

汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券 投资基金 2025 年中期报告

2025 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：广发证券股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 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 2025 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.....	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.....	14
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.....	15
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.....	15
§ 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	20
§ 7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§ 8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§ 9 开放式基金份额变动.....	54
§ 10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§ 12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证 800 价值 ETF
场内简称	800 价值
基金主代码	560030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 06 月 20 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	24,432,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 07 月 10 日

注：扩位证券简称：800 价值 ETF。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金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，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略及存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	中证 800 价值指数收益率
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	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	罗琦
	联系电话	021-28932888	020-66338888
	电子邮箱	service@99fund.com	gzluoqi@gf.com.cn

客户服务电话	400-888-9918	95575
传真	021-28932998	020-87553363-6847
注册地址	上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码	200010	510627
法定代表人	鲁伟铭	林传辉

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	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(2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	1,623,282.75
本期利润	487,379.41
加权平均基金份额本期利润	0.0165
本期加权平均净值利润率	1.41%
本期基金份额净值增长率	2.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	5,532,520.27
期末可供分配基金份额利润	0.2264
期末基金资产净值	29,964,520.27
期末基金份额净值	1.2264
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	22.64%
-------------	--------

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	3.22%	0.56%	2.06%	0.56%	1.16%	0.00%
过去三个月	4.44%	1.02%	3.04%	1.03%	1.40%	-0.01%
过去六个月	2.38%	0.90%	0.84%	0.90%	1.54%	0.00%
过去一年	15.97%	1.18%	11.99%	1.19%	3.98%	-0.01%
自基金合同生效起至今	22.64%	1.00%	14.00%	1.01%	8.64%	-0.01%

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800价值ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023 年 06 月 20 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。

2025 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 363 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		
晏阳	本基金的基金经理	2023 年 06 月 20 日	—	9	国籍：中国。学历：哥伦比亚大学统计学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 9 月至 2021 年 8 月任中证指数有限公司研究员、高级研究员。2021 年 9 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。2022 年 7 月 13 日至今任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 A100 交易型开放式指数证券投

					资基金的基金经 理。2022 年 12 月 27 日至今任 汇添富北证 50 成份指数型证券 投资基金的基金 经理。2023 年 1 月 16 日至 2024 年 4 月 8 日任汇 添富中证细分有 色金属产业主题 交易型开放式指 数证券投资基金 的基金经理。 2023 年 3 月 14 日至今任汇添富 中证上海环交所 碳中和交易型开 放式指数证券投 资基金发起式联 接基金的基金经 理。2023 年 4 月 13 日至今任 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。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任汇添富中证 港股通高股息投 资指数发起式证 券投资基金 (LOF) 的基金 经理。2023 年 5 月 22 日至 2025 年 5 月 16 日任 深证 300 交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2023 年 5 月 22 日至今任 中证银行交易型 开放式指数证券
--	--	--	--	--	--

					投资基金的基金经理。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 20 日至今任汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月 11 日至 2025 年 1 月 22 日任汇添富华证专精特新 100 指数型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 26 日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 21 日至今任汇添富中证 800 价值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。2023 年 11 月 28 日至 2025 年 3 月 21 日任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 12 月 5 日至今任汇添富中证电信主
--	--	--	--	--	--

					题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2024 年 2 月 2 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联接基金的基金经理。 2024 年 4 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 5 月 31 日至今任汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月 12 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。 2025 年 5 月 13 日至今任汇添富国证自由现金流指数型证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月 4 日至今任汇添富中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

决议确定的解聘日期。

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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,力争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 4 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

今年上半年,国民经济运行总体平稳、稳中向好。初步核算,上半年国内生产总值约 66 万亿元,同比增长 5.3%,其中一季度同比增长 5.4%,二季度增长 5.2%。生产端,上半年全国规模以上工业增加值同比增长 6.4%,装备制造业和高技术制造业增势良好;投资端,上半年全国固定资产投资(不含农户)同比增长 2.8%,其中基础设施投资同比增长 4.6%,制造业投资增长 7.5%,房地产开发投资下降 11.2%;消费端,上半年社会消费品零售总额同比增长 5.0%,消费升级类商品销售形势较好。此外,上半年居民消费价格基本平稳,核心 CPI 温和回升,居民收入平稳增长,就业形势总体稳定。总体来看,随着宏观政策发力显效,上半年经济运行延续稳中向好发展态势,展现出强大韧性和活力;但与此同时,外部不确定因素依然较多,国内有效需求依然不足,经济回升向好基础仍需加力巩固。

