汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金(原 汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资 基金) 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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行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 04 月 25 日起,汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金转型为汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金。本报告中,汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的报告期自 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 04 月 24 日止,汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的报告期自 2023 年 04 月 25 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 500 指数增强
基金主 代码	001050
基金运 作方式	契约型开放式
基金合 同生效 日	2023年04月25日
报告期 末基金 份额总 额(份)	2, 025, 093, 747. 70

投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,进行积极的组合管理和风险控制,力求实现超越标的指数的业绩表现,追求基金资产的长期增值。					
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数,结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术,在指数化投资基础上优化调整投资组合,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年跟踪误差不超过 8%,力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括:资产配置策略;股票投资策略;债券投资策略;资产支持证券投资策略;可转债及可交换债投资策略;股指期货投资策略;股票期权投资策略;融资及转融通证券出借业务投资策略;国债期货投资策略等。					
业绩比 较基准	中证 500 指数收益率 * 95% + 活期存款	《利率(税后) *5%				
风险收 益特征	本基金为股票型指数增强基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。 本基金除了投资 A 股以外,还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票, 将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异 带来的特有风险。					
基金管 理人	汇添富基金管理股份有限公司					
基金托 管人	中国工商银行股份有限公司					
下属分 级基金 的基金 简称	汇添富中证 500 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C				
下属分 级基金 的交易 代码	001050	016854				
报告期 末下属 分级基 金的份 额总额 (份)	1, 517, 466, 067. 84	507, 627, 679. 86				

2.1基金基本情况(转型前)

基金简称	添富成长多因子股票
基金主 代码	001050
基金运作方式	契约型开放式

11. 4. 4						
基金合						
同生效	2015年02月16日					
日						
报告期						
末基金		1, 999, 698, 721. 68				
份额总		1, 333, 030, 121. 00				
额(份)						
投资目	本基金通过多因子量化模型方法,精选	股票进行投资,在严格控制风险的前				
标	提下,力争获取超越比较基准的投资回:	报。				
	本基金主要投资于成长型行业的股票,	采用基金管理人的金融工程团队开发				
	的多因子量化策略进行选股。在本基金	的投资过程中,将控制股票投资组合				
	与业绩比较基准指数的结构性偏离,以	期在长期实现持续超越业绩比较基准				
投资策	收益率的投资目标。本基金在股票投资;	过程中将坚持量化模型驱动的投资决				
略	策流程,强调投资纪律、降低随意性投	_, , ,,,,_,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,				
	定增值。本基金的投资策略主要包括:					
	略、资产配置策略、债券投资策略、股					
	一 · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	旧别贝汉贝尔帕、 仅正汉贝尔帕、 贝				
业绩比	/ 又付证分汉贝泉峪。					
	中证 500 指数收益率*90%+活期存款利率(税后)*10%					
较基准						
风险收	本基金为股票型基金,其预期风险和预;					
益特征	金、混合型基金,属于证券投资基金中:	较局预期风险、较局预期收益的基金				
	产品。					
基金管	汇添富基金管理股份有限公司					
理人	1679年全业日全从70万代公司					
基金托	 中国工商银行股份有限公司					
管人	T A L A K A K A K A K A K A K A K A K A K					
下属分						
级基金	 添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票 C				
的基金	144日以入口 1 以示 1	14年74日2日1以示し				
简称						
下属分						
级基金	001050	010054				
的交易	001050	016854				
代码						
报告期						
末下属						
分级基						
金的份	1, 515, 240, 799. 06	484, 457, 922. 62				
额总额						
(份)						

§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04月25日-2023年06月30日)				
	汇添富中证 500 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C			
1. 本期已实现收益	-30, 072, 714. 54	-10, 140, 179. 41			
2. 本期利润	12, 178, 452. 06	3, 853, 089. 67			
3. 加权平均基金份 额本期利润	0.0081	0.0078			
4. 期末基金资产净值	2, 295, 323, 379. 22	765, 167, 945. 27			
5. 期末基金份额净值	1.5126	1.5073			

- 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 04 月 25 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04月24日)				
	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票C			
1. 本期已实现收益	19, 435, 664. 75	5, 945, 174. 38			
2. 本期利润	-60, 722, 158. 50	-19, 663, 579. 58			
3. 加权平均基金份 额本期利润	-0.0399	-0.0407			
4. 期末基金资产净值	2, 280, 360, 124. 81	727, 080, 940. 60			
5. 期末基金份额净值	1.505	1.501			

- 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 500 指数增强 A						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	1)-3	2-4	
自基金 合同生 效日起 至今	0.50%	0.70%	-3. 21%	0.78%	3.71%	-0.08%	
		汇添1	富中证 500 指	数增强 C			
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	1)-3	2-4	
自基金 合同生 效日起 至今	0. 42%	0.70%	-3. 21%	0.78%	3.63%	-0.08%	

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500指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注:本《基金合同》生效之日为2023年04月25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。

本基金由汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金于2023年04月25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

