

# 汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证 券投资基金 2023 年中期报告

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 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
§ 4 管理人报告 .....	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 .....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	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 .....	16
§ 5 托管人报告 .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	16
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	16
6.1 资产负债表 .....	16
6.2 利润表 .....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	20
§ 7 投资组合报告 .....	51
7.1 期末基金资产组合情况 .....	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	51
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 .....	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	76
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	78
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 .....	78
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 .....	78
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 .....	78
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 .....	78

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	78
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
7.12 投资组合报告附注.....	79
§ 8 基金份额持有人信息.....	80
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	80
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	80
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	81
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.....	81
§ 9 开放式基金份额变动.....	81
§ 10 重大事件揭示.....	81
10.1 基金份额持有人大会决议.....	81
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.....	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
10.4 基金投资策略的改变.....	82
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	82
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.....	82
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	82
10.8 其他重大事件.....	86
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
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.....	87
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
§ 12 备查文件目录.....	87
12.1 备查文件目录.....	87
12.2 存放地点.....	88
12.3 查阅方式.....	88

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证沪港深 500ETF
场内简称	HGS500
基金主代码	517080
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 02 月 01 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
报告期末基金份额总额（份）	661,166,000.00
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	2021 年 02 月 22 日

注：扩位证券简称：沪港深 500ETF 基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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	中证沪港深 500 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。本基金将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。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		李文	陈四清

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年01月01日 - 2023年06月30日)
本期已实现收益	-22,448,457.69
本期利润	1,928,239.00
加权平均基金份额本期利润	0.0028
本期加权平均净值利润率	0.37%
本期基金份额净值增长率	0.25%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	-167,277,628.14
期末可供分配基金份额利润	-0.2530
期末基金资产净值	493,888,371.86
期末基金份额净值	0.7470
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-25.30%

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	3.66%	0.94%	3.09%	0.93%	0.57%	0.01%
过去三个月	-2.71%	0.86%	-3.68%	0.87%	0.97%	-0.01%
过去六个月	0.25%	0.89%	-0.90%	0.88%	1.15%	0.01%
过去一年	-8.70%	1.08%	-11.31%	1.08%	2.61%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-25.30%	1.17%	-28.07%	1.20%	2.77%	-0.03%

#### 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

汇添富中证沪港深500ETF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（2021年02月01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。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。

2023 上半年，汇添富基金新成立 27 只公开募集证券投资基金，包括 10 只股票型基金、9 只混合型基金、8 只债券型基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 297 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		
董瑾	本基金的基金经理	2021 年 02 月 01 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

					<p>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 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</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>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</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。</p> <p>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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,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 25 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 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

根据国家统计局数据，上半年国内生产总值同比增长 5.5%，比一季度加快 1.0 个百分点。其中，全国规模以上工业增加值同比增长 3.8%，服务业增加值同比增长 6.4%，社会消费品零售总额同比增长 8.2%，全国固定资产投资同比增长 3.8%。上半年，经济运行总体上呈恢复态势。分项来看，工业生产有所恢复，消费逐步改善，投资方面基建和制造业仍是主要驱动因素，房地产对于经济增速仍有一定程度的拖累。

继一季度主题投资突出及结构性行情分化之后，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。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 0.25%。同期业绩比较基准收益率为-0.90%。

#### 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，经济有望继续恢复向好。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。

随着经济的恢复增长，权益市场有望迎来估值修复。风格上，复苏初期或以价值为主，后续随着行情演绎，成长可能重回主导。行业板块方面，数字经济及科技领域仍然体现出较强的动能。而新能源的基本面呈现企稳改善的态势，经过前期调整，当前估值低于历史中枢，具备一定的配置价值。

港股当前估值仍然较低，潜在弹性较大。若美元加息放缓或结束将较大的支持港股流动性。

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，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

#### 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；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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本基金 2023 年中期报告中财务指标、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：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	38,374,778.15	32,759,809.08
结算备付金		4,435,059.59	4,373,548.03
存出保证金		2,241,121.80	2,248,157.06
交易性金融资产	6.4.7.2	455,206,185.00	474,421,542.27
其中：股票投资		455,206,185.00	474,421,542.27
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		2,561,575.12	242.22
应收股利		1,111,662.19	17,150.62
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		503,930,381.85	513,820,449.28
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		9,735,301.35	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		62,985.16	65,637.32
应付托管费		20,995.04	21,879.11
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	222,728.44	247,301.07
负债合计		10,042,009.99	334,817.50
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	661,166,000.00	689,166,000.00
未分配利润	6.4.7.9	-167,277,628.14	-175,680,368.22
净资产合计		493,888,371.86	513,485,631.78
负债和净资产总计		503,930,381.85	513,820,449.28

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7470 元，基金份额总额 661,166,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>2,534,512.53</b>	<b>-41,812,367.22</b>
1. 利息收入		97,618.68	111,865.28
其中：存款利息收入	6.4.7.10	97,618.68	110,491.34
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		-	-
证券出借利息收入		-	1,373.94
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-22,053,928.20	-20,334,806.79
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-27,268,515.27	-22,937,971.34
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	13,020.16	165,733.98
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-733,841.01	-3,696,322.45
股利收益	6.4.7.17	5,935,407.92	6,133,753.02
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	24,376,696.69	-21,745,247.44
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	114,125.36	155,821.73
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>606,273.53</b>	<b>686,738.09</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	385,344.50	437,537.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	128,448.17	145,845.96
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		0.02	35.20
8. 其他费用	6.4.7.21	92,480.84	103,319.07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,928,239.00</b>	<b>-42,499,105.31</b>

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,928,239.00	-42,499,105.31
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,928,239.00	-42,499,105.31

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	689,166,000.00	-175,680,368.22	513,485,631.78
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	689,166,000.00	-175,680,368.22	513,485,631.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28,000,000.00	8,402,740.08	-19,597,259.92
（一）、综合收益总额	-	1,928,239.00	1,928,239.00
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-28,000,000.00	6,474,501.08	-21,525,498.92
其中：1. 基金申购款	72,000,000.00	-18,353,693.01	53,646,306.99
2. 基金赎回款	-100,000,000.00	24,828,194.09	-75,171,805.91
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	661,166,000.00	-167,277,628.14	493,888,371.86

项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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(基金净值)	777,166,000.00	-99,102,835.97	678,063,164.03
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	777,166,000.00	-99,102,835.97	678,063,164.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-60,000,000.00	-31,262,184.41	-91,262,184.41
（一）、综合收益总额	-	-42,499,105.31	-42,499,105.31
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-60,000,000.00	11,236,920.90	-48,763,079.10
其中：1. 基金申购款	16,000,000.00	-2,808,100.26	13,191,899.74
2. 基金赎回款	-76,000,000.00	14,045,021.16	-61,954,978.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	717,166,000.00	-130,365,020.38	586,800,979.62