资本市场方面,上半年 A 股在震荡中前行,核心指数温和上涨,市场活跃度提升。分阶段看,年初大幅下行后一季度市场以企稳回升为主;4 月初受美国关税政策冲击市场大幅调整,但随着政策密集发力和关税前景改善,市场逐步修复;6 月中东地缘冲突再次引发市场波动,随着地缘风险缓解叠加金融政策利好,市场迅速恢复上行态势。分行业来看,上半年有色金属、银行、国防军工涨幅居前;煤炭、食品饮料、房地产表现靠后。风格方面,小微盘表现突出,价值优于成长。

本基金跟踪中证 800 价值指数,主要投资于中证 800 指数样本中价值风格的股票。报告期内,本基金按照被动投资的原则,采用完全复制法,实现了对标的指数的良好跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 2.38%。同期业绩比较基准收益率为 0.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,中国经济机遇与挑战并存。财政政策方面,储备工具充足,或将重点投向

城市更新、支持消费和育儿补贴等方向；货币政策方面，年内仍有降准降息的空间，或根据国内外形势相机抉择；房地产政策方面，更大力度推动房地产市场止跌回稳的措施将逐步落实，房地产市场或已进入筑底阶段。但仍需关注关税政策反复、地产进一步走弱等风险。

资本市场方面，从整体上看，当前市场成交活跃，宽基指数估值水平合理，企业盈利修复过程中 A 股整体仍有较好配置价值；从风格上看，年初至今价值、红利风格估值提升更为平稳，相较小微盘和成长板块具有更高安全边际；从行业主题上看，一方面银行等高股息板块仍值得作为底仓配置，另一方面科技创新、新兴消费领域或有结构性机会。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法严格控制偏离，实现对标的指数的紧密跟踪。

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：《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。因前述迷

你基金情形，自 2025 年 1 月 15 日起，基金管理人自主承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，汇添富基金管理股份有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何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

本基金托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	321,943.98	283,980.00
结算备付金		2,209.44	2,194.40
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	29,659,711.25	39,881,051.99

其中：股票投资		29,659,711.25	39,881,051.99
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		29,983,864.67	40,167,226.39
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 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		-	35,100.35
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,736.28	17,010.37
应付托管费		2,547.24	3,402.06
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	4,060.88	65,000.00
负债合计		19,344.40	120,512.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	24,432,000.00	33,432,000.00
未分配利润	6.4.7.9	5,532,520.27	6,614,713.61
净资产合计		29,964,520.27	40,046,713.61
负债和净资产总计		29,983,864.67	40,167,226.39

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2264 元，基金份额总额 24,432,000.00

份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		593,103.78	6,288,596.24
1. 利息收入		624.42	1,848.17
其中：存款利息收入	6.4.7.10	624.42	1,848.17
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）		1,718,851.83	1,558,282.04
其中：股票投资收益	6.4.7.11	1,138,361.86	1,078,189.99
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	824.33	-
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	579,665.64	480,092.05
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	-1,135,903.34	4,699,133.70
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	9,530.87	29,332.33
减：二、营业总支出		105,724.37	193,346.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	86,025.96	119,683.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,205.15	23,936.70
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	2,493.26	49,726.04
三、利润总额（亏损总额以“-”		487,379.41	6,095,249.77

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		487,379.41	6,095,249.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		487,379.41	6,095,249.77

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	33,432,000.00	6,614,713.61	40,046,713.61
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	33,432,000.00	6,614,713.61	40,046,713.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,000,000.00	-1,082,193.34	-10,082,193.34
（一）、综合收益总额	-	487,379.41	487,379.41
（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）	-9,000,000.00	-1,569,572.75	-10,569,572.75
其中：1. 基金申购款	4,000,000.00	698,852.95	4,698,852.95
2. 基金赎回款	-13,000,000.00	-2,268,425.70	-15,268,425.70
（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	24,432,000.00	5,532,520.27	29,964,520.27

项目	上年度可比期间		
	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	61,432,000.00	-3,088,114.66	58,343,885.34
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	61,432,000.00	-3,088,114.66	58,343,885.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,000,000.00	5,928,701.12	-6,071,298.88
（一）、综合收益总额	-	6,095,249.77	6,095,249.77
（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）	-12,000,000.00	-166,548.65	-12,166,548.65
其中：1. 基金申购款	28,000,000.00	832,108.31	28,832,108.31
2. 基金赎回款	-40,000,000.00	-998,656.96	-40,998,656.96
（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	49,432,000.00	2,840,586.46	52,272,586.46

