

汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数
证券投资基金联接基金 (LOF) (原汇添富中
证全指证券公司指数型发起式证券投资基金
(LOF)) 2023 年第 2 季度报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2023 年 07 月 21 日

§ 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责任。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

自 2023 年 05 月 09 日起，汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 转型为汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)。本报告中，汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的报告期自 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 05 月 08 日止，汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的报告期自 2023 年 05 月 09 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况 (转型后)

基金简称	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF)
基金主代码	501047
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 05 月 09 日
报告期末基金份额总额(份)	1,455,860,662.54
投资目标	通过投资于目标 ETF，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	<p>本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。</p> <p>为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致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、跟踪误差进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；目标 ETF 的投资策略；成份股、备选成份股投资策略；固定收益类资产投资策略；金融衍生工具投资策略；融资及转融通投资策略；存托凭证的投资策略。</p>	
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金为汇添富中证全指证券公司 ETF 的联接基金，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。本基金通过投资目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF)A	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF)C
下属分级基金场内简称	全指证券	证券 C
下属分级基金的交易代码	501047	501048
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	553,187,209.11	902,673,453.43

注：汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF)A 类份额扩位证券简称：证券公司 LOF；汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF)C 类份额扩位证券简称：证券公司 LOFC。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	560090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 02 月 27 日
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 03 月 15 日

基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中信建投证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率
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。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)
基金主代码	501047
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 04 日
报告期末基金份额总额(份)	1,485,799,484.90
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投

	投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。	
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C
下属分级基金场内简称	全指证券	证券 C
下属分级基金的交易代码	501047	501048
报告期末下属分级基金的份额总额 (份)	588,481,633.41	897,317,851.49

注：汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A 类份额扩位证券简称：证券公司 LOF；汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C 类份额扩位证券简称：证券公司 LOFC。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 (转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023年05月09日 - 2023年06月30日)	
	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接(LOF)A	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接(LOF)C
1. 本期已实现收益	-91,332,620.74	-124,561,484.66
2. 本期利润	-56,960,098.40	-79,205,918.42
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0988	-0.0909

4. 期末基金资产净值	506,974,265.67	825,080,216.66
5. 期末基金份额净值	0.9165	0.9140

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金的《基金合同》生效日为 2023 年 05 月 09 日，至本报告期末不满一季度，因此主要财务指标只列示从基金合同生效日至 2023 年 06 月 30 日数据，特此说明。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023 年 04 月 01 日 - 2023 年 05 月 08 日)	
	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C
1. 本期已实现收益	-3,921,019.91	-6,264,261.54
2. 本期利润	40,449,682.94	62,609,923.14
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0681	0.0682
4. 期末基金资产净值	594,351,299.15	904,208,197.62
5. 期末基金份额净值	1.0100	1.0077

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A						
阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
自基金合同生效日起至今	-9.26%	1.00%	-9.64%	1.02%	0.38%	-0.02%
汇添富中证全指证券公司ETF联接(LOF)C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日起至今	-9.30%	1.00%	-9.64%	1.02%	0.34%	-0.02%

3.2.2 自基金转型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

汇添富中证全指证券公司ETF联接(LOF)A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证全指证券公司ETF联接(LOF)C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为2023年05月09日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

本基金由汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金(LOF)于2023年05月09日转型而来。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