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：

张暉	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3528号文《关于准予汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2021 年 2 月 1 日生效。首次设立基金募集规模为 1,089,166,000.00 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（2021）验字第 60466941\_B19 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：中证沪港深 500 指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 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‰；

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

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

##### 2. 增值税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单

以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4. 企业所得税

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

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

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

### 5. 个人所得税

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

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

得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

#### 6. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	38,374,778.15
等于：本金	38,371,406.00
加：应计利息	3,372.15
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	38,374,778.15

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	585,395,625.97	-	455,206,185.00	130,189,440.97
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	585,395,625.97	-	455,206,185.00	130,189,440.97

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	18,193,500.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-

（股指期货投资）	18,193,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	18,193,500.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2312	IF2312	16	18,466,560.00	273,060.00
合计				273,060.00
减：可抵销期货暂收款				273,060.00
净额				-

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

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内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 2023 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	68,425.88
其中：交易所市场	68,425.88
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	94,795.19
应付信息披露费	59,507.37
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	-
其他	-
合计	222,728.44

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	689,166,000.00	689,166,000.00
本期申购	72,000,000.00	72,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-100,000,000.00	-100,000,000.00
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	661,166,000.00	661,166,000.00

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
本期期初	-56,612,761.35	-119,067,606.87	-175,680,368.22
本期利润	-22,448,457.69	24,376,696.69	1,928,239.00
本期基金份额交易产生的变动数	3,003,362.76	3,471,138.32	6,474,501.08
其中：基金申购款	-6,878,214.58	-11,475,478.43	-18,353,693.01
基金赎回款	9,881,577.34	14,946,616.75	24,828,194.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-76,057,856.28	-91,219,771.86	-167,277,628.14

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	58,755.24
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	38,817.04
其他	46.40
合计	97,618.68

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-21,828,121.66
股票投资收益——赎回差价收入	-5,440,393.61
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	-27,268,515.27

##### 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
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	61,138,667.10

减：卖出股票成本总额	82,769,432.69
减：交易费用	197,356.07
买卖股票差价收入	-21,828,121.66

#### 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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	75,171,805.91
减：现金支付赎回款总额	48,252,040.91
减：赎回股票成本总额	32,360,158.61
减：交易费用	-
赎回差价收入	-5,440,393.61

#### 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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	14.40
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	13,005.76
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	13,020.16

##### 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
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	86,423.92
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	73,400.00
减：应计利息总额	14.71
减：交易费用	3.45
买卖债券差价收入	13,005.76

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-733,841.01
外汇期货投资收益	-
国债期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,935,407.92
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	5,935,407.92

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	23,712,196.69
——股票投资	23,712,196.69
——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	664, 500. 00
——权证投资	-
——期货投资	664, 500. 00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	24, 376, 696. 69

#### 6. 4. 7. 19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	114, 125. 36
其他	-
合计	114, 125. 36

#### 6. 4. 7. 20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6. 4. 7. 21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	24, 795. 19
信息披露费	59, 507. 37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	210. 00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	7, 968. 28
合计	92, 480. 84

## 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
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	57,558.21	0.05	39,071.57	0.04

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交	成交金额	占当期债券成交

		总额的比例 (%)		总额的比例 (%)
东方证券	-	-	90,955.10	7.75

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	41.53	0.05	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	30.10	0.04	19.62	0.04

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	385,344.50	437,537.86
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	128,448.17	145,845.96

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限

费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	38,374,778.15	58,755.24	38,236,248.32	70,980.82

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
				-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	600958	东方证券	原股东优先配售	17,724.00	149,945.04

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券，和基金托管人工商银行发行的股票工商银行。于

本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 66,624.00 股，持有工商银行 1,660,800.00 股。（于上年度可比期间，本基金按照指数权重比例持有东方证券 74,524.00 股，持有工商银行 1,842,600.00 股。）

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。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（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	640	7,603.20	13,452.80	
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	

		日		限						
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	
601061	中信金属	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,600	10,528.00	12,128.00	
601065	江西省盐业集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	88	911.68	1,041.92	
601133	柏诚系统股份公司	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	443	5,165.38	5,431.18	
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	502	8,935.60	8,980.78	
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	
601916	浙商银行	2023年06月	7个交易日	配股流通	2.02	2.64	39,780	80,355.60	105,019.20	

		27 日	日	受 限						
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代 码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代 码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
					-	-	-	-	-	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股 票 名 称	停 牌 日 期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 （ 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
00813	世茂集团	2022年04月01日	重大事项停牌	-	2023年07月31日	1.83	23,500	431,119.02	-	
03333	中国恒大	2022年03月21日	重大事项停牌	-	2023年08月28日	0.20	33,000	414,714.54	-	
06666	恒大物业	2022年03月21日	重大事项	-	2023年08月03日	1.34	70,000	499,176.43	-	

			停牌							
--	--	--	----	--	--	--	--	--	--	--

### 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 2023 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 2023 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 2023 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 2023 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							
银行存款	38,374,778.15	-	-	-	-	-	38,374,778.15
结算备付金	4,435,059.59	-	-	-	-	-	4,435,059.59
存出保证金	25,134.60	-	-	-	-	2,215,987.20	2,241,121.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	455,206,185.00	455,206,185.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,561,575.12	2,561,575.12
应收股利	-	-	-	-	-	1,111,662.19	1,111,662.19
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	42,834,972.34	-	-	-	-	461,095,409.51	503,930,381.85
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	-	-	-	-	-	9,735,301.35	9,735,301.35
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	62,985.16	62,985.16
应付托管费	-	-	-	-	-	20,995.04	20,995.04
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	-	-	-	-	-	222,728.44	222,728.44
负债总计	-	-	-	-	-	10,042,009.99	10,042,009.99
利率敏感度缺口	42,834,972.34	-	-	-	-	451,053,399.52	493,888,371.86
上年度末 2022 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							
银行存款	32,759,809.08	-	-	-	-	-	32,759,809.08
结算备付金	4,373,548.03	-	-	-	-	-	4,373,548.03
存出保证金	4,521.86	-	-	-	-	2,243,635.20	2,248,157.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	474,421,542.27	474,421,542.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	242.22	242.22
应收	-	-	-	-	-	17,150.62	17,150.62

股利							
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	37,137,878.97	-	-	-	-	476,682,570.31	513,820,449.28
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	-	-	-	-	-	65,637.32	65,637.32
应付 托管 费	-	-	-	-	-	21,879.11	21,879.11
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	-	-	-	-	-	247,301.07	247,301.07
负债 总计	-	-	-	-	-	334,817.50	334,817.50
利率 敏感 度缺 口	37,137,878.97	-	-	-	-	476,347,752.81	513,485,631.78

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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	美元折合 人民币	港币折合人民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币计 价的资产				