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：

张晖
基金管理人负责人

李骁
主管会计工作负责人

雷青松
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 800 价值交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国

证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]430 号文《关于准予汇添富中证 800 价值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。经向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 6 月 20 日生效。首次设立基金募集规模为 475,432,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 60466941_B34 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

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、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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 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。

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征增值税试点的通知》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[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[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 2025 年 06 月 30 日
活期存款	17,349.05
等于：本金	17,333.32
加：应计利息	15.73
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	304,594.93
等于：本金	304,577.93
加：应计利息	17.00
减：坏账准备	-
合计	321,943.98

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	27,198,556.20	-	29,659,711.25	2,461,155.05
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	27,198,556.20	-	29,659,711.25	2,461,155.05

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 2025 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	575.40
应付信息披露费	1,917.86
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	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	1,567.62
合计	4,060.88

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,432,000.00	33,432,000.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-13,000,000.00	-13,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调	-	-

整		
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	24,432,000.00	24,432,000.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,883,106.93	-268,393.32	6,614,713.61
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	6,883,106.93	-268,393.32	6,614,713.61
本期利润	1,623,282.75	-1,135,903.34	487,379.41
本期基金份额交易产生的变动数	-2,041,982.80	472,410.05	-1,569,572.75
其中：基金申购款	906,264.91	-207,411.96	698,852.95
基金赎回款	-2,948,247.71	679,822.01	-2,268,425.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,464,406.88	-931,886.61	5,532,520.27

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	274.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	334.90
结算备付金利息收入	15.04
其他	-
合计	624.42

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	380,375.99
股票投资收益——赎回差价收入	757,985.87
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	1,138,361.86

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	9,892,397.59
减：卖出股票成本总额	9,503,099.50
减：交易费用	8,922.10
买卖股票差价收入	380,375.99

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	15,268,425.70
减：现金支付赎回款总额	3,807,187.70
减：赎回股票成本总额	10,703,252.13
减：交易费用	-
赎回差价收入	757,985.87

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.64
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	823.69
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	824.33

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,124.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,300.00
减：应计利息总额	0.64
减：交易费用	0.57
买卖债券差价收入	823.69

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	579,665.64
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	579,665.64

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,135,903.34

——股票投资	-1,135,903.34
——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	-1,135,903.34

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	9,530.87
其他	-
合计	9,530.87

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	575.40
信息披露费	1,917.86
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	-
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
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	-
合计	2,493.26

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

本报告期内未发生与本基金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。

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
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	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 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	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

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股票交易。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	86,025.96	119,683.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,724.93	4,958.98
应支付基金管理人的净管理费	71,301.03	114,724.75

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

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至
----	-------------------------	------------------------------

	2025 年 06 月 30 日	2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,205.15	23,936.70

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
------	----------------------	-----------------------

称	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（%）
广发证券 股份有限 公司	2,103,100.00	8.61	4,118,900.00	12.32
汇添富中 证 800 价 值交易型 开放式指 数证券投 资基金发 起式联接 基金	13,753,800.00	56.29	15,117,700.00	45.22

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

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 14,300.00 股，占本基金净值比例为 0.46%。持有基金托管人广发证券发行的股票 8,000.00 股，占本基金净值比例为 0.45%。（于上期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 28,400.00 股，占本基金净值比例为 0.41%。持有基金托管人广发证券发行的股票 15,500.00 股，占本基金净值比例为 0.36%。）

本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分固定费用，如审计费等。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2025 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 2025 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 2025 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 2025 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 2025 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	321,943.98	-	-	-	-	-	321,943.98
结算 备付 金	2,209.44	-	-	-	-	-	2,209.44
存出 保证 金	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	29,659,711.25	29,659,711.25
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税资	-	-	-	-	-	-	-

产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	324,153.42	-	-	-	-	29,659,711.25	29,983,864.67
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,736.28	12,736.28
应付托管费	-	-	-	-	-	2,547.24	2,547.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	-	-