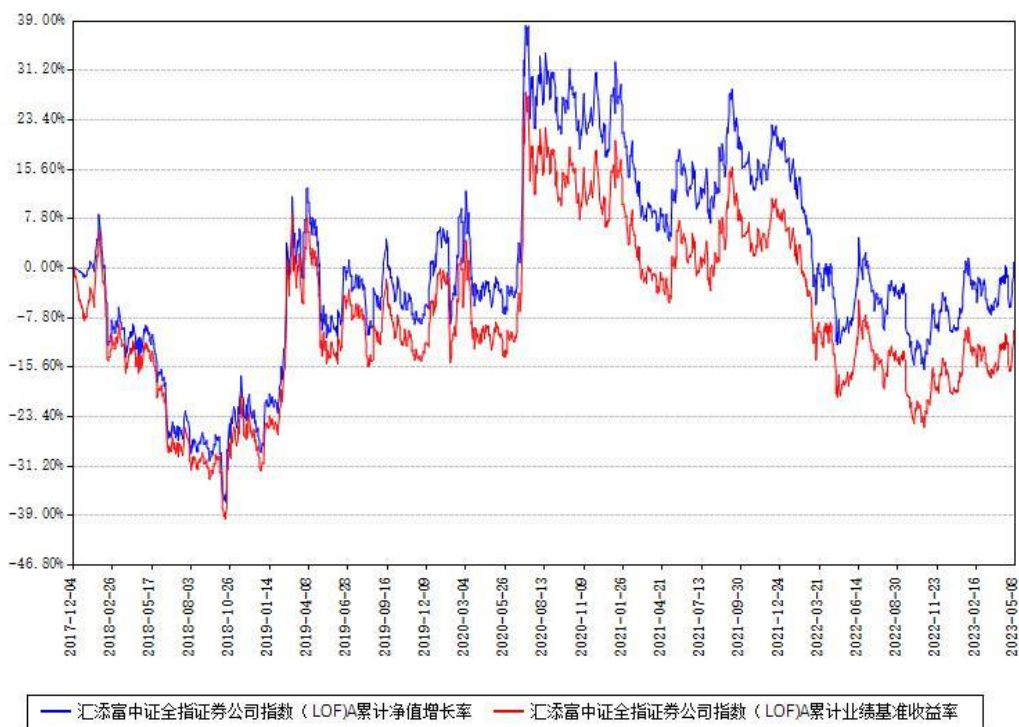
汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自2023-03-01至2023-05-08	4.49%	1.34%	4.57%	1.35%	-0.08%	-0.01%
自2022-12-01至2023-05-08	8.56%	1.32%	8.67%	1.33%	-0.11%	-0.01%

自 2022-06-01 至 2023-05-08	9.56%	1.44%	7.97%	1.45%	1.59%	-0.01%
自 2020-06-01 至 2023-05-08	8.19%	1.69%	4.28%	1.70%	3.91%	-0.01%
自 2018-06-01 至 2023-05-08	21.16%	1.83%	11.60%	1.86%	9.56%	-0.03%
自 2017-12-02 至 2023-05-08	1.00%	1.80%	-9.77%	1.83%	10.77%	-0.03%
汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自 2023-03-01 至 2023-05-08	4.45%	1.34%	4.57%	1.35%	-0.12%	-0.01%
自 2022-12-01 至 2023-05-08	8.44%	1.32%	8.67%	1.33%	-0.23%	-0.01%
自 2022-06-01 至 2023-05-08	9.31%	1.44%	7.97%	1.45%	1.34%	-0.01%
自 2020-06-01 至 2023-05-08	7.41%	1.69%	4.28%	1.70%	3.13%	-0.01%
自 2018-06-01 至 2023-05-08	20.93%	1.83%	11.60%	1.86%	9.33%	-0.03%
自 2017-12-02 至 2023-	0.77%	1.80%	-9.77%	1.83%	10.54%	-0.03%