添富成长多因子股票 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	①-③	2-4
自 2023- 02-01 至 2023- 04-24	-2.21%	0. 68%	-1.13%	0. 72%	-1.08%	-0.04%
自 2022- 11-01 至 2023- 04-24	5.83%	0. 72%	6. 26%	0. 72%	-0.43%	0.00%
自 2022- 05-01 至 2023- 04-24	9. 93%	0. 93%	9.41%	0. 93%	0. 52%	0.00%
自 2020- 05-01 至 2023- 04-24	34. 82%	1.11%	14. 92%	1.08%	19.90%	0. 03%
自 2018- 05-01 至 2023- 04-24	58. 47%	1. 26%	6.63%	1. 24%	51.84%	0. 02%
自 2015- 02-16 至 2023- 04-24	76. 21%	1. 58%	9.85%	1.48%	66. 36%	0. 10%
		添富	成长多因子股	:票 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- 02-01 至 2023- 04-24	-2.33%	0. 68%	-1.13%	0. 72%	-1.20%	-0.04%

自 2022- 11-01 至 2023- 04-24	5. 59%	0. 72%	6. 26%	0. 72%	-0.67%	0.00%
自 2022- 10-14 至 2023- 04-24	4. 59%	0. 78%	5.89%	0. 78%	-1.30%	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

添富成长多因子股票A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图





添富成长多因子股票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(2015年02月16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。

本基金于 2022 年 10 月 12 日新增 C 类份额,新增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間		证券从业年限	说明
<i>/</i>	, ,,,,	任职日期	离任日期	(年)	72,74
许一尊	本基金的基金经理	2023 年 04 月 25 日		13	国籍:中国。学历:上海妈子、学经济格:上海妈子、从业资格:业务投资基处。从外方面,是是是一个人。 从处于,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人。 2015年,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是是一个人,是一个人,

				2023 年 4 月 24 日任汇添富成长
				多因子量化策略 股票型证券投资
				基金的基金经
				理。2018年3
				月23日至今任
				汇添富沪深 300
				指数增强型证券 投资基金的基金
				经理。2021年
				2021 中 12 月 2 日至今
				任汇添富中证芯
				片产业指数增强
				型发起式证券投
				资基金的基金经
				理。2022年3
				月8日至今任汇
				添富中证细分化
				工产业主题指数
				增强型发起式证
				券投资基金的基
				金经理。2023
				年4月25日至
				今任汇添富中证
				500 指数增强型
				证券投资基金的基金经理。2023
				年5月19日至
				今任汇添富中证
				800 指数增强型
				证券投资基金的
				基金经理。2023
				年 5 月 19 日至
				今任汇添富中证
				1000 指数增强
				型证券投资基金
				的基金经理。
				国籍:中国。学
				历:中国科学技
	本基金的基			术大学管理学博
吴振翔	金经理,指	2023年04	17	士。从业资格:
2 44/42/44	数与量化投	月 25 日	•	证券投资基金从
	资部副总监			业资格。从业经
				历:曾任长盛基
				金管理有限公司

金融工程研究
吕 上切麻坦甘
员、上投摩根基
金管理有限公司
产品开发高级经
理。2008年3
月加入汇添富基
金管理股份有限
公司,历任产品
开发高级经理、
数量投资高级分
析师、基金经理
助理,现任指数
与量化投资部副
总监。2010年2
月6日至今任汇
添富上证综合指
数证券投资基金
的基金经理。
2011年9月16
日至 2013 年 11
月7日任深证
300 交易型开放
式指数证券投资
基金的基金经
理。2011年9
月 28 日至 2013
年 11 月 7 日任
汇添富深证 300
交易型开放式指
数证券投资基金
联接基金的基金
经理。2013年8
月 23 日至 2015
年11月2日任
中证金融地产交
易型开放式指数
证券投资基金的
基金经理。2013
年8月23日至
2015年11月2
日任中证能源交
易型开放式指数
证券投资基金的
基金经理。2013
年 8 月 23 日至
2015年11月2

		日任中证医药卫
		生交易型开放式
		指数证券投资基
		金的基金经理。
		2013年8月23
		日至 2015 年 11
		月2日任中证主
		要消费交易型开
		放式指数证券投
		资基金的基金经
		理。2013年11
		*
		月6日至今任汇
		添富沪深 300 安
		中动态策略指数
		型证券投资基金
		的基金经理。
		2015年2月16
		日至 2023 年 4
		月 24 日任汇添
		富成长多因子量
		化策略股票型证
		券投资基金的基
		金经理。2015
		年 3 月 24 日至
		2022年6月13
		日任汇添富中证
		主要消费交易型
		开放式指数证券
		投资基金联接基
		金的基金经理。
		2016年1月21
		日至今任汇添富
		中证精准医疗主
		题指数型发起式
		证券投资基金
		(LOF) 的基金
		经理。2016年7
		月 28 日至今任
		中证上海国企交
		易型开放式指数
		证券投资基金的
		基金经理。2016
		年 12 月 22 日至
		今任汇添富中证
		互联网医疗主题
		指数型发起式证
		旧奴至从咫八世