利润							
递延 所得 税负 债	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	4,060.88	4,060.88
负债 总计	-	-	-	-	-	19,344.40	19,344.40
利率 敏感 度缺 口	324,153.42	-	-	-	-	29,640,366.85	29,964,520.27
上年 度末 2024 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	283,980.00	-	-	-	-	-	283,980.00
结算 备付 金	2,194.40	-	-	-	-	-	2,194.40
存出 保证 金	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	39,881,051.99	39,881,051.99
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	286,174.40	-	-	-	-	39,881,051.99	40,167,226.39
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	-	-	-	-	-	35,100.35	35,100.35
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,010.37	17,010.37
应付托管费	-	-	-	-	-	3,402.06	3,402.06
应付销售服务	-	-	-	-	-	-	-

费							
应付 投资 顾问 费	-	-	-	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税负 债	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	65,000.00	65,000.00
负债 总计	-	-	-	-	-	120,512.78	120,512.78
利率 敏感 度缺 口	286,174.40	-	-	-	-	39,760,539.21	40,046,713.61

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 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 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	29,659,711.25	98.98	39,881,051.99	99.59
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	29,659,711.25	98.98	39,881,051.99	99.59

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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证 800 价值上涨 5%	1,490,049.17	1,987,152.93
	中证 800 价值下跌 5%	-1,490,049.17	-1,987,152.93

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 2025 年 06 月 30 日
第一层次	29,659,711.25
第二层次	—
第三层次	—
合计	29,659,711.25

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-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	29,659,711.25	98.92
	其中：股票	29,659,711.25	98.92
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	324,153.42	1.08
8	其他各项资产	—	—
9	合计	29,983,864.67	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	—	—
B	采矿业	1,776,841.50	5.93
C	制造业	7,865,329.06	26.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,266,733.00	4.23
E	建筑业	1,169,159.64	3.90
F	批发和零售业	237,054.06	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	785,263.00	2.62
H	住宿和餐饮业	25,434.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	901,505.00	3.01
J	金融业	14,847,685.99	49.55
K	房地产业	388,837.00	1.30
L	租赁和商务服务业	310,560.00	1.04
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	85,309.00	0.28
S	综合	—	—

	合计	29,659,711.25	98.98
--	----	---------------	-------

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	601318	中国平安	29,300	1,625,564.00	5.42
2	600036	招商银行	33,800	1,553,110.00	5.18
3	601166	兴业银行	45,300	1,057,302.00	3.53
4	000333	美的集团	13,400	967,480.00	3.23
5	600030	中信证券	26,600	734,692.00	2.45
6	601398	工商银行	95,600	725,604.00	2.42
7	601211	国泰海通	30,844	590,971.04	1.97
8	601328	交通银行	72,700	581,600.00	1.94
9	000651	格力电器	12,200	548,024.00	1.83
10	601288	农业银行	87,100	512,148.00	1.71
11	600887	伊利股份	17,300	482,324.00	1.61
12	600919	江苏银行	40,000	477,600.00	1.59
13	600000	浦发银行	32,000	444,160.00	1.48
14	000725	京东方 A	100,200	399,798.00	1.33
15	601088	中国神华	9,000	364,860.00	1.22
16	601601	中国太保	9,300	348,843.00	1.16
17	601728	中国电信	42,300	327,825.00	1.09
18	601668	中国建筑	56,300	324,851.00	1.08
19	600016	民生银行	67,700	321,575.00	1.07
20	000001	平安银行	26,419	318,877.33	1.06
21	601229	上海银行	27,100	287,531.00	0.96
22	000063	中兴通讯	8,800	285,912.00	0.95
23	600941	中国移动	2,500	281,375.00	0.94
24	601169	北京银行	40,300	275,249.00	0.92

