	0.09
280	600588	用友网络	556,107	5,561,070.00	0.09
281	002517	恺英网络	581,900	5,557,145.00	0.09
282	600875	东方电气	301,200	5,557,140.00	0.09
283	600415	小商品城	746,200	5,536,804.00	0.09
284	002555	三七互娱	420,500	5,487,525.00	0.08
285	603606	东方电缆	112,100	5,471,601.00	0.08
286	301236	软通动力	155,000	5,457,550.00	0.08
287	002709	天赐材料	310,360	5,449,921.60	0.08
288	600873	梅花生物	543,200	5,442,864.00	0.08
289	688099	晶晨半	91,157	5,407,433.24	0.08

		导体			
290	600177	雅戈尔	753,900	5,367,768.00	0.08
291	601577	长沙银行	654,400	5,352,992.00	0.08
292	600109	国金证券	705,500	5,326,525.00	0.08
293	688396	华润微电子	141,796	5,308,842.24	0.08
294	002738	中矿资源	198,040	5,307,472.00	0.08
295	600079	人福医药	308,900	5,303,813.00	0.08
296	300003	乐普医疗	356,488	5,290,281.92	0.08
297	600025	华能水电	489,900	5,281,122.00	0.08
298	600803	新奥股份	253,000	5,262,400.00	0.08
299	600060	海信视像	212,500	5,257,250.00	0.08
300	300017	网宿科技	661,700	5,227,430.00	0.08
301	600497	驰宏锌锗	965,500	5,155,770.00	0.08
302	300136	信维通信	262,500	5,139,750.00	0.08
303	000408	藏格矿业	213,100	5,129,317.00	0.08
304	300316	晶盛机电	178,400	5,125,432.00	0.08
305	603160	汇顶科技	73,900	5,080,625.00	0.08
306	603979	金诚信	100,300	5,068,159.00	0.08
307	300223	北京君正	91,300	5,061,672.00	0.08
308	300628	亿联网络	137,300	5,048,521.00	0.08
309	002812	恩捷股份	159,400	5,045,010.00	0.08
310	002202	金风科技	746,500	5,016,480.00	0.08
311	000932	华菱钢铁	1,129,400	5,003,242.00	0.08

312	689009	九号公司	135,186	4,976,196.66	0.08
313	688599	天合光能	293,650	4,968,558.00	0.08
314	002739	万达电影	410,800	4,966,572.00	0.08
315	300450	先导智能	297,900	4,954,077.00	0.08
316	300142	沃森生物	433,100	4,928,678.00	0.08
317	688120	华海清科	25,982	4,925,667.56	0.08
318	000683	远兴能源	711,200	4,914,392.00	0.08
319	600348	华阳股份	492,200	4,902,312.00	0.08
320	002465	海格通信	472,500	4,895,100.00	0.08
321	600985	淮北矿业	291,800	4,884,732.00	0.08
322	600536	中国软件	163,025	4,877,708.00	0.07
323	002409	雅克科技	77,500	4,875,525.00	0.07
324	002444	巨星科技	195,800	4,836,260.00	0.07
325	000009	中国宝安	560,600	4,821,160.00	0.07
326	605117	德业股份	64,744	4,813,068.96	0.07
327	002281	光迅科技	128,300	4,794,571.00	0.07
328	600460	士兰微	272,200	4,766,222.00	0.07
329	002008	大族激光	228,500	4,752,800.00	0.07
330	000878	云南铜业	381,300	4,750,998.00	0.07
331	002007	华兰生物	299,320	4,726,262.80	0.07
332	002436	兴森科技	457,500	4,721,400.00	0.07
333	688122	西部超导	122,874	4,708,531.68	0.07

334	600642	申能股份	532,100	4,698,443.00	0.07
335	300474	景嘉微	73,800	4,666,374.00	0.07
336	601238	广汽集团	602,200	4,661,028.00	0.07
337	300054	鼎龙股份	204,900	4,647,132.00	0.07
338	000039	中集集团	501,300	4,642,038.00	0.07
339	601990	南京证券	602,800	4,629,504.00	0.07
340	601615	明阳智能	489,600	4,621,824.00	0.07
341	600298	安琪酵母	165,400	4,619,622.00	0.07
342	002797	第一创业	906,100	4,612,049.00	0.07
343	000066	中国长城	525,300	4,596,375.00	0.07
344	300012	华测检测	456,500	4,592,390.00	0.07
345	301269	华大九天	59,600	4,592,180.00	0.07
346	600529	山东药玻	180,100	4,563,734.00	0.07
347	300496	中科创达	99,800	4,549,882.00	0.07
348	300751	迈为股份	37,996	4,539,762.08	0.07
349	601666	平煤股份	405,300	4,539,360.00	0.07
350	300759	康龙化成	242,700	4,509,366.00	0.07
351	002673	西部证券	726,804	4,498,916.76	0.07
352	688525	佰维存储	69,800	4,477,670.00	0.07
353	603260	合盛硅业	95,800	4,474,818.00	0.07
354	600839	四川长虹	996,300	4,473,387.00	0.07
355	601319	中国人保	866,478	4,462,361.70	0.07