		券投资基金
		(LOF) 的基金
		经理。2017年8
		月 10 日至今任
		汇添富中证 500
		指数型发起式证
		券投资基金
		(LOF) 的基金
		经理。2018年3
		月 23 日至今任
		汇添富沪深 300
		指数增强型证券
		投资基金的基金
		经理。2019年7
		月 26 日至 2022
		年6月13日任
		中证长三角一体
		化发展主题交易
		型开放式指数证
		券投资基金的基
		金经理。2019
		年 9 月 24 日至
		2022年6月13
		日任中证长三角
		一体化发展主题
		交易型开放式指
		数证券投资基金
		联接基金的基金
		经理。2019年
		11月6日至
		2022年6月13
		日任汇添富中证
		国企一带一路交
		易型开放式指数
		证券投资基金的
		基金经理。2020
		年3月5日至
		2022年6月13
		日任汇添富中证
		国企一带一路交
		易型开放式指数
		证券投资基金联
		接基金的基金经
		理。2021年10
		月 29 日至今任
		汇添富 MSCI 中

		国 A50 互联互通
		交易型开放式指
		数证券投资基金
		的基金经理。
		2022年1月11
		日至今任汇添富
		MSCI 中国 A50
		互联互通交易型
		开放式指数证券
		投资基金联接基
		金的基金经理。
		2022年1月27
		日至今任汇添富
		中证智能汽车主
		题交易型开放式
		指数证券投资基
		金的基金经理。
		2022年4月28
		日至今任汇添富
		中证沪港深张江
		自主创新 50 交
		易型开放式指数
		证券投资基金的
		基金经理。2023
		年 4 月 25 日至
		今任汇添富中证
		500 指数增强型
		证券投资基金的
		基金经理。2023
		年6月6日至今
		任汇添富量化选
		股混合型证券投
		资基金的基金经
		理。

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	基金经理期限	证券从业年限	说明
红石	机分	任职日期	离任日期	(年)	
许一尊	本基金的理	2015年11月24日	2023年04月24日	13	国学经硕格基格历月基有任投理月年汇因股资经3任30证的20日富业发资经3汇分题发资经4籍历大士:金。:加金限指资。244添子票基理月汇0券基1至中指起基理月添化指起基理月中上经从券业业10汇理司与基15至4长第券基18至沪增基理2汇片强券基22至证业强券基32日国海济业投资经年添股,量金年2日长策券基18至沪增基理2汇片强券基22至证业强券基32至。财学资资 7富份现化经113任多略投金年今深型金。月添产型投金年任本增正的20日本,对学资资 7富份现化经113任

					任汇 500 指数资 基 空 的 2023 年 5 月 19 日 富 增 基 金 。 2023 年 5 月 17 下 强 型 查 经 经 5 月 19 下 强 型 查 经 5 月 19 下 省 数 资 经 5 月 1000 券 基 金 2023 年 5 日 中 证 1000 券 基 金 2023 年 5 月 19 下 省 数 资 基 金 2023 年 9 下 省 数 资 基 金 2023 年 9 下 省 数 资 基 金 2023 年 9 下 省 数 资 2023 年 9 下 3 下 3 下 3 下 3 下 3 下 3 下 3 下 3 下 3 下
吴振翔	本基指化副的理量部	2015年02月16日	2023 年 04 月 24 日	17	国学学理业投资历基公研摩有开理月基有任级投师助数部20日富数金籍历技学资资格:金司究根限发。加金限产经资、理与副10至上证的中中大士:金从任理融、金司级88汇理司开、级金现化监2任综投金国国学。证从业长有工上管产经年添股,发数分经任投。月汇合资经。科管从券业经盛限程投理品。3富份历高量析理指资。6添指基本,

		理。2011年9
		月 16 日至 2013
		年11月7日任
		深证 300 交易
		型开放式指数
		证券投资基金
		的基金经理。
		2011年9月28
		日至 2013 年 11
		月7日任汇添
		富深证 300 交
		易型开放式指
		数证券投资基
		金联接基金的
		基金经理。
		2013年8月23
		日至 2015 年 11
		月2日任中证
		金融地产交易
		型开放式指数
		证券投资基金
		的基金经理。
		2013年8月23
		日至 2015 年 11
		月2日任中证
		能源交易型开
		放式指数证券
		投资基金的基
		金经理。2013
		年 8 月 23 日至
		2015年11月2
		日任中证医药
		卫生交易型开
		放式指数证券
		投资基金的基
		金经理。2013
		年8月23日至
		2015年11月2
		日任中证主要
		消费交易型开
		放式指数证券
		投资基金的基
		金经理。2013
		年11月6日至
		今任汇添富沪
		深 300 安中动