25	601857	中国石油	30,900	264,195.00	0.88
26	601919	中远海控	17,200	258,688.00	0.86
27	601688	华泰证券	13,900	247,559.00	0.83
28	002142	宁波银行	9,000	246,240.00	0.82
29	601766	中国中车	33,200	233,728.00	0.78
30	600050	中国联通	42,600	227,484.00	0.76
31	000338	潍柴动力	14,780	227,316.40	0.76
32	600028	中国石化	39,800	224,472.00	0.75
33	000100	TCL 科技	51,200	221,696.00	0.74
34	601988	中国银行	39,000	219,180.00	0.73
35	601006	大秦铁路	32,945	217,437.00	0.73
36	600926	杭州银行	12,500	210,250.00	0.70
37	601818	光大银行	50,600	209,990.00	0.70
38	601985	中国核电	22,400	208,768.00	0.70
39	601225	陕西煤业	10,600	203,944.00	0.68
40	600104	上汽集团	12,600	202,230.00	0.67
41	002027	分众传媒	27,500	200,750.00	0.67
42	601009	南京银行	16,000	185,920.00	0.62
43	601628	中国人寿	4,500	185,355.00	0.62
44	600999	招商证券	10,100	177,659.00	0.59
45	000425	徐工机械	22,400	174,048.00	0.58
46	601939	建设银行	18,300	172,752.00	0.58
47	600938	中国海油	6,500	169,715.00	0.57
48	601658	邮储银行	30,100	164,647.00	0.55
49	600089	特变电工	13,790	164,514.70	0.55
50	600048	保利发展	19,600	158,760.00	0.53
51	600019	宝钢股份	23,900	157,501.00	0.53
52	601390	中国中铁	28,014	157,158.54	0.52
53	601825	沪农商行	15,800	153,260.00	0.51
54	601600	中国铝业	21,600	152,064.00	0.51
55	600585	海螺水泥	6,582	141,315.54	0.47
56	601916	浙商银行	41,100	139,329.00	0.46
57	601838	成都银行	6,900	138,690.00	0.46
58	600958	东方证券	14,300	138,424.00	0.46
59	600015	华夏银行	17,400	137,634.00	0.46
60	603799	华友钴业	3,700	136,974.00	0.46
61	601336	新华保险	2,300	134,550.00	0.45
62	000776	广发证券	8,000	134,480.00	0.45
63	601998	中信银行	14,500	123,250.00	0.41
64	601077	渝农商行	16,900	120,666.00	0.40
65	600795	国电电力	24,300	117,612.00	0.39
66	601377	兴业证券	18,900	116,991.00	0.39
67	601669	中国电建	23,500	114,445.00	0.38

68	002966	苏州银行	12,200	107,116.00	0.36
69	002304	洋河股份	1,600	103,280.00	0.34
70	601881	中国银河	5,900	101,185.00	0.34
71	601186	中国铁建	12,500	100,125.00	0.33
72	000157	中联重科	13,500	97,605.00	0.33
73	600886	国投电力	6,500	95,810.00	0.32
74	601788	光大证券	5,300	95,294.00	0.32
75	601555	东吴证券	10,869	95,103.75	0.32
76	000807	云铝股份	5,700	91,086.00	0.30
77	002736	国信证券	7,900	91,008.00	0.30
78	600066	宇通客车	3,600	89,496.00	0.30
79	600426	华鲁恒升	4,100	88,847.00	0.30
80	001979	招商蛇口	9,900	86,823.00	0.29
81	601800	中国交建	9,700	86,233.00	0.29
82	002236	大华股份	5,400	85,752.00	0.29
83	600011	华能国际	12,000	85,680.00	0.29
84	600346	恒力石化	5,800	82,708.00	0.28
85	600157	永泰能源	60,500	81,070.00	0.27
86	002648	卫星化学	4,600	79,718.00	0.27
87	601868	中国能建	35,300	78,719.00	0.26
88	003816	中国广核	21,500	78,260.00	0.26
89	600096	云天化	3,500	76,895.00	0.26
90	601117	中国化学	10,000	76,700.00	0.26
91	600741	华域汽车	4,300	75,895.00	0.25
92	601319	中国人保	8,700	75,777.00	0.25
93	601168	西部矿业	4,500	74,835.00	0.25
94	002601	龙佰集团	4,600	74,566.00	0.25
95	000786	北新建材	2,800	74,144.00	0.25
96	600219	南山铝业	19,000	72,770.00	0.24
97	600352	浙江龙盛	7,100	72,136.00	0.24
98	000933	神火股份	4,300	71,552.00	0.24
99	600039	四川路桥	7,169	70,973.10	0.24
100	601108	财通证券	8,900	70,399.00	0.23
101	000630	铜陵有色	21,000	70,140.00	0.23
102	000895	双汇发展	2,800	68,348.00	0.23
103	001965	招商公路	5,600	67,200.00	0.22
104	601128	常熟银行	9,031	66,558.47	0.22
105	601877	正泰电器	2,900	65,743.00	0.22
106	600362	江西铜业	2,800	65,604.00	0.22
106	601577	长沙银行	6,600	65,604.00	0.22
108	002532	天山铝业	7,600	63,156.00	0.21
109	000783	长江证券	9,000	62,370.00	0.21
110	600109	国金证券	7,100	62,267.00	0.21