银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	192,635,367.41	-	192,635,367.41
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	-	1,111,662.19	-	1,111,662.19
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	193,747,029.60	-	193,747,029.60
以外币计价的负债				
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	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇率风险敞口净额	-	193,747,029.60	-	193,747,029.60
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	201,861,963.98	-	201,861,963.98
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	-	17,150.62	-	17,150.62
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	201,879,114.60	-	201,879,114.60
以外币计价的负债				
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	-	-	-	-
应付托管 费	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债 表外汇风 险敞口净 额	-	201,879,114.60	-	201,879,114.60

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	9,687,351.48	10,093,955.73
港币相对人民币贬值 5%	-9,687,351.48	-10,093,955.73	

#### 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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	455,206,185.00	92.17	474,421,542.27	92.39
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	455,206,185.00	92.17	474,421,542.27	92.39

#### 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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证沪港深 500 指数上涨 5%	24,508,470.98	25,131,690.85
	中证沪港深 500 指数下跌 5%	-24,508,470.98	-25,131,690.85

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 2023年06月30日
第一层次	455,013,808.70
第二层次	105,019.20
第三层次	87,357.10
合计	455,206,185.00

###### 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，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	455,206,185.00	90.33
	其中：股票	455,206,185.00	90.33
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	42,809,837.74	8.50
8	其他各项资产	5,914,359.11	1.17
9	合计	503,930,381.85	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 192,635,367.41 元，占期末净值比例为 39%。此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”章节的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,720,321.00	0.55
B	采矿业	9,857,800.00	2.00
C	制造业	152,420,080.93	30.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,523,047.00	1.52
E	建筑业	5,745,944.60	1.16
F	批发和零售业	1,049,157.00	0.21

G	交通运输、仓储和邮政业	5,837,865.00	1.18
H	住宿和餐饮业	258,274.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,815,788.47	2.80
J	金融业	52,159,447.80	10.56
K	房地产业	3,630,023.00	0.73
L	租赁和商务服务业	2,261,477.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	2,796,412.60	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	119,068.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,677,643.25	0.34
R	文化、体育和娱乐业	608,014.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	262,480,363.65	53.15

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	20,003.52	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	7,806.69	0.00
F	批发和零售业	27,164.26	0.01
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	90,421.94	0.02

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	6,997,800.54	1.42
15 原材料	1,416,235.04	0.29
20 工业	7,699,961.16	1.56
25 可选消费	28,668,990.23	5.80
30 日常消费	9,037,801.15	1.83
35 医疗保健	6,761,181.73	1.37
40 金融	66,867,562.97	13.54
45 信息技术	7,606,524.02	1.54
50 电信服务	39,225,985.76	7.94
55 公用事业	6,853,081.96	1.39
60 房地产	11,500,242.85	2.33
合计	192,635,367.41	39.00

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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	00700	腾讯控股	93,600	28,616,193.96	5.79
2	00005	汇丰控股	282,000	15,859,899.96	3.21
3	600519	贵州茅台	7,900	13,358,900.00	2.70
4	01299	友邦保险	161,600	11,785,264.67	2.39
5	601318	中国平安	139,600	6,477,440.00	1.31
5	02318	中国平安	104,000	4,779,913.11	0.97
6	03690	美团-W	87,020	9,812,214.56	1.99

7	00939	建设银行	1,676,000	7,834,359.09	1.59
7	601939	建设银行	85,800	537,108.00	0.11
8	00941	中国移动	114,000	6,732,021.37	1.36
8	600941	中国移动	11,500	1,072,950.00	0.22
9	300750	宁德时代	33,640	7,696,495.60	1.56
10	600036	招商银行	159,100	5,212,116.00	1.06
10	03968	招商银行	64,000	2,100,639.23	0.43
11	01398	工商银行	1,210,000	4,663,190.44	0.94
11	601398	工商银行	450,800	2,172,856.00	0.44
12	01211	比亚迪股份	15,000	3,457,425.00	0.70
12	002594	比亚迪	11,600	2,995,932.00	0.61
13	00388	香港交易所	17,700	4,817,382.38	0.98
14	03988	中国银行	1,165,000	3,372,695.04	0.68
14	601988	中国银行	271,900	1,063,129.00	0.22
15	000858	五粮液	24,899	4,072,729.43	0.82
16	000333	美的集团	63,400	3,735,528.00	0.76
17	601899	紫金矿业	212,000	2,410,440.00	0.49
17	02899	紫金矿业	80,000	848,221.60	0.17
18	601328	交通银行	353,500	2,050,300.00	0.42
18	03328	交通银行	244,000	1,167,558.59	0.24
19	600028	中国石化	244,500	1,555,020.00	0.31
19	00386	中国石油化工股份	346,000	1,464,233.32	0.30

20	00883	中国海洋石油	249,000	2,571,217.82	0.52
20	600938	中国海油	22,900	414,948.00	0.08
21	600030	中信证券	125,375	2,479,917.50	0.50
21	06030	中信证券	36,475	477,534.93	0.10
22	601166	兴业银行	186,900	2,924,985.00	0.59
23	600900	长江电力	125,800	2,775,148.00	0.56
24	600276	恒瑞医药	57,400	2,749,460.00	0.56
25	601288	农业银行	410,400	1,448,712.00	0.29
25	01288	农业银行	428,000	1,215,390.92	0.25
26	00857	中国石油股份	294,000	1,469,156.69	0.30
26	601857	中国石油	145,900	1,089,873.00	0.22
27	688981	中芯国际	25,100	1,268,052.00	0.26
27	00981	中芯国际	67,000	1,260,162.26	0.26
28	02888	渣打集团	39,250	2,439,051.99	0.49
29	01810	小米集团-W	244,000	2,411,604.65	0.49
30	09987	百胜中国	5,800	2,361,448.93	0.48
31	601088	中国神华	42,400	1,303,800.00	0.26
31	01088	中国神华	47,000	1,037,826.79	0.21
32	300059	东方财富	163,254	2,318,206.80	0.47
33	600887	伊利股份	81,700	2,313,744.00	0.47
34	09633	农夫山泉	56,200	2,241,010.69	0.45
35	601012	隆基绿能	78,131	2,240,015.77	0.45