态策略指基金的基金企业。2015年2月16日至 2023年4月24日任汇添富成定案中,1月24日任汇添富成定案的基金企业。2015年3月24日至 2022年6月13日主要消改资基金的基金企业。2015年1月21日平中,2015年2025年6月13日主要消改资基金。2016年1月21本产产。2016年1月21本产产。2016年1月2日中,2016年7月2日中,2016年7月2日中,2016年12月2日中,12月2日中,12月2日中,12日中,12日中,12日中,12日中,12日中,12日中,12日中,1		I	
的基金经理。 2015年2月16 日至2023年4 月24日任江海宫成长多股門 全量化策略股票 型证券处资基金的股票 型证券经经理。2015年3 月24日至2022年6月13日任 汇海湾武武委基地区类数型 开放改资基金经型理。2016年7 月21日至中证主要消费式数联接基型。2016年1月汇率医疗发验的数证证据,并为政证基金经理。2016年7月28日至中证上型用企交易数证基金经理。2016年7月28日至今任任定务数证基金经理。2016年7月28日中正三型资验,2016年12月22日上汇海区发生基础计算关键。2016年12月22日上汇海区域上,2017年8月10日至少任汇海区域上,2017年8月10日至少任汇海宫中证500指数型			态策略指数型
2015年2月16 日至2023年4 月24日任江添 富成长多田聚墨型证券投经。 型。2015年3 月24日至2022年6月3日任 江海费变对数证 考及查的2016年 月3日在 江海营费交验。2016年 1月16至今 任在主要消放资的基金 经理。2016年 7月28日中远易型 资数的16年 7月28日中远易型 大发整金。2016年 7月28日中远易型 大发整金。2016年 7月28日中近易型 大发整金。2016年 7月12率下处 至少。2016年 12月2率下生 互解为型交验,或证证是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是			证券投资基金
日至 2023 年 4 月 24 日任汇添 富成长 等因 24 日任汇添 富成长 等因 24 日至 2015 年 3 月 24 日至 2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 31 日任 汇 资 费 数 证 券 投 验 业 数 证 券 投 验 业 数 证 券 投 验 业 2016 年 1 月 21 国 定 主 要 对 放 或 基 多 经 理 。 2016 年 1 月 21 国 定 主 题 指 数 投 资 的 基 全 经 理 。 2016 年 7 月 28 日 至 今 任 中 证 是 现 上 型 开 发 及 或 或 基 多 经 理 。 2016 年 7 月 22 日 至 证 上 型 并 发 及 建 。 2016 年 1 2 月 22 日 至 证 互 联 为 发 这 基 金 经 理 。 2017 年 8 月 10 日至 今 任 汇 添 国 和 发 型 图 10 日至 今 任 汇 添 国 中 证 500 指 数 型			的基金经理。
日至 2023 年 4 月 24 日任汇添 富成长 等因 24 日任汇添 富成长 等因 24 日至 2015 年 3 月 24 日至 2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 31 日任 汇 资 费 数 证 券 投 验 业 数 证 券 投 验 业 数 证 券 投 验 业 2016 年 1 月 21 国 定 主 要 对 放 或 基 多 经 理 。 2016 年 1 月 21 国 定 主 题 指 数 投 资 的 基 全 经 理 。 2016 年 7 月 28 日 至 今 任 中 证 是 现 上 型 开 发 及 或 或 基 多 经 理 。 2016 年 7 月 22 日 至 证 上 型 并 发 及 建 。 2016 年 1 2 月 22 日 至 证 互 联 为 发 这 基 金 经 理 。 2017 年 8 月 10 日至 今 任 汇 添 国 和 发 型 图 10 日至 今 任 汇 添 国 中 证 500 指 数 型			2015年2月16
月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015年3月24日至2022年6月13日在汇海费费变数证券投资证差要消效或指数金联接基金。2016年1月21日富定时产业题有报数投资基本金经理。2016年1月21日富定产品。在交易数证此券投资基金(LDF)的基金经理,2016年7月中证上期产业。21日年7月中证上期产业。21日年12月22日中证上期产业。21日年12月22日中证,21日下海网发资基基金(LDF)的基金经理。2016年7月2日市上市,21日下海网发资基基金(LDF)的基金经理。2017年8月10富中证500指数型			
富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015年3月24日至2022年6月13日任汇添清费交基型开放对指数企联接基金联盟。2016年1月21日至于海南中型。2016年1月21日至证据整约发基金(LDF)的基金经理。2016年7月28日至年7月28日至年7月28日至年7月28日至年12月28日至年12月28日至年12月28日至年12月28日至年12月28日至年12月28日至年12月28日至年12月28日至年12月28日至年12月28日末近季投资基金(LDF)的基金经理。2016年12月28日末近季投资基金(LDF)的基金经理。2017年8月10百至今任汇添取更型。2017年8月10百至今任汇添数型			,
量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015年3 月24日至2022年6月13日任汇。第13日在汇率消费交易型开放资基基金联步发资基基。2016年1月21日至今任汇添定产起。2016年1月21日至中间,2016年7月28日至少年,1月2日至今任中间,2016年7月28日至今任中间,2016年7月28日至一个任汇添富中证,2016年12月22日至今任汇添购网数基金经理。2016年12月26日至今任汇添购人。2017年8月10日至今任汇添购,2017年8月10日至今任汇添购型			
型证券投资基金经理。2015年3月24日至2022年6月13日任 汇添有3证主 要消费交易型 开放式基金联接基金的基金 经理。2016年1月21日至今任汇流后中证精准医疗主题 指数型发应起式证券投资 基金 (LOF)的基金 经理。2016年7月28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金(12月22日至今任汇添富中证 互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证 500指数型			
金的基金经理。2015年3月24日至2022年6月13日任 汇添富中证是要消费型开放改资基金联接基金联接基金联接基金联接基金联接基金联接基金经理。2016年1月21日至今任汇添富中证籍推废型发展工式证券投资基金((LOF) 的基金经理。2016年7月28日至今任中证上期国企交易型开放式、基础的基金经理。2016年12月22日至今任汇深网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			
理。2015年3 月24日至2022年6月13日任 汇添富中证主 要消费交易型 开放式指数证 券基金联 接基金。2016年 1月21日至今 任汇添富中证 精准医疗主题 指数型发资基金 (LOF)的基金 经理。2016年 7月28日至今 任中证是型开放 式指数证券投资基金 经理。2016年 12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发资基。 式证券投资基金 式证券投资基金 经理。2016年 12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发资基金 式证券日的影			
月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任 汇添富中证主 要消费交易型 开放式指数证 券投资的基基 经理。2016 年 1 月 21 日至今 任汇添富中证 精数型发起式 证券投资起式 证券投资起去。 (LOF) 的基金 经理。2016 年 7 月 28 日至今 任中证是型 企交为任中证是型 企交为证券投资基金的基金 经理。2016 年 12 月 22 日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型投资基 金(LOF)的基 金经理。2017 年 8 月 10 日至 今任汇添富中 证 500 指数型			