356	603596	伯特利	114,500	4,454,050.00	0.07
357	601179	中国西电	552,500	4,442,100.00	0.07
358	300999	金龙鱼	160,800	4,397,880.00	0.07
359	601799	星宇股份	39,100	4,380,764.00	0.07
360	000783	长江证券	905,300	4,372,599.00	0.07
361	300395	菲利华	141,800	4,360,350.00	0.07
362	000733	振华科技	104,900	4,356,497.00	0.07
363	600018	上港集团	753,100	4,352,918.00	0.07
364	000831	中国稀土	171,700	4,352,595.00	0.07
365	601717	郑煤机	293,000	4,336,400.00	0.07
366	000728	国元证券	710,530	4,305,811.80	0.07
367	002432	九安医疗	106,100	4,301,294.00	0.07
368	300002	神州泰岳	529,100	4,296,292.00	0.07
369	603816	顾家家居	132,900	4,291,341.00	0.07
370	600918	中泰证券	756,600	4,289,922.00	0.07
371	600862	中航高科	227,700	4,276,206.00	0.07
372	000738	航发控制	212,800	4,270,896.00	0.07
373	002821	凯莱英	64,696	4,256,996.80	0.07
374	300413	芒果超媒	203,500	4,253,150.00	0.07
375	000703	恒逸石化	597,610	4,237,054.90	0.07
376	601997	贵阳银行	797,438	4,202,498.26	0.06
377	688180	君实生物	144,390	4,194,529.50	0.06
378	601198	东兴证券	526,000	4,186,960.00	0.06
379	688009	中国通号	697,300	4,183,800.00	0.06

380	603338	浙江鼎力	68,840	4,159,312.80	0.06
381	000960	锡业股份	268,400	4,157,516.00	0.06
382	601865	福莱特	206,506	4,150,770.60	0.06
383	603806	福斯特	281,216	4,133,875.20	0.06
384	603345	安井食品	55,500	4,124,205.00	0.06
385	300037	新宙邦	144,000	4,112,640.00	0.06
386	600863	内蒙华电	886,000	4,111,040.00	0.06
387	002595	豪迈科技	107,700	4,110,909.00	0.06
388	002155	湖南黄金	227,000	4,108,700.00	0.06
389	688188	上海柏楚电子科技	22,240	4,104,392.00	0.06
390	603195	公牛集团	53,218	4,104,172.16	0.06
391	601162	天风证券	1,882,160	4,103,108.80	0.06
392	603659	璞泰来	290,150	4,099,819.50	0.06
393	300866	安克创新	57,416	4,088,593.36	0.06
394	600038	中直股份	99,400	4,086,334.00	0.06
395	601696	中银证券	449,200	4,078,736.00	0.06
396	300724	捷佳伟创	75,500	4,077,755.00	0.06
397	600521	华海药业	238,300	4,063,015.00	0.06
398	603939	益丰药房	165,057	4,052,149.35	0.06
399	000921	海信家电	125,600	4,049,344.00	0.06
400	300001	特锐德	201,100	4,046,132.00	0.06
401	002472	三环传动	183,600	4,042,872.00	0.06
402	002984	森麒麟	167,600	4,037,484.00	0.06
403	002294	信立泰	151,500	4,034,445.00	0.06
404	600549	厦门钨业	231,500	3,993,375.00	0.06

		业			
405	600699	均胜电 子	269,300	3,991,026.00	0.06
406	600141	兴发集 团	208,200	3,972,456.00	0.06
407	600132	重庆啤 酒	65,100	3,951,570.00	0.06
408	002407	多氟多	322,980	3,950,045.40	0.06
409	300699	光威复 材	158,980	3,947,473.40	0.06
410	002262	恩华药 业	165,200	3,921,848.00	0.06
411	600061	国投资 本	693,296	3,917,122.40	0.06
412	600546	山煤国 际	267,100	3,905,002.00	0.06
413	002850	科达利	51,100	3,903,018.00	0.06
414	300919	中伟股 份	125,900	3,901,641.00	0.06
415	600820	隧道股 份	597,400	3,901,022.00	0.06
416	301358	湖南裕 能	123,100	3,872,726.00	0.06
417	300285	国瓷材 料	216,700	3,868,095.00	0.06
418	002195	岩山科 技	1,540,300	3,866,153.00	0.06
419	600369	西南证 券	1,079,900	3,866,042.00	0.06
420	600895	张江高 科	208,823	3,859,049.04	0.06
421	600872	中炬高 新	169,500	3,845,955.00	0.06
422	002064	华峰化 学	535,100	3,836,667.00	0.06
423	000021	深科技	253,536	3,833,464.32	0.06
424	603589	口子窖	97,800	3,832,782.00	0.06
425	600021	上海电 力	385,430	3,811,902.70	0.06
426	000617	中油资 本	686,600	3,790,032.00	0.06
427	601000	唐山港	805,900	3,787,730.00	0.06
428	603087	甘李药	81,500	3,775,080.00	0.06