36	00016	新鸿基地产	24,500	2,229,485.94	0.45
37	02015	理想汽车-W	17,500	2,186,245.08	0.44
38	600309	万华化学	24,100	2,116,944.00	0.43
39	000651	格力电器	57,900	2,113,929.00	0.43
40	002475	立讯精密	64,400	2,089,780.00	0.42
41	01024	快手-W	42,200	2,083,499.62	0.42
42	600690	海尔智家	48,900	1,148,172.00	0.23
42	06690	海尔智家	39,600	899,981.56	0.18
43	02269	药明生物	59,000	2,042,600.59	0.41
44	00669	创科实业	25,500	2,001,918.22	0.41
45	002415	海康威视	60,300	1,996,533.00	0.40
46	02628	中国人寿	103,000	1,240,229.06	0.25
46	601628	中国人寿	21,600	755,136.00	0.15
47	000725	京东方A	482,600	1,973,834.00	0.40
48	000568	泸州老窖	9,300	1,949,001.00	0.39
49	000063	中兴通讯	40,900	1,862,586.00	0.38
50	601601	中国太保	44,000	1,143,120.00	0.23
50	02601	中国太保	38,400	716,931.65	0.15
51	300760	迈瑞医疗	6,000	1,798,800.00	0.36
52	06160	百济神州	17,400	1,722,959.34	0.35
53	00001	长和	37,500	1,654,377.86	0.33
54	00027	银河娱乐	36,000	1,649,606.62	0.33

55	603259	药明康德	26,260	1,636,260.60	0.33
56	002230	科大讯飞	23,700	1,610,652.00	0.33
57	00002	中电控股	28,500	1,600,234.59	0.32
58	300274	阳光电源	13,400	1,562,842.00	0.32
59	601668	中国建筑	270,000	1,549,800.00	0.31
60	300124	汇川技术	23,850	1,531,408.50	0.31
61	002714	牧原股份	35,240	1,485,366.00	0.30
62	01109	华润置地	48,000	1,469,267.33	0.30
63	02020	安踏体育	19,600	1,446,568.18	0.29
64	01658	邮储银行	167,000	742,138.58	0.15
64	601658	邮储银行	143,000	699,270.00	0.14
65	002352	顺丰控股	31,600	1,424,844.00	0.29
66	02331	李宁	36,500	1,418,443.18	0.29
67	000001	平安银行	124,500	1,398,135.00	0.28
68	601888	中国中免	12,500	1,381,625.00	0.28
69	002129	TCL 中环	41,450	1,376,140.00	0.28
70	000792	盐湖股份	69,900	1,339,983.00	0.27
71	02388	中银香港	59,000	1,302,803.84	0.26
72	002142	宁波银行	51,200	1,295,360.00	0.26
73	601138	工业富联	51,200	1,290,240.00	0.26
74	600031	三一重工	76,500	1,272,195.00	0.26
75	300498	温氏股份	67,300	1,234,955.00	0.25
76	000002	万科	87,600	1,228,152.00	0.25

		A			
77	600048	保利发展	92,400	1,203,972.00	0.24
78	01113	长实集团	30,000	1,200,417.96	0.24
79	600016	民生银行	319,400	1,197,750.00	0.24
80	02319	蒙牛乳业	44,000	1,196,730.04	0.24
81	600438	通威股份	34,800	1,193,988.00	0.24
82	600406	国电南瑞	51,562	1,191,082.20	0.24
83	688111	金山办公	2,500	1,180,550.00	0.24
84	600050	中国联通	245,000	1,176,000.00	0.24
85	600837	海通证券	124,500	1,147,890.00	0.23
86	600436	片仔癀	4,000	1,145,440.00	0.23
87	00168	青岛啤酒股份	10,000	656,449.76	0.13
87	600600	青岛啤酒	4,700	487,061.00	0.10
88	00291	华润啤酒	24,000	1,141,780.03	0.23
89	601728	中国电信	199,500	1,123,185.00	0.23
90	600919	江苏银行	152,500	1,120,875.00	0.23
91	600089	特变电工	50,000	1,114,500.00	0.23
92	600809	山西汾酒	6,020	1,114,121.40	0.23
93	002371	北方华创	3,500	1,111,775.00	0.23
94	300015	爱尔眼科	59,715	1,107,713.25	0.22
95	01928	金沙中国有限公司	44,800	1,102,835.60	0.22
96	600000	浦发银行	151,500	1,096,860.00	0.22

97	00011	恒生银行	10,600	1,089,688.16	0.22
98	600585	海螺水泥	31,000	735,940.00	0.15
98	00914	海螺水泥	18,000	345,189.31	0.07
99	00267	中信股份	122,000	1,051,702.59	0.21
100	603501	韦尔股份	10,595	1,038,733.80	0.21
101	601766	中国中车	156,300	1,015,950.00	0.21
102	603288	海天味业	21,595	1,011,725.75	0.20
103	002304	洋河股份	7,600	998,260.00	0.20
104	601390	中国中铁	131,400	996,012.00	0.20
105	02688	新奥能源	11,000	989,837.73	0.20
106	600905	三峡能源	183,900	987,543.00	0.20
107	00003	香港中华煤气	155,700	971,848.98	0.20
108	00688	中国海外发展	61,000	960,592.52	0.19
109	300014	亿纬锂能	15,800	955,900.00	0.19
110	600150	中国船舶	28,600	941,226.00	0.19
111	000938	紫光股份	29,500	939,575.00	0.19
112	002466	天齐锂业	13,300	929,803.00	0.19
113	601688	华泰证券	66,300	912,951.00	0.18
114	601225	陕西煤业	49,800	905,862.00	0.18
115	01997	九龙仓置业	25,000	902,387.93	0.18
116	688012	中微半导体设备	5,700	891,765.00	0.18
117	002459	晶澳科技	21,376	891,379.20	0.18

		技			
118	603986	兆易创新	8,380	890,375.00	0.18
119	002460	赣锋锂业	14,560	887,577.60	0.18
120	002027	分众传媒	129,200	879,852.00	0.18
121	601169	北京银行	189,200	875,996.00	0.18
122	000338	潍柴动力	69,900	870,954.00	0.18
123	600570	恒生电子	19,640	869,855.60	0.18
124	02313	申洲国际	12,600	868,366.86	0.18
125	00066	港铁公司	26,000	862,973.28	0.17
126	601985	中国核电	120,800	851,640.00	0.17
127	600104	上汽集团	59,800	847,366.00	0.17
128	002050	三花智控	27,700	838,202.00	0.17
129	01093	石药集团	132,000	828,786.26	0.17
130	000625	长安汽车	63,736	824,106.48	0.17
131	601211	国泰君安	58,100	812,819.00	0.16
132	06618	京东健康	17,700	806,976.82	0.16
133	01171	兖矿能源	22,000	455,365.92	0.09
133	600188	兖矿能源	11,600	347,072.00	0.07
134	002049	紫光国微	8,600	801,950.00	0.16
135	00006	电能实业	21,000	794,792.86	0.16
136	600111	北方稀土	32,500	779,350.00	0.16
137	09868	小鹏汽车-W	16,900	779,073.10	0.16