年6月13日任 汇添富中证主 要消费交易型 开放式指数证 券投资基金联 接基金的基金 经理。2016年 1月21日至今 任汇添富宁证题 指数型投资起金 (LOF)的基金 经理。2016年 7月28日至今 任中证是型开放 式指数型的基金 经理。2016年 12月22日至子 任汇添富 上 题指数投资基金 (LOF)的基 金经理。2017年8月10日至 今任汇添富中 证500指数型			
汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016年1月21日至今任汇添富中证精推医疗发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年7月28日至今任中证上海国金交易型证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医型发起式证分投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			
要消费交易型 开放式指数证 券投资基金联接基金的基金 经理。2016 年 1月 21 日至今 任汇添富中证 精准医疗主题 指数型发起式证券投资基金 (LOF)的基金 经理。2016 年 7月 28 日至今 任中证上海国 企交易型证券投 资基金。2016 年 12月 22 日26 年 12月 22 日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017 年8月10日至 今任汇添富中 证 500 指数型			
开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016年1月21日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年7月28日至每任中证上海国金交易型进券投资基金经理。2016年12月22日中证上海国工资基金的基金经理。2016年12月22日时派网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			
券投资基金联接基金的基金经理。2016年1月21日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年7月28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			
接基金的基金经理。2016年 1月21日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2016年 7月28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年 12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			
经理。2016年 1月21日至今 任汇添富中证 精准医疗主题 指数型发起式 证券投资基金 (LOF)的基金 经理。2016年 7月28日至今 任中证上海国 企交易型形 投资基金的基金 经理。2016年 12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017年8月10日至 今任汇添富中 证 500指数型			券投资基金联
1月21日至今 任汇添富中证 精准医疗主题 指数型发起式 证券投资基金 (LOF)的基金 经理。2016年 7月28日至今 任中证上海国 金交易型开放 式指数证券投资基金的基金 经理。2016年 12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017年8月10日至 今任汇添富中 证 500指数型			
任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金((LOF)的基金经理。2016年7月28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金((LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			经理。2016年
精准医疗主题 指数型发起式 证券投资基金 (LOF)的基金 经理。2016 年 7月28日至今 任中证上海国 企交易型开放 式指数证券投 资基金的基金 经理。2016 年 12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017 年8月10日至 今任汇添富中 证 500指数型			1月21日至今
指数型发起式 证券投资基金 (LOF)的基金 经理。2016 年 7月28日至今 任中证上海国 企交易型开放 式指数证券投 资基金的基金 经理。2016 年 12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017 年8月10日至 今任汇添富中 证 500指数型			任汇添富中证
证券投资基金 (LOF)的基金 经理。2016年 7月28日至今 任中证上海国 企交易型开放 式指数证券投 资基金的基金 经理。2016年 12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017年8月10日至 今任汇添富中 证 500指数型			精准医疗主题
(LOF)的基金 经理。2016年 7月28日至今 任中证上海国 企交易型开放 式指数证券投 资基金的基金 经理。2016年 12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017年8月10日至 今任汇添富中 证 500指数型			指数型发起式
经理。2016年7月28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			证券投资基金
经理。2016年7月28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			(LOF) 的基金
7月28日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			
任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			
企交易型开放 式指数证券投 资基金的基金 经理。2016 年 12 月 22 日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017 年 8 月 10 日至 今任汇添富中 证 500 指数型			
式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			
资基金的基金 经理。2016年 12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017 年8月10日至 今任汇添富中 证 500 指数型			
经理。2016年 12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017 年8月10日至 今任汇添富中 证 500 指数型			
12月22日至今 任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金(LOF)的基 金经理。2017 年8月10日至 今任汇添富中 证 500 指数型			
任汇添富中证 互联网医疗主 题指数型发起 式证券投资基 金 (LOF) 的基 金经理。2017 年8月10日至 今任汇添富中 证 500指数型			
互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2017年8月10日至今任汇添富中证500指数型			
题指数型发起 式证券投资基 金 (LOF) 的基 金经理。2017 年 8 月 10 日至 今任汇添富中 证 500 指数型			
式证券投资基 金 (LOF) 的基 金经理。2017 年 8 月 10 日至 今任汇添富中 证 500 指数型			-
金 (LOF) 的基 金经理。2017 年 8 月 10 日至 今任汇添富中 证 500 指数型			
金经理。2017 年 8 月 10 日至 今任汇添富中 证 500 指数型			
年 8 月 10 日至 今任汇添富中 证 500 指数型			
今任汇添富中 证 500 指数型			
证 500 指数型			
资基金 (LOF)			
2018年3月23			2018年3月23