		业			
429	300073	当升科技	109,900	3,770,669.00	0.06
430	300146	汤臣倍健	275,000	3,726,250.00	0.06
431	601059	信达证券	262,200	3,725,862.00	0.06
432	600486	扬农化工	65,967	3,723,837.15	0.06
433	000513	丽珠集团	100,000	3,721,000.00	0.06
434	000708	中信特钢	273,600	3,712,752.00	0.06
435	600704	物产中大	847,600	3,678,584.00	0.06
436	300058	蓝色光标	674,800	3,670,912.00	0.06
437	601966	玲珑轮胎	198,700	3,650,119.00	0.06
438	600153	建发股份	407,700	3,640,761.00	0.06
439	002756	永兴材料	101,610	3,635,605.80	0.06
440	688065	凯赛生物	80,000	3,631,200.00	0.06
441	000830	鲁西化工	312,800	3,625,352.00	0.06
442	603179	新泉股份	92,300	3,621,852.00	0.06
443	300114	中航电测	80,000	3,620,000.00	0.06
444	600155	华创云信	612,000	3,616,920.00	0.06
445	300529	健帆生物	131,200	3,569,952.00	0.05
446	600118	中国卫星	160,300	3,563,469.00	0.05
447	688187	时代电气	71,647	3,537,928.86	0.05
448	002152	广电运通	337,600	3,531,296.00	0.05
449	600583	海油工程	595,800	3,521,178.00	0.05

450	601156	东航物流	172,800	3,516,480.00	0.05
451	002558	巨人网络	372,500	3,516,400.00	0.05
452	688303	大全能源	172,202	3,511,198.78	0.05
453	000591	太阳能	743,800	3,503,298.00	0.05
454	000623	吉林敖东	261,400	3,502,760.00	0.05
455	002410	广联达	362,730	3,474,953.40	0.05
456	600970	中材国际	287,500	3,467,250.00	0.05
457	002603	以岭药业	225,300	3,453,849.00	0.05
458	300373	扬杰科技	88,600	3,446,540.00	0.05
459	002385	大北农	891,600	3,432,660.00	0.05
460	300454	深信服	67,700	3,420,881.00	0.05
461	600380	健康元	304,900	3,405,733.00	0.05
462	002439	启明星辰	197,100	3,401,946.00	0.05
463	002025	航天电器	73,239	3,396,824.82	0.05
464	300144	宋城演艺	422,520	3,392,835.60	0.05
465	601216	君正集团	917,200	3,384,468.00	0.05
466	002841	视源股份	114,300	3,375,279.00	0.05
467	300442	润泽科技	140,900	3,374,555.00	0.05
468	300251	光线传媒	400,800	3,370,728.00	0.05
469	600143	金发科技	509,000	3,364,490.00	0.05
470	600282	南钢股份	675,000	3,361,500.00	0.05
471	000729	燕京啤酒	380,000	3,355,400.00	0.05
472	605358	立昂微	144,700	3,348,358.00	0.05
473	600998	九州通	685,979	3,347,577.52	0.05
474	000723	美锦能源	703,000	3,346,280.00	0.05

475	600637	东方明珠	549,130	3,338,710.40	0.05
476	000519	中兵红箭	226,800	3,327,156.00	0.05
477	300677	英科医疗	123,840	3,320,150.40	0.05
478	300383	光环新网	391,800	3,310,710.00	0.05
479	600392	盛和资源	381,600	3,289,392.00	0.05
480	300024	机器人	337,500	3,287,250.00	0.05
481	000636	风华高科	251,496	3,284,537.76	0.05
482	600516	方大炭素	759,520	3,273,531.20	0.05
483	000818	航锦科技	147,900	3,265,632.00	0.05
484	600763	通策医疗	60,400	3,264,620.00	0.05
485	002958	青农商行	1,211,500	3,246,820.00	0.05
486	688213	思特威电子科技	66,100	3,205,850.00	0.05
487	601665	齐鲁银行	651,700	3,199,847.00	0.05
488	600909	华安证券	759,670	3,198,210.70	0.05
489	002044	美年健康	843,300	3,187,674.00	0.05
490	600008	首创环保	1,186,990	3,181,133.20	0.05
491	600867	通化东宝	379,704	3,178,122.48	0.05
492	000883	湖北能源	527,400	3,169,674.00	0.05
493	300088	长信科技	672,800	3,162,160.00	0.05
494	600566	济川药业	99,207	3,145,853.97	0.05
495	601456	国联证券	325,800	3,140,712.00	0.05
496	000629	钒钛股份	1,252,700	3,131,750.00	0.05