138	02382	舜宇光学科技	10,700	770,964.29	0.16
139	02328	中国财险	96,000	770,922.80	0.16
140	00992	联想集团	102,000	768,322.81	0.16
141	603019	中科曙光	15,000	763,500.00	0.15
142	601919	中远海控	81,200	763,280.00	0.15
143	000100	TCL 科技	192,170	757,149.80	0.15
144	603799	华友钴业	16,450	755,219.50	0.15
145	002179	中航光电	16,382	742,923.70	0.15
146	600660	福耀玻璃	20,700	742,095.00	0.15
147	00175	吉利汽车	84,000	740,386.82	0.15
148	601818	光大银行	238,000	730,660.00	0.15
149	601229	上海银行	127,000	730,250.00	0.15
150	600009	上海机场	16,000	726,720.00	0.15
151	00998	中信银行	145,000	491,968.53	0.10
151	601998	中信银行	39,000	233,220.00	0.05
152	600893	航发动力	17,100	722,646.00	0.15
153	002812	恩捷股份	7,400	712,990.00	0.14
154	601989	中国重工	147,000	708,540.00	0.14
155	002271	东方雨虹	25,850	704,671.00	0.14
156	002555	三七互娱	20,100	701,088.00	0.14
157	300122	智飞生物	15,400	680,680.00	0.14
158	600958	东方证券	66,624	646,252.80	0.13

159	600999	招商证券	47,600	645,932.00	0.13
160	600019	宝钢股份	114,900	645,738.00	0.13
161	000977	浪潮信息	13,200	640,200.00	0.13
162	600760	中航沈飞	14,088	633,960.00	0.13
163	00020	商汤-W	327,000	624,079.04	0.13
164	00960	龙湖集团	35,500	623,184.72	0.13
165	300896	爱美客	1,400	622,930.00	0.13
166	00968	信义光能	74,000	617,450.01	0.13
167	688036	传音控股	4,200	617,400.00	0.13
168	688599	天合光能	14,400	613,584.00	0.12
169	002709	天赐材料	14,800	609,612.00	0.12
170	688008	澜起科技	10,600	608,652.00	0.12
171	00322	康师傅控股	54,000	606,404.69	0.12
172	600426	华鲁恒升	19,180	587,483.40	0.12
173	000661	长春高新	4,300	586,090.00	0.12
174	300316	晶盛机电	8,200	581,380.00	0.12
175	601186	中国铁建	58,900	580,165.00	0.12
176	002602	世纪华通	76,400	579,876.00	0.12
177	601360	三六零	46,200	579,348.00	0.12
178	002920	德赛西威	3,700	576,497.00	0.12
179	600584	长电科技	18,400	573,528.00	0.12
180	601006	大秦铁路	76,900	571,367.00	0.12
181	01801	信达生	20,500	559,457.46	0.11

		物			
182	000776	广发证 券	38,000	558,980.00	0.11
183	600522	中天科 技	35,100	558,441.00	0.11
184	002410	广联达	17,160	557,528.40	0.11
185	601600	中国铝 业	101,400	556,686.00	0.11
186	300142	沃森生 物	20,800	550,160.00	0.11
187	002241	歌尔股 份	30,700	544,925.00	0.11
188	000596	古井贡 酒	2,200	544,236.00	0.11
189	601377	兴业证 券	88,400	541,008.00	0.11
190	01929	周大福	41,600	540,029.50	0.11
191	600745	闻泰科 技	11,000	537,900.00	0.11
192	600547	山东黄 金	22,900	537,692.00	0.11
193	600588	用友网 络	26,200	537,100.00	0.11
194	01821	ESR	43,000	532,830.68	0.11
195	000166	申万宏 源	115,200	532,224.00	0.11
196	601009	南京银 行	65,900	527,200.00	0.11
197	600011	华能国 际	56,800	525,968.00	0.11
198	00788	中国铁 塔	652,000	522,983.94	0.11
199	600010	包钢股 份	290,200	519,458.00	0.11
200	001979	招商蛇 口	39,400	513,382.00	0.10
201	300450	先导智 能	14,040	507,826.80	0.10
202	300408	三环集 团	17,300	507,755.00	0.10
203	601669	中国电 建	88,100	505,694.00	0.10
204	03800	协鑫科	302,000	503,972.71	0.10

		技			
205	600196	复星医药	16,300	503,670.00	0.10
206	00083	信和置业	56,000	497,205.37	0.10
207	601800	中国交建	45,500	496,405.00	0.10
208	603659	璞泰来	12,986	496,324.92	0.10
209	600085	同仁堂	8,600	495,016.00	0.10
210	01177	中国生物制药	157,000	493,600.43	0.10
211	06862	海底捞	31,000	492,742.99	0.10
212	002311	海大集团	10,500	491,820.00	0.10
213	300033	同花顺	2,800	490,784.00	0.10
214	600886	国投电力	38,300	484,495.00	0.10
215	603993	洛阳钼业	90,500	482,365.00	0.10
216	000963	华东医药	11,100	481,407.00	0.10
217	000768	中航西飞	17,900	478,825.00	0.10
218	300782	卓胜微	4,936	476,965.68	0.10
219	000538	云南白药	9,020	473,369.60	0.10
220	00288	万洲国际	123,500	472,537.80	0.10
221	00019	太古股份公司 A	8,500	470,601.64	0.10
222	601689	拓普集团	5,800	468,060.00	0.09
223	000733	振华科技	4,800	460,080.00	0.09
224	600845	宝信软件	9,027	458,661.87	0.09
225	00836	华润电力	28,000	456,933.29	0.09
226	002340	格林美	66,100	456,751.00	0.09
227	601100	恒立液压	7,100	456,743.00	0.09
228	002493	荣盛石	39,190	456,171.60	0.09

		化			
229	002384	东山精密	17,600	455,840.00	0.09
230	00881	中升控股	16,500	455,619.47	0.09
231	002252	上海莱士	60,400	453,604.00	0.09
232	300347	泰格医药	7,000	451,780.00	0.09
233	00868	信义玻璃	40,000	449,926.24	0.09
234	01876	百威亚太	24,000	446,975.90	0.09
235	600015	华夏银行	82,100	444,161.00	0.09
236	601916	浙商银行	167,980	443,467.20	0.09
237	600926	杭州银行	37,700	442,975.00	0.09
238	002180	纳思达	12,800	438,400.00	0.09
239	600795	国电电力	113,900	436,237.00	0.09
240	600176	中国巨石	30,736	435,221.76	0.09
241	600372	中航电子	28,616	434,390.88	0.09
242	600732	爱旭股份	14,120	434,190.00	0.09
243	03888	金山软件	15,200	432,334.86	0.09
244	000157	中联重科	63,700	429,975.00	0.09
245	00012	恒基地产	20,000	429,642.68	0.09
246	600674	川投能源	28,500	428,925.00	0.09
247	09626	哔哩哔哩-W	3,980	428,228.36	0.09
248	002236	大华股份	21,600	426,600.00	0.09
249	300012	华测检测	21,800	425,100.00	0.09
250	603369	今世缘	7,900	417,120.00	0.08