		日至今任汇添
		富沪深 300 指
		数增强型证券
		投资基金的基
		金经理。2019
		年7月26日至
		2022年6月13
		日任中证长三
		角一体化发展
		主题交易型开
		放式指数证券
		投资基金的基
		金经理。2019
		年 9 月 24 日至
		2022年6月13
		日任中证长三
		角一体化发展
		主题交易型开
		放式指数证券
		投资基金联接
		基金的基金经
		理。2019年11
		月6日至2022
		年6月13日任
		汇添富中证国
		企一带一路交
		易型开放式指
		数证券投资基
		金的基金经
		理。2020年3
		月 5 日至 2022
		年6月13日任
		汇添富中证国
		企一带一路交
		易型开放式指
		数证券投资基
		金联接基金的
		基金经理。
		2021年10月
		29 日至今任汇
		添富 MSCI 中国
		A50 互联互通交
		易型开放式指
		数证券投资基
		金的基金经
 	 	 理。2022年1

		月 11 日至今任
		汇添富 MSCI 中
		国 A50 互联互
		通交易型开放
		式指数证券投
		资基金联接基
		金的基金经
		理。2022年1
		月 27 日至今任
		汇添富中证智
		能汽车主题交
		易型开放式指
		数证券投资基
		金的基金经
		理。2022年4
		月 28 日至今任
		汇添富中证沪
		港深张江自主
		创新 50 交易型
		开放式指数证
		券投资基金的
		基金经理。
		2023年4月25
		日至今任汇添
		富中证 500 指
		数增强型证券
		投资基金的基
		金经理。2023
		年6月6日至
		今任汇添富量
		化选股混合型
		证券投资基金
		的基金经理。

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內遵守《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和流程,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 交易系统中的公平交易模块,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

在 2023 年的第二季度,我们观察到国内经济和市场在多个方面呈现出波动和调整的态势。尽管生产需求逐步恢复,就业和消费价格总体稳定,发展质量继续提升,但国内经济数

据在二季度整体较为疲软,制造业 PMI 数据连续两个月低于 50,规模以上工业企业利润增速出现一定下滑。这表明国内经济整体仍处于弱复苏阶段,内需修复动力不足、外需增长压力较大。尽管经济面临一定压力,但政策层面的积极应对为经济恢复注入了信心。6 月的国常会提出了一系列的政策措施,包括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,以期推动经济持续回升向好。在货币政策上,央行先后调降了 0MO、SLF、MLF 的利率 10 个基点,有望减轻企业融资成本、居民债务负担压力,进一步提振市场信心。

市场在二季度整体呈现出调整的态势。主要的宽基指数都有一定程度的回调,行业主题结构性分化依然显著。一季度表现强势的计算机、通信等板块在 4 月和 5 月显著回调,6 月开始重新受到市场关注;而消费、医药和新能源等板块则延续了调整的趋势。风格方面,季度整体仍呈现小盘优于大盘、价值优于成长的特性,小盘价值风格超额显著,但风格间的波动在逐步加大,6 月大盘稳健类风格相对占优。量化选股及风险因子同样波动较大,整体看,质量、价值、低波动等"左侧"因子仍延续之前的较好表现;同时,随着经济的复苏,投资者在逐步拉长投资决策的"久期",反应个股长期投资价值的盈利、成长等因子表现逐步好转,特别是 6 月表现得尤为明显;科技创新、"中特估"等主题持续演绎,行业动量等因子表现较好。整体看,投资者对市场整体 Beta 和对细分板块 Beta 的阶段性追逐导致资金的聚集,增大了风格和 Alpha 策略的波动,也给指数增强产品的风险控制带来一定挑战。

报告期内,本基金遵循量化指数增强基金投资原则,相对业绩比较基准保持了相对均衡的行业配置和风格配置,选股因子整体有效,获得了一定的超额收益。未来将继续保持对量化选股模型的迭代更新,同时提高对市场风格变化的应对能力,提升超额收益的稳定性。本产品对标的中证 500 指数是 A 股市场的代表性宽基指数,具有鲜明的中盘平衡风格,具有较多细分领域的龙头公司,当前估值仍处于历史较低水平。展望未来,长期看"市值下沉"的趋势仍可能持续,量化模型仍有可能在中小盘风格的基础上获得超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2023 年 04 月 25 日变更注册为汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金。转型前,本报告期添富成长多因子股票 A 类份额净值增长率为-2.59%,同期业绩比较基准收益率为-1.86%。本报告期添富成长多因子股票 C 类份额净值增长率为-2.60%,同期业绩比较基准收益率为-1.86%。转型后,本报告期汇添富中证 500 指数增强 A 类份额净值增长率为 0.50%,同期业绩比较基准收益率为-3.21%。本报告期汇添富中证 500 指数增强 C 类份额净值增长率为 0.42%,同期业绩比较基准收益率为-3.21%。