111	002078	太阳纸业	4,566	61,458.36	0.21
112	600188	兖矿能源	4,850	59,024.50	0.20
113	600023	浙能电力	11,000	58,300.00	0.19
114	601618	中国中冶	19,400	57,812.00	0.19
115	600873	梅花生物	5,400	57,726.00	0.19
116	002673	西部证券	7,300	57,524.00	0.19
117	000728	国元证券	7,200	56,808.00	0.19
118	600875	东方电气	3,300	55,242.00	0.18
119	601872	招商轮船	8,800	55,088.00	0.18
120	600027	华电国际	10,000	54,700.00	0.18
120	601898	中煤能源	5,000	54,700.00	0.18
122	600549	厦门钨业	2,600	54,392.00	0.18
123	600061	国投资本	7,000	52,640.00	0.18
124	601216	君正集团	9,200	50,784.00	0.17
125	000617	中油资本	6,900	50,370.00	0.17
126	600332	白云山	1,900	50,084.00	0.17
127	601665	齐鲁银行	7,900	49,928.00	0.17
128	000983	山西焦煤	7,800	49,920.00	0.17
128	601997	贵阳银行	8,000	49,920.00	0.17
130	600153	建发股份	4,800	49,776.00	0.17
131	000932	华菱钢铁	11,300	49,720.00	0.17
132	600918	中泰证券	7,600	48,868.00	0.16
133	601233	桐昆股份	4,600	48,760.00	0.16
134	600060	海信视像	2,100	48,342.00	0.16
135	601717	郑煤机	2,900	48,198.00	0.16
136	600369	西南证券	10,900	47,415.00	0.16
137	600803	新奥股份	2,500	47,250.00	0.16
138	600177	雅戈尔	6,300	45,990.00	0.15
139	600398	海澜之家	6,600	45,936.00	0.15
140	601238	广汽集团	6,000	44,940.00	0.15
141	000623	吉林敖东	2,650	44,917.50	0.15
142	600704	物产中大	8,500	44,795.00	0.15
143	002958	青农商行	12,100	43,681.00	0.15
144	300724	捷佳伟创	800	43,440.00	0.14
145	600018	上港集团	7,600	43,396.00	0.14
146	600141	兴发集团	2,100	43,113.00	0.14
147	300919	中伟股份	1,300	42,744.00	0.14
148	600637	东方明珠	5,500	41,085.00	0.14
149	601607	上海医药	2,255	40,319.40	0.13
150	000415	渤海租赁	11,800	39,294.00	0.13
151	000887	中鼎股份	2,200	38,698.00	0.13
152	002926	华西证券	4,300	38,442.00	0.13
153	600901	江苏金租	6,340	38,420.40	0.13

154	002939	长城证券	4,400	36,872.00	0.12
155	600820	隧道股份	6,000	36,600.00	0.12
156	600863	内蒙华电	8,900	36,579.00	0.12
157	600008	首创环保	12,000	36,240.00	0.12
158	688009	中国通号	7,019	36,077.66	0.12
159	000513	丽珠集团	1,000	36,040.00	0.12
160	002064	华峰化学	5,400	35,694.00	0.12
161	600390	五矿资本	6,100	35,563.00	0.12
162	600998	九州通	6,869	35,306.66	0.12
163	002080	中材科技	1,800	35,100.00	0.12
164	601699	潞安环能	3,300	34,815.00	0.12
165	600170	上海建工	14,500	34,655.00	0.12
166	002500	山西证券	5,900	34,456.00	0.11
167	600208	衢州发展	11,600	34,336.00	0.11
168	600021	上海电力	3,900	34,281.00	0.11
169	601155	新城控股	2,500	34,200.00	0.11
170	000683	博源化工	7,100	34,009.00	0.11
171	000921	海信家电	1,300	33,410.00	0.11
172	603816	顾家家居	1,300	33,176.00	0.11
173	002244	滨江集团	3,400	33,150.00	0.11
174	600380	健康元	3,000	33,090.00	0.11
175	600348	华阳股份	4,950	32,967.00	0.11
176	000591	太阳能	7,500	32,925.00	0.11
177	600985	淮北矿业	2,900	32,886.00	0.11
178	600583	海油工程	6,000	32,760.00	0.11
179	601000	唐山港	8,000	32,480.00	0.11
180	601991	大唐发电	10,200	32,334.00	0.11
181	000830	鲁西化工	3,100	31,930.00	0.11
182	000708	中信特钢	2,700	31,752.00	0.11
183	600535	天士力	2,000	31,300.00	0.10
184	600970	中材国际	3,600	30,888.00	0.10
185	601016	节能风电	10,600	30,634.00	0.10
186	002423	中粮资本	2,500	30,575.00	0.10
187	600859	王府井	2,200	30,558.00	0.10
188	300390	天华新能	1,600	30,512.00	0.10
189	600499	科达制造	3,100	30,380.00	0.10
190	601666	平煤股份	4,000	29,640.00	0.10
191	000563	陕国投 A	8,300	29,631.00	0.10
192	603156	养元饮品	1,400	29,624.00	0.10
193	000598	兴蓉环境	4,100	29,561.00	0.10
194	601958	金钼股份	2,700	29,538.00	0.10
195	600655	豫园股份	5,300	29,415.00	0.10
196	600325	华发股份	6,000	29,220.00	0.10