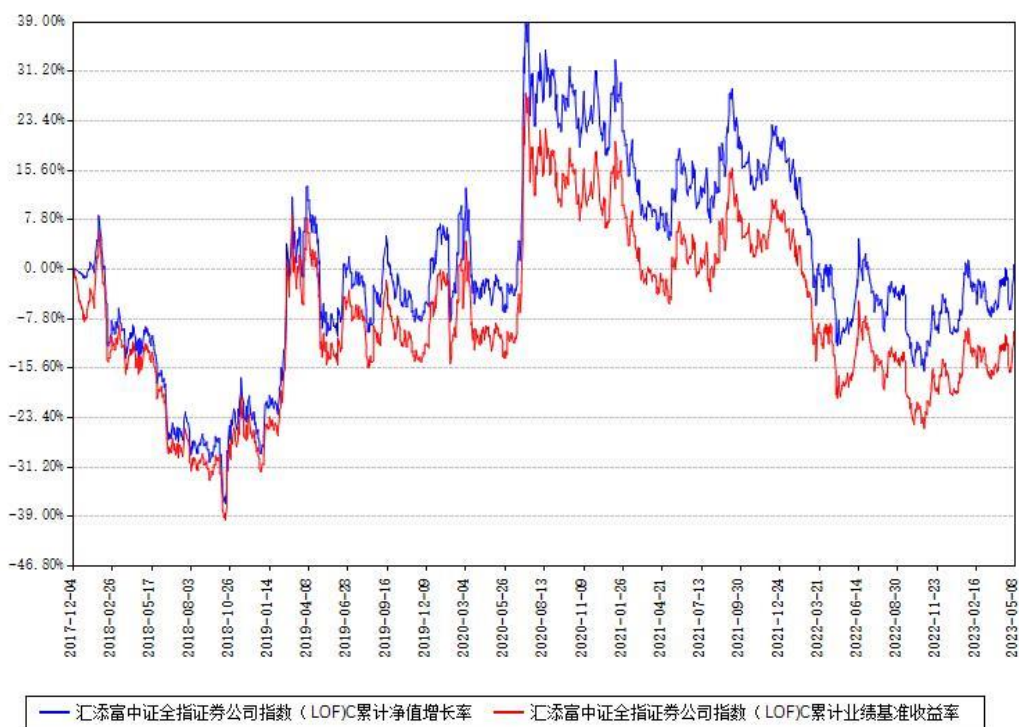
05-08						
-------	--	--	--	--	--	--

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

汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A 累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证全指证券公司指数(LOF)C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年12月04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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
董瑾	本基金的 基金经理	2023年05 月09日		14	国籍：中国。学历：北京大学西方经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年8月至2012年12月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012年12月至2015年9月任汇添富基金管理股份有限

					<p>公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 5 月 8</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 9 日至今任汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 26 日至 2022 年 10 月 11 日任汇添富中证沪港深 500 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 3 日至今任汇添富</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 23 日至今任汇添富中证电池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。2022 年 6 月 13 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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 12 月 29 日至今任汇添富中证全指医疗器械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 1 月 16 日至今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 2 月 27 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 6 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今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 9 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注:1、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;

2、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;

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 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。

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介 (转型前)

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
董瑾	本基金的基金经理	2019 年 12 月 31 日	2023 年 05 月 08 日	14	国籍: 中国。 学历: 北京大学西方经济学

				<p>硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指</p>
--	--	--	--	--

				<p>数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 5 月 8 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 9 日至今任</p>
--	--	--	--	---

				<p>汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 26 日至 2022 年 10 月 11 日任汇添富中证沪港深 500 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 3 月 3 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 23 日至今任汇添富中证电池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。</p> <p>2022 年 6 月 13 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型</p>
--	--	--	--	--

				<p>开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>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 12 月 29 日至今任汇添富中证全指医疗器械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 1 月 16 日至今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。</p> <p>2023 年 2 月 27 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 4 月 6 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 4 月 13 日至</p>
--	--	--	--	--

					今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 9 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注:1、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;

2、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;

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、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。

三、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。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化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，公平对待了旗下各投资组合。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 12 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，经济运行总体上延续恢复态势。生产需求逐步恢复，就业和消费价格总体稳定，发展质量继续提升。分项来看，固定资产投资保持增长，对经济社会发展的带动作用持续显现；消费保持恢复态势，餐饮、文化及旅游相关服务消费持续回暖；外贸总体呈现韧性。

政策方面，6 月国常会指出，针对经济形势的变化，必须采取更加有力的措施，增强发展动能，优化经济结构，推动经济持续回升向好。会议围绕加大宏观政策调控力度、着力扩大有效需求、做强做优实体经济、防范化解重点领域风险等四个方面，研究提出了一批政策措施。货币政策上，为维护银行体系流动性合理充裕，央行先后调降 OMO、SLF、MLF 利率 10 个基点，有望提振市场信心。

二季度市场整体呈现调整态势。风格上比较均衡，主要宽基指数均有一定程度的回调。行业主题方面，数字经济相关的通信、传媒以及偏周期性的电力、金融表现相对较好；而消费、医药和新能源等板块延续调整。

中期来看，券商板块或将受益于复苏带动下市场活跃度和风险偏好的提升，有望迎来业绩和估值的修复。长期来看，券商板块维持资本市场深化改革和券商创新业务及财富管理转型的投资主线不变。随着创新业务的开展，券商业务向多元化发展，盈利空间有望拓展、业绩波动有望降低，支撑行业估值中枢上移。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2023 年 05 月 09 日变更注册为汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)。转型前，本报告期汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A 类份额净值增长率为 7.16%，同期业绩比较基准收益率为 7.23%。本报告期汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C 类份额净值增长率为 7.13%，同期业绩比较基准收益率为 7.23%。转型后，本报告期汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF)A 类份额净值增长率为-9.26%，同期业绩比较基准收益率为-9.64%。本报告期汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF)C 类份额净值增长率为-9.30%，同期业绩比较基准收益率为-9.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告 (转型后)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	21,449,964.01	1.60
	其中：股票	21,449,964.01	1.60
2	基金投资	1,230,736,594.24	91.93
3	固定收益投资	3,134,398.96	0.23
	其中：债券	3,134,398.96	0.23
	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	77,874,284.63	5.82
8	其他资产	5,607,219.41	0.42

9	合计	1,338,802,461.25	100.00
---	----	------------------	--------

5.2 期末投资目标基金明细

基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理股份有限公司	1,230,736,594.24	92.39