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	2, 866, 254, 161. 94	93. 28
	其中: 股票	2, 866, 254, 161. 94	93. 28
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	190, 852, 315. 43	6. 21
8	其他资产	15, 522, 689. 28	0. 51
9	合计	3, 072, 629, 166. 65	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	13, 257, 957. 00	0. 43
В	采矿业	77, 214, 638. 27	2. 52
С	制造业	1, 508, 144, 717. 2 2	49. 28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88, 101, 358. 33	2. 88

Е	建筑业	35, 623, 516. 00	1. 16
F	批发和零售业	108, 355, 356. 19	3. 54
G	交通运输、仓储和邮政业	31, 914, 565. 66	1.04
Н	住宿和餐饮业	18, 411, 820. 00	0.60
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	120, 255, 826. 50	3. 93
J	金融业	219, 564, 440. 61	7. 17
K	房地产业	28, 273, 409. 96	0.92
L	租赁和商务服务业	19, 852, 618. 00	0.65
M	科学研究和技术服务业	18, 976, 866. 00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	15, 028, 949. 00	0.49
0	居民服务、修理和其他服务业	-	_
Р	教育	-	_
Q	卫生和社会工作	541, 408. 12	0.02
R	文化、体育和娱乐业	21, 194, 350. 40	0.69
S	综合	22, 810, 464. 00	0.75
	合计	2, 347, 522, 261. 2 6	76. 70

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	_	-
В	采矿业	8, 461, 340. 00	0. 28
С	制造业	380, 170, 130. 65	12. 42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20, 027, 117. 81	0. 65
Е	建筑业	7, 947, 559. 15	0. 26
F	批发和零售业	18, 908, 620. 98	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	21, 843, 489. 93	0.71
Н	住宿和餐饮业	8, 262, 696. 00	0. 27

Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	30, 943, 504. 35	1.01
J	金融业	1, 733, 913. 00	0.06
K	房地产业	5, 040, 287. 00	0. 16
L	租赁和商务服务业	2, 103, 149. 00	0.07
M	科学研究和技术服务业	1, 929, 221. 80	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	10, 700, 522. 15	0. 35
О	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	23, 782. 86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	_	-
S	综合	636, 566. 00	0.02
	合计	518, 731, 900. 68	16. 95

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	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300003	乐普医 疗	1, 266, 925	28, 645, 174. 25	0.94
2	600885	宏发股 份	897, 958	28, 599, 962. 30	0.93
3	002028	思源电气	530, 300	24, 775, 616. 00	0.81

4	002138	顺络电 子	1,009,100	24, 127, 581. 00	0.79
5	002273	水晶光电	1, 998, 181	23, 858, 281. 14	0.78
6	002444	巨星科 技	1, 072, 900	23, 475, 052. 00	0.77
7	000738	航发控 制	955, 118	23, 304, 879. 20	0.76
8	002373	千方科 技	1, 693, 100	23, 093, 884. 00	0.75
9	002465	海格通信	2, 215, 319	22, 906, 398. 46	0.75
10	002056	横店东磁	1, 236, 900	22, 523, 949. 00	0.74

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

		肌亜力			占基金资产		
序号	股票代码	股票名 称	数量(股)	公允价值 (元)	净值比例		
		炒			(%)		
1	601007	金陵饭	060 800	8 262 606 00	0. 27		
1	001007	店	909, 800	969, 800 8, 262, 696. 00		969, 800 8, 262, 696. 00 0. 2	0.21
2	603189	网达软	550, 900	8, 092, 721. 00	0. 26		
2	000103	件	550, 500	8, 092, 721. 00	0.20		
3	000417	合肥百	1, 577, 100	7, 380, 828. 00	0. 24		
0	000111	货		1, 000, 020. 00	0.21		
4	300439	美康生	641, 900	7, 259, 889. 00	0. 24		
1	000100	物	011, 300	1, 200, 000. 00	0.21		
5	600114	东睦股	947, 840	7, 222, 540. 80	0. 24		

100	

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:本基金本报告期未投资股指期货。

- 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 注:本基金本报告期未投资国债期货。

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,广州海格通信集团股份有限公司出现在报告编制目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	912, 710. 10
2	应收证券清算款	13, 477, 627. 94
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	1, 132, 351. 24
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	15, 522, 689. 28