497	603899	晨光股份	100,100	3,131,128.00	0.05
498	601016	节能风电	1,047,050	3,130,679.50	0.05
499	600511	国药股份	101,500	3,125,185.00	0.05
500	600170	上海建工	1,452,900	3,123,735.00	0.05
501	000997	新大陆	224,500	3,122,795.00	0.05
502	600582	天地科技	451,400	3,110,146.00	0.05
503	600499	科达制造	368,000	3,102,240.00	0.05
504	601933	永辉超市	1,239,400	3,073,712.00	0.05
505	600498	烽火通信	193,300	3,073,470.00	0.05
506	600535	天士力	243,900	3,068,262.00	0.05
507	600129	太极集团	105,800	3,059,736.00	0.05
508	601991	大唐发电	1,015,500	3,056,655.00	0.05
509	600580	卧龙电驱	251,100	3,050,865.00	0.05
510	002120	韵达股份	393,670	3,047,005.80	0.05
511	000750	国海证券	1,045,290	3,041,793.90	0.05
512	600004	白云机场	319,000	3,024,120.00	0.05
513	000598	兴蓉环境	402,100	3,023,792.00	0.05
514	002261	拓维信息	272,700	3,018,789.00	0.05
515	000060	中金岭南	709,900	3,009,976.00	0.05
516	300568	星源材质	366,400	3,004,480.00	0.05
517	603000	人民网	149,000	2,978,510.00	0.05
518	002430	杭氧股份	133,578	2,972,110.50	0.05
519	300118	东方日	245,600	2,971,760.00	0.05

		升			
520	300567	精测电子	52,500	2,966,775.00	0.05
521	002939	长城证券	441,800	2,960,060.00	0.05
522	688363	华熙生物	52,079	2,946,109.03	0.05
523	603486	科沃斯	62,400	2,944,032.00	0.05
524	002429	兆驰股份	610,100	2,934,581.00	0.05
525	600166	福田汽车	1,304,100	2,934,225.00	0.05
526	603228	景旺电子	91,880	2,921,784.00	0.04
527	600816	建元信托	1,071,100	2,902,681.00	0.04
528	603658	安图生物	62,950	2,900,106.50	0.04
529	600325	华发股份	445,000	2,892,500.00	0.04
530	603156	养元饮品	135,832	2,889,146.64	0.04
531	600673	东阳光	410,200	2,887,808.00	0.04
532	300765	新诺威	114,400	2,886,312.00	0.04
533	601231	环旭电子	178,800	2,869,740.00	0.04
534	000893	亚钾国际	177,100	2,861,936.00	0.04
535	603927	中科软	158,044	2,859,015.96	0.04
536	300601	康泰生物	183,120	2,858,503.20	0.04
537	002926	华西证券	430,500	2,836,995.00	0.04
538	603568	伟明环保	137,775	2,835,409.50	0.04
539	600754	锦江酒店	123,100	2,828,838.00	0.04
540	688052	纳芯微电子	27,507	2,827,169.46	0.04
541	002508	老板电器	127,800	2,824,380.00	0.04
542	601636	旗滨集团	437,500	2,821,875.00	0.04

543	300487	蓝晓科技	67,350	2,812,536.00	0.04
544	000027	深圳能源	383,500	2,799,550.00	0.04
545	603298	杭叉集团	142,500	2,798,700.00	0.04
546	300253	卫宁健康	473,600	2,794,240.00	0.04
547	000998	隆平高科	283,900	2,790,737.00	0.04
548	600737	中粮糖业	290,800	2,788,772.00	0.04
549	603290	斯达半导	32,380	2,788,241.80	0.04
550	002624	完美世界	366,150	2,782,740.00	0.04
551	600563	法拉电子	36,500	2,780,570.00	0.04
552	300604	长川科技	102,200	2,776,774.00	0.04
553	688385	复旦微电	88,450	2,775,561.00	0.04
554	002497	雅化集团	310,700	2,771,444.00	0.04
555	002056	横店东磁	222,000	2,768,340.00	0.04
556	002653	海思科	90,083	2,765,548.10	0.04
557	601866	中远海发	1,067,300	2,753,634.00	0.04
558	601808	中海油服	160,000	2,752,000.00	0.04
559	300390	天华新能	160,080	2,750,174.40	0.04
560	603077	和邦生物	1,666,200	2,749,230.00	0.04
561	002299	圣农发展	201,100	2,743,004.00	0.04
562	002500	山西证券	581,980	2,735,306.00	0.04
563	002065	东华软件	604,800	2,733,696.00	0.04
564	600131	国网信通	162,000	2,732,940.00	0.04