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末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	19,857.83	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,375.51	0.00
F	批发和零售业	31,189.44	0.00
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	21,396,541.23	1.61
K	房地产业	-	-
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	21,449,964.01	1.61

5.3.2 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。

5.4 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

5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600030	中信证券	142,744	2,823,476.32	0.21
2	300059	东方财富	185,516	2,634,327.20	0.20
3	600837	海通证券	142,134	1,310,475.48	0.10
4	601688	华泰证券	75,948	1,045,803.96	0.08
5	601211	国泰君安	66,358	928,348.42	0.07
6	600958	东方证券	77,081	747,685.70	0.06

7	600999	招商证 券	54,631	741,342.67	0.06
8	000776	广发证 券	43,602	641,385.42	0.05
9	601377	兴业证 券	101,583	621,687.96	0.05
10	000166	申万宏 源	132,600	612,612.00	0.05

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	3,134,398.96	0.24
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	3,134,398.96	0.24

5.6 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
----	------	------	--------	----------	----------------------

1	019694	23 国债 01	31,000	3,134,398.96	0.24
---	--------	-------------	--------	--------------	------

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.8 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。

5.9 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资股指期货。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,广发证券股份有限公司出现在报告期内受监管机构立案调查的情况,中信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、招商证券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。

5.12.2

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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	647,054.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	4,960,165.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,607,219.41

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 5 投资组合报告 (转型前)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,417,444,485.57	93.24
	其中: 股票	1,417,444,485.57	93.24
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	81,286,426.48	5.35
8	其他资产	21,437,146.00	1.41
9	合计	1,520,168,058.05	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
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	1,417,385,808.28	94.58
K	房地产业	-	-
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	1,417,385,808.28	94.58

5.2.2 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	28,713.84	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,294.89	0.00
F	批发和零售业	27,668.56	0.00
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	-	-
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	58,677.29	0.00

5.2.3 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。

5.3 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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产
----	------	-----	--------	----------	-------

		称			净值比例 (%)
1	600030	中信证 券	8,613,144	195,432,237.36	13.04
2	300059	东方财 富	11,193,956	180,446,570.72	12.04
3	600837	海通证 券	8,519,734	87,753,260.20	5.86
4	601688	华泰证 券	4,544,448	67,530,497.28	4.51
5	601211	国泰君 安	3,978,758	62,784,801.24	4.19
6	600958	东方证 券	4,614,044	52,230,978.08	3.49
7	600999	招商证 券	3,274,831	49,711,934.58	3.32
8	000776	广发证 券	2,611,802	42,494,018.54	2.84
9	601377	兴业证 券	6,096,483	42,065,732.70	2.81
10	000166	申万宏 源	7,955,600	38,902,884.00	2.60

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	001287	中电港	1,460	27,668.56	0.00

2	603135	中重科技	628	10,462.48	0.00
3	301265	华新环保	819	9,361.17	0.00
4	603125	江苏常青 树科技	196	5,157.16	0.00
5	001360	南矿集团	177	2,816.07	0.00

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,广发证券股份有限公司出现在报告期内受监管机构立案调查的情况,中信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、招商证券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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	264,652.52
2	应收证券清算款	20,036,143.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,136,349.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,437,146.00

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值 (元)	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限 情况说明
1	001287	中电港	25,848.90	0.00	新股流通 受限
2	603135	中重科技	10,462.48	0.00	新股流通 受限
3	301265	华新环保	9,361.17	0.00	新股流通 受限
4	603125	江苏常青 树科技	4,091.20	0.00	新股流通 受限

5	001360	南矿集团	2,816.07	0.00	新股流通受限
---	--------	------	----------	------	--------

§ 6 开放式基金份额变动 (转型后)

单位: 份

项目	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C
基金合同生效日 (2023 年 05 月 09 日) 基金份额总额	588,481,633.41	897,317,851.49
本报告期基金总申购份额	101,397,613.18	125,009,554.66
减: 本报告期基金总赎回份额	136,692,037.48	119,653,952.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	553,187,209.11	902,673,453.43

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。

§ 6 开放式基金份额变动 (转型前)

单位: 份

项目	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) A	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) C
本报告期期初基金份额总额	601,407,628.95	939,639,939.41
本报告期基金总申购份额	26,569,947.57	66,228,289.53
减: 本报告期基金总赎回份额	39,495,943.11	108,550,377.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	588,481,633.41	897,317,851.49

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》；
- 5、《汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）在规定报刊上披露的各项公告；
- 8、报告期内汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）在规定报刊上披露的各项公告；

9、中国证监会要求的其他文件。

9.2 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

9.3 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

2023 年 07 月 21 日