251	600115	中国东航	87,400	416,024.00	0.08
252	600029	南方航空	68,800	414,864.00	0.08
253	00762	中国联通	86,000	410,723.65	0.08
254	000425	徐工机械	60,600	410,262.00	0.08
255	300496	中科创达	4,200	404,670.00	0.08
256	601066	中信建投	16,700	404,140.00	0.08
257	000301	东方盛虹	34,000	401,880.00	0.08
258	00151	中国旺旺	83,000	397,926.57	0.08
259	601633	长城汽车	15,800	397,686.00	0.08
260	603345	安井食品	2,700	396,360.00	0.08
261	00916	龙源电力	47,000	349,697.79	0.07
261	001289	龙源电力	2,000	45,000.00	0.01
262	601995	中金公司	11,100	394,272.00	0.08
263	601788	光大证券	24,800	394,072.00	0.08
264	601336	新华保险	10,700	393,439.00	0.08
265	688777	中控技术	6,235	391,433.30	0.08
266	601117	中国化学	47,000	389,160.00	0.08
267	601868	中国能建	166,100	388,674.00	0.08
268	600346	恒力石化	26,900	385,477.00	0.08
269	600702	舍得酒业	3,100	384,245.00	0.08
270	01038	长江基建集团	10,000	382,160.71	0.08
271	300003	乐普医疗	16,900	382,109.00	0.08

272	002074	国轩高科	13,800	381,156.00	0.08
273	601877	正泰电器	13,700	378,805.00	0.08
274	00384	中国燃气	45,800	378,773.36	0.08
275	002202	金风科技	35,600	378,072.00	0.08
276	00268	金蝶国际	39,000	376,831.67	0.08
277	600741	华域汽车	20,400	376,584.00	0.08
278	002841	视源股份	5,600	374,304.00	0.08
279	300454	深信服	3,300	373,725.00	0.08
280	00017	新世界发展	21,000	373,291.26	0.08
281	002821	凯莱英	3,140	370,080.40	0.07
282	601111	中国国航	44,700	368,328.00	0.07
283	688396	华润微电子	7,000	366,870.00	0.07
284	601618	中国中冶	91,500	363,255.00	0.07
285	002001	新和成	23,500	361,900.00	0.07
286	688126	上海硅产业集团	17,300	361,570.00	0.07
287	688223	晶科能源	25,700	361,342.00	0.07
288	300037	新宙邦	6,900	358,041.00	0.07
289	601555	东吴证券	51,190	355,258.60	0.07
290	600989	宝丰能源	28,100	354,341.00	0.07
291	300661	圣邦股份	4,287	352,091.31	0.07
292	01066	威高股份	37,200	351,208.00	0.07
293	601838	成都银行	28,600	349,206.00	0.07
294	603806	福斯特	9,375	348,656.25	0.07

295	601615	明阳智能	20,600	347,728.00	0.07
296	600765	中航重机	13,100	347,281.00	0.07
297	01209	华润万象生活	9,600	344,304.21	0.07
298	601901	方正证券	52,600	344,004.00	0.07
299	688303	大全能源	8,500	343,825.00	0.07
300	00135	昆仑能源	60,000	340,763.81	0.07
301	000066	中国长城	24,600	340,218.00	0.07
302	000876	新希望	29,000	338,720.00	0.07
303	603392	万泰生物	5,060	337,856.20	0.07
304	000807	云铝股份	26,500	337,345.00	0.07
305	605117	德业股份	2,240	334,992.00	0.07
306	600885	宏发股份	10,460	333,151.00	0.07
307	688122	西部超导	5,960	332,150.80	0.07
308	600039	四川路桥	33,660	330,204.60	0.07
309	00241	阿里健康	76,000	330,031.96	0.07
310	603260	合盛硅业	4,700	329,094.00	0.07
311	300769	德方纳米	2,960	326,280.80	0.07
312	002648	卫星化学	21,798	326,098.08	0.07
313	600460	士兰微	10,700	323,889.00	0.07
314	000895	双汇发展	13,200	323,268.00	0.07
315	300413	芒果超媒	9,400	321,574.00	0.07
316	688099	晶晨半导体	3,800	320,416.00	0.06

317	002736	国信证 券	36,700	320,391.00	0.06
318	600233	圆通速 递	21,900	318,864.00	0.06
319	601607	上海医 药	14,200	318,222.00	0.06
320	000786	北新建 材	12,900	316,179.00	0.06
321	000999	华润三 九	5,200	315,432.00	0.06
322	01193	华润燃 气	12,700	313,805.11	0.06
323	002007	华兰生 物	14,000	313,740.00	0.06
324	300207	欣旺达	19,200	313,344.00	0.06
325	003816	中国广 核	100,500	312,555.00	0.06
326	300146	汤臣倍 健	13,000	311,740.00	0.06
327	00004	九龙仓 集团	18,000	309,010.82	0.06
328	300751	迈为股 份	1,820	308,271.60	0.06
329	06098	碧桂园 服务	33,000	307,904.44	0.06
330	02618	京东物 流	27,200	306,451.40	0.06
331	002601	龙佰集 团	18,500	305,250.00	0.06
332	01044	恒安国 际	10,000	304,253.40	0.06
333	601108	财通证 券	41,470	300,242.80	0.06
334	300999	金龙鱼	7,500	299,925.00	0.06
335	603605	珀莱雅	2,660	298,984.00	0.06
336	002625	光启技 术	19,500	297,570.00	0.06
337	300433	蓝思科 技	25,300	297,528.00	0.06
338	601727	上海电 气	65,100	297,507.00	0.06
339	600132	重庆啤 酒	3,200	294,912.00	0.06

340	601238	广汽集团	28,300	294,886.00	0.06
341	01548	金斯瑞生物科技	18,000	292,083.26	0.06
342	601233	桐昆股份	22,000	291,500.00	0.06
343	01972	太古地产	16,400	291,220.29	0.06
344	600763	通策医疗	3,000	290,580.00	0.06
345	600383	金地集团	40,300	290,563.00	0.06
346	600027	华电国际	43,200	289,008.00	0.06
347	000783	长江证券	49,700	288,260.00	0.06
348	300144	宋城演艺	23,100	286,440.00	0.06
349	601077	渝农商行	79,400	285,046.00	0.06
350	300759	康龙化成	7,400	283,272.00	0.06
351	300223	北京君正	3,200	282,592.00	0.06
352	600096	云天化	16,500	281,655.00	0.06
353	600332	白云山	8,800	280,544.00	0.06
354	02007	碧桂园	191,000	279,996.11	0.06
355	603882	金域医学	3,700	279,350.00	0.06
356	002385	大北农	42,300	279,180.00	0.06
357	00101	恒隆地产	25,000	278,898.95	0.06
358	002008	大族激光	10,600	277,720.00	0.06
359	06110	滔搏	44,000	275,450.74	0.06
360	600298	安琪酵母	7,600	275,196.00	0.06
361	002603	以岭药业	10,700	274,883.00	0.06
362	00270	粤海投资	44,000	274,233.73	0.06
363	603688	石英股	2,400	273,216.00	0.06