565	002414	高德红 外	463,611	2,730,668.79	0.04
566	300009	安科生 物	319,740	2,730,579.60	0.04
567	603893	瑞芯微	46,100	2,727,737.00	0.04
568	600732	爱旭股 份	300,180	2,716,629.00	0.04
569	601958	金钼股 份	260,800	2,714,928.00	0.04
570	688114	华大智 造	57,219	2,712,752.79	0.04
571	688002	睿创微 纳	96,935	2,711,271.95	0.04
572	600373	中文传 媒	182,700	2,711,268.00	0.04
573	688772	珠海冠 宇电池	181,387	2,702,666.30	0.04
574	600655	豫园股 份	522,500	2,690,875.00	0.04
575	002372	伟星新 材	174,500	2,690,790.00	0.04
576	300763	锦浪科 技	64,600	2,689,944.00	0.04
577	002368	太极股 份	118,599	2,674,407.45	0.04
578	601611	中国核 建	330,100	2,670,509.00	0.04
579	002507	涪陵榨 菜	217,920	2,669,520.00	0.04
580	603833	欧派家 居	49,820	2,668,359.20	0.04
581	600707	彩虹股 份	389,700	2,653,857.00	0.04
582	603885	吉祥航 空	240,800	2,646,392.00	0.04
583	000887	中鼎股 份	215,300	2,635,272.00	0.04
584	688390	固德威 电源	46,386	2,603,182.32	0.04
585	600755	厦门国 贸	361,300	2,590,521.00	0.04
586	603225	新凤鸣	165,800	2,584,822.00	0.04
587	002203	海亮股	323,200	2,579,136.00	0.04

		份			
588	688521	芯原微电子	96,026	2,568,695.50	0.04
589	603379	三美股份	65,600	2,567,584.00	0.04
590	002831	裕同科技	100,200	2,564,118.00	0.04
591	300979	华利集团	41,600	2,531,360.00	0.04
592	600995	南网储能	261,500	2,526,090.00	0.04
593	600801	华新水泥	183,000	2,516,250.00	0.04
594	600859	王府井	214,272	2,515,553.28	0.04
595	600416	湘电股份	252,700	2,511,838.00	0.04
596	600390	五矿资本	616,600	2,497,230.00	0.04
597	601880	辽港股份	2,030,000	2,496,900.00	0.04
598	300070	碧水源	595,900	2,496,821.00	0.04
599	600884	杉杉股份	307,300	2,495,276.00	0.04
600	002683	广东宏大	123,900	2,494,107.00	0.04
601	600329	达仁堂	76,600	2,481,074.00	0.04
602	601236	红塔证券	386,460	2,481,073.20	0.04
603	300296	利亚德	550,200	2,475,900.00	0.04
604	002244	滨江集团	339,600	2,465,496.00	0.04
605	002019	亿帆医药	198,400	2,452,224.00	0.04
606	002506	协鑫集成	1,261,400	2,447,116.00	0.04
607	600739	辽宁成大	292,300	2,446,551.00	0.04
608	000050	深天马A	336,000	2,446,080.00	0.04
609	600435	北方导航	283,100	2,440,322.00	0.04
610	601098	中南传媒	195,900	2,433,078.00	0.04

611	600483	福能股份	207,300	2,417,118.00	0.04
612	601698	中国卫通	170,800	2,406,572.00	0.04
613	300748	金力永磁	185,160	2,399,673.60	0.04
614	000155	川能动力	222,800	2,399,556.00	0.04
615	300803	指南针	65,900	2,399,419.00	0.04
616	600598	北大荒	191,800	2,395,582.00	0.04
617	600399	抚顺特钢	425,200	2,393,876.00	0.04
618	601598	中国外运	424,900	2,392,187.00	0.04
619	002572	索菲亚	155,700	2,386,881.00	0.04
620	300676	华大基因	68,100	2,384,181.00	0.04
621	002568	百润股份	141,400	2,379,762.00	0.04
622	600901	江苏金租	471,180	2,379,459.00	0.04
623	002240	盛新锂能	177,000	2,375,340.00	0.04
624	600848	上海临港	260,300	2,371,333.00	0.04
625	002487	大金重工	103,000	2,356,640.00	0.04
626	002080	中材科技	181,000	2,334,900.00	0.04
627	002373	千方科技	257,100	2,331,897.00	0.04
628	002557	洽洽食品	82,549	2,327,056.31	0.04
629	001286	陕西能源	201,400	2,322,142.00	0.04
630	002936	郑州银行	1,333,997	2,307,814.81	0.04
631	000563	陕国投A	838,600	2,306,150.00	0.04
632	601928	凤凰传媒	208,900	2,289,544.00	0.04
633	603858	步长制药	150,600	2,281,590.00	0.04