197	600511	国药股份	1,000	29,160.00	0.10
198	600483	福能股份	3,000	28,920.00	0.10
199	002756	永兴材料	910	28,892.50	0.10
200	603833	欧派家居	500	28,225.00	0.09
201	600282	南钢股份	6,700	28,140.00	0.09
202	000951	中国重汽	1,600	28,128.00	0.09
203	000987	越秀资本	4,100	28,126.00	0.09
204	601001	晋控煤业	2,300	28,106.00	0.09
205	601918	新集能源	4,300	27,778.00	0.09
206	600739	辽宁成大	2,500	27,500.00	0.09
207	600737	中粮糖业	2,900	27,405.00	0.09
208	600582	天地科技	4,500	26,955.00	0.09
209	600566	济川药业	1,000	26,330.00	0.09
210	601098	中南传媒	2,000	26,240.00	0.09
211	002120	韵达股份	3,900	26,130.00	0.09
212	600258	首旅酒店	1,800	25,434.00	0.08
213	000027	深圳能源	3,900	24,882.00	0.08
214	002508	老板电器	1,300	24,713.00	0.08
215	600578	京能电力	5,500	24,695.00	0.08
216	603688	石英股份	700	24,654.00	0.08
217	000709	河钢股份	11,315	24,440.40	0.08
218	000883	湖北能源	5,300	23,903.00	0.08
219	600959	江苏有线	6,900	23,736.00	0.08
220	600546	山煤国际	2,700	23,571.00	0.08
221	601928	凤凰传媒	2,100	23,457.00	0.08
222	002831	裕同科技	1,000	23,420.00	0.08
223	600968	海油发展	5,500	22,440.00	0.07
224	002572	索菲亚	1,600	22,416.00	0.07
225	603225	新凤鸣	2,100	22,365.00	0.07
226	601156	东航物流	1,700	22,253.00	0.07
227	600528	中铁工业	3,000	22,140.00	0.07
228	601636	旗滨集团	4,400	22,044.00	0.07
229	000543	皖能电力	3,100	21,700.00	0.07
230	000582	北部湾港	2,600	21,450.00	0.07
231	600801	华新水泥	1,800	21,312.00	0.07
232	601598	中国外运	4,300	21,199.00	0.07
233	000785	居然智家	6,800	20,740.00	0.07
234	600377	宁沪高速	1,300	19,942.00	0.07
235	600373	中文传媒	1,900	19,513.00	0.07
236	600098	广州发展	2,800	17,500.00	0.06
237	001286	陕西能源	2,000	17,400.00	0.06
238	000937	冀中能源	2,900	16,675.00	0.06
239	601019	山东出版	1,700	16,099.00	0.05

240	002608	江苏国信	2,100	15,393.00	0.05
241	601139	深圳燃气	2,400	15,264.00	0.05
242	600720	中交设计	1,900	14,687.00	0.05
243	000959	首钢股份	4,200	14,280.00	0.05
244	600928	西安银行	3,600	14,112.00	0.05
245	600295	鄂尔多斯	1,600	13,936.00	0.05
246	600007	中国国贸	600	12,348.00	0.04
247	002563	森马服饰	2,200	11,572.00	0.04
248	000539	粤电力 A	2,400	10,896.00	0.04
249	688819	天能电池 集团股份	300	8,328.00	0.03
250	600956	新天绿能	800	6,176.00	0.02