		份			
364	00285	比亚迪 电子	12,500	273,136.58	0.06
365	300073	当升科 技	5,400	271,782.00	0.06
366	600219	南山铝 业	89,900	271,498.00	0.05
367	300763	锦浪科 技	2,600	270,660.00	0.05
368	000799	酒鬼酒	3,000	270,450.00	0.05
369	603606	东方电 缆	5,500	269,665.00	0.05
370	002756	永兴材 料	4,240	265,466.40	0.05
371	600875	东方电 气	14,200	264,830.00	0.05
372	605358	立昂微	7,200	264,456.00	0.05
373	300390	天华新 能	7,380	264,204.00	0.05
374	000983	山西焦 煤	29,000	263,900.00	0.05
375	601865	福莱特	6,800	261,868.00	0.05
376	09688	再鼎医 药	13,500	261,381.33	0.05
377	600705	中航产 融	67,500	258,525.00	0.05
378	600754	锦江酒 店	6,100	258,274.00	0.05
379	688063	派能科 技	1,300	257,725.00	0.05
380	002568	百润股 份	7,000	254,450.00	0.05
381	06186	中国飞 鹤	63,000	253,249.47	0.05
382	000723	美锦能 源	33,400	251,836.00	0.05
383	002240	盛新锂 能	7,900	251,773.00	0.05
384	002600	领益智 造	36,400	251,524.00	0.05
385	600362	江西铜 业	13,200	250,536.00	0.05
386	01308	海丰国	19,000	250,501.97	0.05

		际			
387	603816	顾家家居	6,550	249,882.50	0.05
388	601699	潞安环能	15,300	249,696.00	0.05
389	603939	益丰药房	6,744	249,528.00	0.05
390	600918	中泰证券	35,900	248,069.00	0.05
391	300832	新产业	4,200	247,800.00	0.05
392	600563	法拉电子	1,800	247,140.00	0.05
393	603613	国联股份	6,670	246,323.10	0.05
394	601878	浙商证券	24,600	243,048.00	0.05
395	601872	招商轮船	41,500	240,285.00	0.05
396	600160	巨化股份	17,300	238,394.00	0.05
397	601319	中国人保	40,700	237,688.00	0.05
398	300628	亿联网络	6,760	237,073.20	0.05
399	603589	口子窖	4,800	236,880.00	0.05
400	603290	斯达半导	1,100	236,720.00	0.05
401	600061	国投资本	33,000	234,960.00	0.05
402	601799	星宇股份	1,900	234,840.00	0.05
403	000617	中油资本	32,300	233,529.00	0.05
404	603486	科沃斯	3,000	233,310.00	0.05
405	688363	华熙生物	2,600	231,816.00	0.05
406	03311	中国建筑国际	28,000	230,531.88	0.05
407	601696	中银证券	21,600	230,256.00	0.05
408	603833	欧派家居	2,400	229,920.00	0.05
409	000069	华侨城	52,200	229,680.00	0.05

		A			
410	688005	容百科技	4,200	226,884.00	0.05
411	600026	中远海能	17,800	224,992.00	0.05
412	00144	招商局港口	22,000	224,336.17	0.05
413	600803	新奥股份	11,800	223,964.00	0.05
414	000408	藏格矿业	9,900	223,443.00	0.05
415	01378	中国宏桥	38,000	222,824.13	0.05
416	600884	杉杉股份	14,500	219,530.00	0.04
417	603899	晨光股份	4,900	218,736.00	0.04
418	600141	兴发集团	9,800	217,756.00	0.04
419	300601	康泰生物	8,520	216,322.80	0.04
420	300595	欧普康视	7,100	214,349.00	0.04
421	000629	钒钛股份	54,500	213,095.00	0.04
422	600183	生益科技	15,000	213,000.00	0.04
423	002938	鹏鼎控股	8,700	211,323.00	0.04
424	300919	中伟股份	3,500	210,875.00	0.04
425	03692	翰森制药	18,000	209,105.06	0.04
426	601966	玲珑轮胎	9,200	204,424.00	0.04
427	603198	迎驾贡酒	3,200	204,160.00	0.04
428	002916	深南电路	2,700	203,499.00	0.04
429	603185	弘元绿能	2,720	202,776.00	0.04
430	000708	中信特钢	12,800	202,752.00	0.04

431	688180	君实生物	5,200	200,408.00	0.04
432	601898	中煤能源	23,200	195,808.00	0.04
433	688536	思瑞浦股份	894	194,892.00	0.04
434	00316	东方海外国际	2,000	193,800.20	0.04
435	002353	杰瑞股份	7,700	193,501.00	0.04
436	601881	中国银河	16,600	192,726.00	0.04
437	000703	恒逸石化	28,100	190,518.00	0.04
438	600018	上港集团	36,100	189,525.00	0.04
439	603517	绝味食品	5,000	185,750.00	0.04
440	06969	思摩尔国际	25,000	183,474.02	0.04
441	603737	三棵树	2,800	183,176.00	0.04
442	03998	波司登	60,000	182,552.04	0.04
443	002120	韵达股份	18,700	178,772.00	0.04
444	000877	天山股份	21,800	177,452.00	0.04
445	601216	君正集团	43,100	176,710.00	0.04
446	002064	华峰化学	25,200	172,872.00	0.04
447	00656	复星国际	34,500	171,128.71	0.03
448	002080	中材科技	8,300	170,316.00	0.03
449	002939	长城证券	20,900	169,917.00	0.03
450	02588	中银航空租赁	2,900	169,381.56	0.03
451	002414	高德红外	21,781	169,238.37	0.03
452	603456	九洲药业	6,000	164,280.00	0.03
453	601155	新城控	11,400	164,274.00	0.03