634	603883	老百姓	123,885	2,274,528.60	0.03
635	002268	电科网安	159,600	2,271,108.00	0.03
636	688301	奕瑞科技股份	19,684	2,268,187.32	0.03
637	688017	绿的谐波	27,600	2,265,960.00	0.03
638	603712	七一二	124,400	2,262,836.00	0.03
639	300595	欧普康视	144,160	2,260,428.80	0.03
640	600258	首旅酒店	183,000	2,260,050.00	0.03
641	600968	海油发展	547,800	2,256,936.00	0.03
642	000778	新兴铸管	645,400	2,245,992.00	0.03
643	600062	华润双鹤	113,700	2,226,246.00	0.03
644	600528	中铁工业	303,600	2,222,352.00	0.03
645	601212	白银有色	798,900	2,220,942.00	0.03
646	688538	和辉光电	1,120,515	2,218,619.70	0.03
647	300957	贝泰妮	45,800	2,213,056.00	0.03
648	600271	航天信息	299,600	2,205,056.00	0.03
649	000709	河钢股份	1,132,700	2,197,438.00	0.03
650	300558	贝达药业	67,500	2,197,125.00	0.03
651	601155	新城控股	247,600	2,196,212.00	0.03
652	603688	石英股份	73,900	2,188,179.00	0.03
653	688234	天岳先进	46,468	2,180,278.56	0.03
654	000739	普洛药业	160,600	2,179,342.00	0.03
655	002408	齐翔腾达	389,080	2,178,848.00	0.03
656	600977	中国电影	201,500	2,168,140.00	0.03

657	688220	翱捷科技	57,815	2,165,749.90	0.03
658	002531	天顺风能	241,800	2,161,692.00	0.03
659	688005	容百科技	92,846	2,161,454.88	0.03
660	688536	思瑞浦股份	21,930	2,144,973.30	0.03
661	600959	江苏有线	808,800	2,135,232.00	0.03
662	603737	三棵树	58,180	2,110,188.60	0.03
663	600378	昊华科技	72,900	2,106,810.00	0.03
664	601118	海南橡胶	461,400	2,099,370.00	0.03
665	000825	太钢不锈	619,700	2,094,586.00	0.03
666	688331	荣昌生物	48,475	2,094,120.00	0.03
667	603444	吉比特	11,700	2,082,717.00	0.03
668	600056	中国医药	204,467	2,069,206.04	0.03
669	603882	金域医学	75,600	2,055,564.00	0.03
670	000987	越秀资本	411,005	2,038,584.80	0.03
671	600612	老凤祥	34,700	2,019,193.00	0.03
672	688200	华峰测控	21,955	2,014,371.25	0.03
673	601399	国机重装	778,200	2,007,756.00	0.03
674	600906	财达证券	350,000	2,005,500.00	0.03
675	300212	易华录	119,020	2,003,106.60	0.03
676	600517	国网英大	462,400	2,002,192.00	0.03
677	601019	山东出版	168,900	1,996,398.00	0.03
678	002266	浙富控股	711,200	1,984,248.00	0.03
679	603456	九洲药业	144,200	1,978,424.00	0.03
680	000800	一汽解	249,800	1,955,934.00	0.03

		放			
681	600316	洪都航空	117,400	1,952,362.00	0.03
682	000937	冀中能源	288,600	1,933,620.00	0.03
683	603650	彤程新材	65,400	1,932,570.00	0.03
684	603529	爱玛科技	70,500	1,926,765.00	0.03
685	600871	石化油服	1,086,000	1,889,640.00	0.03
686	002423	中粮资本	251,900	1,886,731.00	0.03
687	688567	孚能科技	195,845	1,880,112.00	0.03
688	600925	苏能股份	371,600	1,876,580.00	0.03
689	000032	深桑达A	124,400	1,863,512.00	0.03
690	603728	鸣志电器	46,200	1,858,626.00	0.03
691	600098	广州发展	290,000	1,856,000.00	0.03
692	601965	中国汽研	109,600	1,851,144.00	0.03
693	001227	兰州银行	775,100	1,844,738.00	0.03
694	601298	青岛港	192,800	1,843,168.00	0.03
695	600208	新潮中宝	1,163,900	1,838,962.00	0.03
696	601608	中信重工	478,200	1,821,942.00	0.03
697	002607	中公教育	1,179,300	1,804,329.00	0.03
698	600578	京能电力	548,500	1,777,140.00	0.03
699	688561	奇安信集团	75,149	1,775,019.38	0.03
700	600663	陆家嘴	200,200	1,765,764.00	0.03
701	688516	奥特维科技	42,203	1,764,507.43	0.03
702	600022	山东钢铁	1,441,800	1,758,996.00	0.03