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产 净值比例（%）
1	600030	中信证券	730,765.00	1.82
2	601211	国泰海通	485,860.72	1.21
3	000333	美的集团	373,643.00	0.93
4	601166	兴业银行	187,442.00	0.47
5	000651	格力电器	185,561.00	0.46
6	601318	中国平安	173,319.00	0.43
7	601825	沪农商行	165,171.00	0.41
8	000725	京东方 A	140,796.00	0.35
9	600036	招商银行	128,030.00	0.32
10	601077	渝农商行	127,768.00	0.32
11	601377	兴业证券	119,379.00	0.30
12	000063	中兴通讯	114,225.00	0.29
13	601328	交通银行	113,635.00	0.28
14	000001	平安银行	101,911.00	0.25
15	002142	宁波银行	83,937.00	0.21
16	000100	TCL 科技	78,200.00	0.20
17	000338	潍柴动力	77,969.00	0.19
18	000933	神火股份	75,364.00	0.19
19	000425	徐工机械	73,679.00	0.18

20	601006	大秦铁路	73,568.00	0.18
----	--------	------	-----------	------

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	000333	美的集团	773,612.00	1.93
2	000651	格力电器	412,205.00	1.03
3	600837	海通证券	402,371.72	1.00
4	000725	京东方 A	316,526.00	0.79
5	000063	中兴通讯	243,441.00	0.61
6	000001	平安银行	228,347.00	0.57
7	601318	中国平安	208,433.00	0.52
8	600036	招商银行	194,694.54	0.49
9	002142	宁波银行	180,572.00	0.45
10	000338	潍柴动力	175,899.00	0.44
11	000100	TCL 科技	175,402.00	0.44
12	601988	中国银行	168,829.00	0.42
13	000425	徐工机械	156,381.00	0.39
14	002027	分众传媒	152,633.00	0.38
15	000408	藏格矿业	151,228.00	0.38
16	002466	天齐锂业	145,027.00	0.36
17	000661	长春高新	129,599.00	0.32
18	002304	洋河股份	121,471.00	0.30
19	002555	三七互娱	117,712.00	0.29
20	002271	东方雨虹	101,853.00	0.25

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	7,611,941.23
卖出股票收入（成交）总额	9,892,397.59

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

注：本基金本报告期末无其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		广发证券股份有限公司-汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		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 (%)
454	53,814.98	18,574,300.00	76.02	5,857,700.00	23.98	13,753,800.00	56.29

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 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”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	广发证券股份有限公司	2,103,100.00	8.61
2	国泰海通证券股份有限公司	2,069,929.00	8.47
3	申萍	1,000,000.00	4.09
4	中信证券股份有限公司	646,771.00	2.65
5	张婉琪	400,000.00	1.64
6	李庆丰	300,000.00	1.23
7	李莉	300,000.00	1.23
8	陈玉玲	250,000.00	1.02
9	戴进权	240,000.00	0.98
10	冯威	200,000.00	0.82

10	刘旭灵	200,000.00	0.82
10	李鸿根	200,000.00	0.82
11	广发证券股份有限公司-汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	13,753,800.00	56.29

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 06 月 20 日）基金份额总额	475,432,000.00
本报告期期初基金份额总额	33,432,000.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	13,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	24,432,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，本基金托管人不涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
国信证券	6	16,701,741.38	100.00	3,105.65	100.00	

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

合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
国信证券	8,124.90	100.00	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部（合称“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。
- (2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。
- (6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券为	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电	2025 年 01 月 14 日

	申购赎回代理券商的公告	子披露网站, 上交所, 深交所	
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第四季度报告	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报	2025 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年年报	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2024 年度)	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 上证报	2025 年 03 月 31 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 22 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报, 上交所, 深交所	2025 年 04 月 30 日
7	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)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	2025 年 06 月 16 日
8	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, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 20 日
9	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, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 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瑞银证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 23 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	上证报, 上交所, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 24 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 25 日

	第一次提示性公告		
13	汇添富基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	上交所, 上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 日
14	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行（中国）有限公司合作关系的公告	上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 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（%）
广发证券股份	1	2025 年 1 月 1 日至 202	15, 117, 700.00	3, 450, 000.00	4, 813, 900.00	13, 753, 800.00	56.29

有限公司一汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金		5 年 6 月 30 日					
产品特有风险							
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、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。 3、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 800 价值交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 800 价值交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 800 价值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

2025 年 08 月 29 日