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

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§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	2, 779, 230, 965. 05	92. 20
	其中:股票	2, 779, 230, 965. 05	92. 20
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	52, 513, 790. 59	1.74
	其中:债券	52, 513, 790. 59	1.74
	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	181, 688, 965. 75	6.03
8	其他资产	945, 607. 34	0.03
9	合计	3, 014, 379, 328. 73	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	16, 470, 924. 00	0. 55
В	采矿业	45, 018, 863. 33	1.50
С	制造业	1, 939, 547, 301. 4 0	64. 49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79, 000, 563. 41	2. 63
Е	建筑业	34, 109, 283. 52	1. 13
F	批发和零售业	104, 046, 447. 52	3. 46
G	交通运输、仓储和邮政业	62, 692, 515. 20	2. 08
Н	住宿和餐饮业	_	-
Ι	信息传输、软件和信息技术服务业	132, 148, 761. 29	4. 39
J	金融业	191, 219, 063. 14	6. 36
K	房地产业	32, 199, 724. 35	1.07
L	租赁和商务服务业	21, 411, 522. 00	0.71
M	科学研究和技术服务业	16, 562, 744. 92	0. 55
N	水利、环境和公共设施管理业	15, 300, 640. 03	0. 51
0	居民服务、修理和其他服务业	_	_
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	32, 040. 42	0.00
R	文化、体育和娱乐业	57, 685, 750. 52	1.92
S	综合	31, 784, 820. 00	1.06
	合计	2, 779, 230, 965. 0	92. 41

5.2.2 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。

- 5.3 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	002340	格林美	4, 017, 217	28, 281, 207. 68	0. 94
2	300003	乐普医	1, 130, 400	26, 507, 880. 00	0.88
3	002384	东山精 密	1, 048, 900	26, 201, 522. 00	0.87
4	601607	上海医药	1, 150, 740	25, 189, 698. 60	0.84
5	002439	启明星	680, 300	22, 790, 050. 00	0.76
6	688009	中国通号	3, 491, 300	22, 588, 711. 00	0.75
7	000009	中国宝安	2, 090, 500	22, 326, 540. 00	0.74
8	002078	太阳纸业	1, 903, 200	21, 886, 800. 00	0.73
9	600482	中国动力	1, 314, 093	21, 445, 997. 76	0.71
10	600820	隧道股	3, 307, 400	21, 266, 582. 00	0.71

	份		
			ì

5.4 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	_	-
2	央行票据	_	_
3	金融债券	50, 140, 983. 61	1. 67
	其中: 政策性金融债	50, 140, 983. 61	1. 67
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)	2, 372, 806. 98	0.08
8	同业存单	_	-
9	地方政府债	_	-
10	其他	_	-
11	合计	52, 513, 790. 59	1. 75

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

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	230301	23 进出	500,000	50, 140, 983. 61	1.67
2	113066	平煤转	16, 500	1, 970, 059. 32	0.07
3	123190	道氏转 02	4, 027	402, 747. 66	0.01

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:本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5. 11. 1

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

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	780, 122. 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	165, 485. 17
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_

8	其他	_
9	合计	945, 607. 34

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

注: 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6开放式基金份额变动(转型后)

单位: 份

项目	汇添富中证 500 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C	
基金合同生效日			
(2023年04月25	1, 515, 240, 799. 06	484, 457, 922. 62	
日)基金份额总额			
本报告期基金总申购	62, 738, 386. 01	26, 808, 147. 43	
份额	02, 130, 300. 01	20,000,147.40	
减:本报告期基金总	60, 513, 117. 23	3, 638, 390. 19	
赎回份额	00, 310, 111. 23	5, 000, 000. 13	
本报告期基金拆分变	_	_	
动份额			
本报告期期末基金份	1, 517, 466, 067. 84	507, 627, 679. 86	
额总额	1, 317, 400, 007. 04	501, 021, 013. 80	

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	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票C
本报告期期初基金	1, 535, 189, 026. 83	482, 180, 812. 25
份额总额	1, 000, 100, 020. 00	402, 100, 012. 23
本报告期基金总申	19, 199, 463. 35	2, 303, 732. 10
购份额	19, 199, 400. 33	2, 303, 132. 10
减:本报告期基金	39, 147, 691. 12	26, 621. 73
总赎回份额	39, 147, 091. 12	20, 021. 73
本报告期基金拆分	_	_
变动份额		
本报告期期末基金	1, 515, 240, 799. 06	484, 457, 922. 62

份额总额

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未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未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未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未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

		报告期	内持有基金份额变化	情况		报告期末持有基金	金情况
		持有基					
		金份额					
投资		比例达			赎回 份额		份额占 比(%)
者类	序号	到或者	期初份额	申购 份额		持有份额	
别	分写	超过	郑707707 创				
		20%的					
		时间区					
		间					
		2023					
		年4月	405, 685, 662. 97				
 机构	1	1日至		_	_	405, 685, 662. 97	20.03
<i>ለ</i> ን ቤ ተሩጋ		2023					
		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、巨额赎回的风险

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

3、基金规模较小导致的风险

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

4、基金净值大幅波动的风险

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

5、提前终止基金合同的风险

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

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成长多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件;
- 2、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》;
- 3、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金托管协议》;
- 4、《汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》;
- 5、《汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》;
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 7、报告期内汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金在规定报刊上披露的各项 公告;
 - 8、报告期内汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金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