703	002670	国盛金控	207,300	1,755,831.00	0.03
704	603233	大参林	122,720	1,754,896.00	0.03
705	300357	我武生物	85,600	1,730,832.00	0.03
706	300438	鹏辉能源	93,700	1,718,458.00	0.03
707	601106	中国一重	743,394	1,717,240.14	0.03
708	600500	中化国际	489,944	1,709,904.56	0.03
709	600377	宁沪高速	135,700	1,709,820.00	0.03
710	002865	钧达股份	43,200	1,658,016.00	0.03
711	600315	上海家化	92,700	1,648,206.00	0.03
712	000785	居然之家	677,100	1,645,353.00	0.03
713	600967	内蒙一机	226,800	1,632,960.00	0.03
714	688349	三一重能	65,204	1,619,667.36	0.02
715	600350	山东高速	182,700	1,616,895.00	0.02
716	000537	中绿电	169,500	1,615,335.00	0.02
717	688425	铁建重工	438,500	1,613,680.00	0.02
718	000958	电投产融	438,500	1,604,910.00	0.02
719	300888	稳健医疗	63,280	1,600,984.00	0.02
720	000156	华数传媒	254,600	1,598,888.00	0.02
721	002690	美亚光电	96,762	1,596,573.00	0.02
722	000559	万向钱潮	356,300	1,589,098.00	0.02
723	601568	北元集团	428,240	1,588,770.40	0.02
724	002867	周大生	121,100	1,581,566.00	0.02
725	002608	江苏国信	203,800	1,579,450.00	0.02

726	600827	百联股份	214,000	1,579,320.00	0.02
727	601992	金隅集团	1,152,020	1,578,267.40	0.02
728	603707	健友股份	132,627	1,575,608.76	0.02
729	603517	绝味食品	100,100	1,541,540.00	0.02
730	300682	朗新集团	178,400	1,518,184.00	0.02
731	003022	联泓新科	109,900	1,506,729.00	0.02
732	600126	杭钢股份	366,600	1,506,726.00	0.02
733	000967	盈峰环境	350,900	1,484,307.00	0.02
734	600032	浙江新能	197,500	1,437,800.00	0.02
735	600339	中油工程	460,400	1,436,448.00	0.02
736	301267	华夏眼科	69,000	1,429,680.00	0.02
737	600361	创新新材	350,900	1,414,127.00	0.02
738	600481	双良节能	302,500	1,412,675.00	0.02
739	603218	日月股份	137,200	1,409,044.00	0.02
740	603127	昭衍新药	104,624	1,388,360.48	0.02
741	000898	鞍钢股份	654,200	1,386,904.00	0.02
742	600095	湘财股份	230,600	1,374,376.00	0.02
743	603296	华勤技术	24,700	1,364,181.00	0.02
744	003035	南网能源	306,200	1,347,280.00	0.02
745	600808	马钢股份	662,600	1,338,452.00	0.02
746	002153	石基信息	227,557	1,303,901.61	0.02
747	002563	森马服饰	218,000	1,266,580.00	0.02

748	603185	弘元绿能	73,262	1,252,047.58	0.02
749	000539	粤电力 A	242,500	1,231,900.00	0.02
750	001872	招商港口	63,800	1,228,150.00	0.02
751	601228	广州港	399,900	1,219,695.00	0.02
752	688779	长远锂科	259,849	1,203,100.87	0.02
753	000401	冀东水泥	293,600	1,192,016.00	0.02
754	600928	西安银行	359,500	1,175,565.00	0.02
755	001203	大中矿业	120,100	1,154,161.00	0.02
756	000959	首钢股份	420,400	1,143,488.00	0.02
757	002518	科士达	64,200	1,136,340.00	0.02
758	600764	中国海防	57,500	1,128,725.00	0.02
759	603056	德邦股份	82,700	1,083,370.00	0.02
760	603305	旭升集团	102,100	1,078,176.00	0.02
761	688172	燕东微电子股份	64,800	1,048,464.00	0.02
762	601139	深圳燃气	155,700	1,040,076.00	0.02
763	600299	安迪苏	105,900	1,027,230.00	0.02
764	603317	天味食品	87,800	1,001,798.00	0.02
765	688387	中信科移动	190,300	959,112.00	0.01
766	600927	永安期货	78,300	873,045.00	0.01
767	000031	大悦城	350,000	819,000.00	0.01
768	601158	重庆水务	160,800	771,840.00	0.01
769	002945	华林证券	75,200	750,496.00	0.01
770	601828	美凯龙	292,100	744,855.00	0.01
771	600956	新天绿	79,200	647,064.00	0.01