		股			
454	600025	华能水电	22,800	162,564.00	0.03
455	603893	瑞芯微	2,200	160,270.00	0.03
456	688032	禾迈股份	447	158,752.05	0.03
457	600779	水井坊	2,600	153,374.00	0.03
458	300957	贝泰妮	1,700	151,096.00	0.03
459	300529	健帆生物	6,500	150,670.00	0.03
460	600606	绿地控股	53,300	146,575.00	0.03
461	688779	长远锂科	12,800	144,256.00	0.03
462	603195	公牛集团	1,500	144,090.00	0.03
463	688187	时代电气	3,400	142,324.00	0.03
464	301269	华大九天	1,100	135,124.00	0.03
465	00293	国泰航空	18,000	132,931.08	0.03
466	003022	联泓新科	5,300	131,970.00	0.03
467	000987	越秀资本	19,486	123,736.10	0.03
468	601231	环旭电子	8,200	122,672.00	0.02
469	603568	伟明环保	6,800	119,068.00	0.02
470	601698	中国卫通	5,600	111,328.00	0.02
471	688728	格科微有限公司	6,700	105,994.00	0.02
472	605499	东鹏饮料	600	103,740.00	0.02
473	601808	中海油服	7,300	101,324.00	0.02
474	300979	华利集团	2,000	97,480.00	0.02
475	002945	华林证券	3,700	50,616.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
2	001287	中电港	697	15,036.26	0.00
3	601061	中信金属	1,600	12,128.00	0.00
4	603135	中重科技	518	9,307.18	0.00
5	601133	柏诚系统 股份公司	443	5,431.18	0.00
6	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
7	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
8	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
9	601065	江西省盐 业集团	174	2,196.90	0.00
10	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
11	00813	世茂集团	23,500	-	-
11	03333	中国恒大	33,000	-	-
11	06666	恒大物业	70,000	-	-

### 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	00700	腾讯控股	2,798,378.37	0.54
2	02888	渣打集团	2,474,348.86	0.48
3	00005	汇丰控股	1,599,231.35	0.31
4	01211	比亚迪股份	800,521.04	0.16
4	002594	比亚迪	572,016.00	0.11
5	00941	中国移动	767,724.95	0.15
5	600941	中国移动	467,538.00	0.09
6	300750	宁德时代	1,193,015.00	0.23
7	01299	友邦保险	1,088,186.42	0.21
8	03690	美团-W	903,042.94	0.18
9	00939	建设银行	785,528.00	0.15
10	000858	五粮液	731,638.00	0.14

11	300760	迈瑞医疗	702,823.00	0.14
12	600028	中国石化	504,358.00	0.10
12	00386	中国石油化 工股份	135,493.14	0.03
13	600372	中航电子	574,354.00	0.11
14	02318	中国平安	431,546.13	0.08
14	601318	中国平安	128,243.00	0.02
15	600519	贵州茅台	528,476.00	0.10
16	600886	国投电力	509,130.00	0.10
17	01398	工商银行	467,713.73	0.09
17	601398	工商银行	40,185.00	0.01
18	09626	哔哩哔哩一 W	481,568.29	0.09
19	01024	快手一W	480,145.56	0.09
20	000568	泸州老窖	473,663.00	0.09

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	00700	腾讯控股	4,287,057.25	0.83
2	03690	美团一W	2,538,135.33	0.49
3	00005	汇丰控股	2,372,174.65	0.46
4	01299	友邦保险	1,912,902.32	0.37
5	300750	宁德时代	1,642,319.95	0.32
6	00939	建设银行	1,152,990.88	0.22
6	601939	建设银行	5,290.00	0.00
7	00941	中国移动	1,076,748.31	0.21
8	002594	比亚迪	726,733.00	0.14
8	01211	比亚迪股份	342,006.75	0.07
9	000858	五粮液	963,022.00	0.19
10	02318	中国平安	676,055.88	0.13
10	601318	中国平安	153,812.00	0.03
11	300760	迈瑞医疗	819,388.00	0.16
12	01398	工商银行	688,197.16	0.13
12	601398	工商银行	48,260.00	0.01
13	00388	香港交易所	687,042.03	0.13
14	000333	美的集团	621,138.00	0.12
15	000568	泸州老窖	608,301.00	0.12
16	00981	中芯国际	548,438.73	0.11

16	688981	中芯国际	16,125.00	0.00
17	600900	长江电力	507,935.00	0.10
18	03988	中国银行	483,492.21	0.09
18	601988	中国银行	22,576.00	0.00
19	03968	招商银行	388,757.91	0.08
19	600036	招商银行	112,068.00	0.02
20	300059	东方财富	467,848.00	0.09

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	53,077,359.34
卖出股票收入（成交）总额	61,138,667.10

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

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

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司、中国建设银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,241,121.80
2	应收清算款	2,561,575.12
3	应收股利	1,111,662.19
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,914,359.11

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	001286	陕西能源	35,447.47	0.01	新股流通受限
2	001287	中电港	13,452.80	0.00	新股流通受限
3	601061	中信金属	12,128.00	0.00	新股流通

					受限
4	603135	中重科技	8,980.78	0.00	新股流通受限
5	601133	柏诚系统股份公司	5,431.18	0.00	新股流通受限

## § 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	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
17,503	37,774.44	31,227,412.00	4.72	629,938,588.00	95.28

### 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	伊晓晨	9,390,100.00	1.42
2	招商证券股份有限公司	5,710,383.00	0.86
3	方正证券股份有限公司	5,165,300.00	0.78
4	李昱贤	4,408,700.00	0.67
5	中信建投证券股份有限公司	4,234,124.00	0.64
6	李勇	3,842,000.00	0.58
7	国泰君安证券股份有限公司	3,746,300.00	0.57
8	福州经济技术开发区数为私募基金管理有限公司—数为城盈套利1号私募证券投资基金	3,636,700.00	0.55
9	刘贞峰	3,160,000.00	0.48
10	朴昌建	3,000,000.00	0.45
10	李静	3,000,000.00	0.45

### 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（2021 年 02 月 01 日）基金份额总额	1,089,166,000.00
本报告期期初基金份额总额	689,166,000.00
本报告期基金总申购份额	72,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	100,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	661,166,000.00

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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人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 (%)	
华泰证券	2	65,787,029.21	58.49	38,503.88	50.31	
西南证券	1	14,714,319.48	13.08	11,223.76	14.66	
招商证券	2	13,921,989.65	12.38	10,948.96	14.31	
华鑫证券	3	12,041,319.98	10.71	11,203.83	14.64	
光大证券	1	2,401,938.20	2.14	1,732.46	2.26	
广发证券	1	1,805,212.88	1.60	1,302.17	1.70	
国新证券	2	808,635.41	0.72	744.98	0.97	
国都证券	1	728,040.68	0.65	678.02	0.89	

国泰君安	2	100,716.24	0.09	72.65	0.09	
国金证券	2	65,448.68	0.06	49.97	0.07	
东方证券	4	57,558.21	0.05	41.53	0.05	
安信证券	2	48,902.00	0.04	35.27	0.05	
财信证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
东吴证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	
高盛中国	1	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
上海证券	1	-	-	-	-	
申万宏源证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	2	-	-	-	-	
银河证券	2	-	-	-	-	
中金财富	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	2	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	

中信 证券	1	-	-	-	-	
中银 国际	1	-	-	-	-	

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	20,873.92	24.15	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	65,550.00	75.85	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财信	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛 中国	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(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决定,投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

## 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	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报,上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 17 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
3	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及基金产品资料概要	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 22 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告	中证报,上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 01 日

5	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
7	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 04 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
9	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 24 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 27 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证沪港深 500 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沪港深 500 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](http://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 08 月 31 日