		能			
--	--	---	--	--	--

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	400174	中天 3	371,600	3,716.00	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	300750	宁德时代	40,017,820.98	0.56
2	000333	美的集团	25,546,822.00	0.36
3	002371	北方华创	20,848,181.40	0.29
4	600900	长江电力	19,984,183.00	0.28
5	000858	五粮液	19,708,889.00	0.27
6	002594	比亚迪	19,470,456.83	0.27
7	000651	格力电器	13,444,056.00	0.19
8	300760	迈瑞医疗	12,941,063.00	0.18
9	300059	东方财富	12,549,461.00	0.17
10	002475	立讯精密	12,220,406.00	0.17
11	000725	京东方 A	11,573,230.00	0.16
12	300124	汇川技术	10,770,571.00	0.15
13	002415	海康威视	10,367,293.00	0.14
14	002714	牧原股份	9,115,843.60	0.13
15	601998	中信银行	8,565,777.00	0.12
16	600519	贵州茅台	8,511,105.00	0.12
17	000807	云铝股份	8,446,032.00	0.12
18	300274	阳光电源	8,358,597.00	0.12
19	000568	泸州老窖	8,099,651.00	0.11
20	300498	温氏股份	7,781,809.00	0.11

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	53,035,817.76	0.74
2	000333	美的集团	35,316,288.37	0.49
3	000858	五粮液	28,332,281.05	0.39
4	002594	比亚迪	24,803,092.70	0.34
5	000651	格力电器	18,726,584.00	0.26
6	300124	汇川技术	18,532,399.90	0.26
7	300760	迈瑞医疗	18,291,967.30	0.25
8	002371	北方华创	18,003,586.76	0.25
9	300059	东方财富	17,777,095.80	0.25
10	000725	京东方 A	16,669,571.00	0.23
11	002463	沪电股份	16,483,702.90	0.23
12	002475	立讯精密	16,173,661.42	0.22
13	600519	贵州茅台	15,841,420.00	0.22
14	002422	科伦药业	14,531,898.85	0.20
15	002415	海康威视	14,046,974.00	0.20
16	002142	宁波银行	13,111,305.00	0.18
17	002714	牧原股份	12,378,527.94	0.17
18	000568	泸州老窖	12,183,597.08	0.17
19	000975	银泰黄金	11,916,111.00	0.17
20	300274	阳光电源	11,446,961.45	0.16

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	1,211,633,814.09
卖出股票收入（成交）总额	1,431,375,417.42

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	298,022.21	0.00
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	298,022.21	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113685	升 24 转债	2,980	298,022.21	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公

司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,565,071.32
2	应收清算款	56,567,084.60
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	71,132,155.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	400174	中天3	3,716.00	0.00	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		平安银行股份有限公司-汇添富中证 800 交易型开放式 指数证券投资基金 联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%))	持有份额	占总 份额 比例 (%))	持有份额	占总 份额 比例 (%))
5,520	1,347,860.00	7,193,557,230.00	96.69	246,629,968.00	3.31	87,240,200.00	1.17

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中央汇金资产管理有限责任公司	1,307,627,911.00	17.58
2	中国人寿保险股份有限公司	877,596,353.00	11.80
3	汇添富基金-中国人寿保险股份有限公司-分红险-汇添富基金国寿股份成长股票型组合	659,228,700.00	8.86
4	汇添富基金-中国人寿保险股份有限公司-传统险-汇添富国寿股份成长股票传统可供出	536,315,000.00	7.21
5	中国平安人寿保险股份有限公司-自有资金	445,183,900.00	5.98
6	中国平安人寿保险股份有限公司-分红一个险分	328,684,400.00	4.42

	红		
7	大家人寿保险股份有限公司—传统产品	299,683,679.00	4.03
8	北京诚通金控投资有限公司	263,800,800.00	3.55
9	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—传统险—汇添富国寿股份均衡股票传统可供出	263,344,800.00	3.54
10	友邦人寿保险股份有限公司—传统	239,271,500.00	3.22
11	平安银行股份有限公司—汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	87,240,200.00	1.17

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	200,000.00	0.00

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（2019 年 10 月 08 日）基金份额总额	6,601,437,198.00
本报告期期初基金份额总额	8,166,937,198.00
本报告期基金总申购份额	1,966,500,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	2,693,250,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,440,187,198.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及本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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情

况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	1	1,657,402,972.29	62.71	556,735.66	50.12	
海通证券	2	856,037,874.98	32.39	458,763.27	41.30	
华泰证券	2	129,568,384.24	4.90	95,352.43	8.58	
东方证券	2	-	-	-	-	
广发证券	2	-	-	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	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 (%)
中	-	-	-	-	-	-	-	-

泰 证 券								
海 通 证 券	137,789.92	29.79	53,000,000.00	100.00	-	-	-	-
华 泰 证 券	324,772.51	70.21	-	-	-	-	-	-
东 方 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广 发 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴 业 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中 信 建 投 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中 信 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：

本基金本报告期内退租 1 家证券公司的 2 个交易单元：兴业证券（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
5	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
6	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
7	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

8	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
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关于旗下部分基金增加财达证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 03 日
12	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 07 日
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
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东方财富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 06 月 18 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加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 06 月 19 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、中国证监会批准中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 800 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、报告期内中证 800 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 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