中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	添富中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 08 日
报告期末基金份额总额(份)	3,732,437,198.00
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规

	则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

注：扩位证券简称：中证 800ETF 汇添富。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026 年 07 月 01 日 - 2026 年 09 月 30 日)
1.本期已实现收益	89,066,137.30
2.本期利润	-590,688,210.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1572
4.期末基金资产净值	4,558,329,384.49
5.期末基金份额净值	1.2213

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

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
过去三个月	-12.90%	1.44%	-13.97%	1.45%	1.07%	-0.01%
过去六个月	-0.22%	1.40%	-2.17%	1.41%	1.95%	-0.01%
过去一年	-2.04%	1.24%	-4.39%	1.25%	2.35%	-0.01%
过去三年	29.99%	1.22%	21.40%	1.23%	8.59%	-0.01%
过去五年	4.81%	1.16%	-6.72%	1.17%	11.53%	-0.01%
自基金合同生效起至今	36.66%	1.19%	22.39%	1.20%	14.27%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019 年 10 月 08 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穹	本基金的基金经理	2019年10月08日	-	12	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014年7月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019年4月15日至2023年8月29日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年7月26日至2024年4月19日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年10月8日至今任中

					证800交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年4月29日至2022年11月21日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年7月8日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年7月27日至2025年5月16日任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年9月27日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年9月29日至2026年7月15日任汇添富中证800交易型开放式指数证券

					投资基金联接基金的基金经理。2021年9月29日至2024年9月29日任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021年10月26日至2022年10月30日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）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。2021年12月28日至2025年8月6日任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022年1月11日至2023年11月28日任汇添富MSCI中国A50互联互通交易型开放式指数证

					券投资基金联接基金的基金经理。2022年3月29日至2022年11月21日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年6月13日至2023年9月28日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年7月29日至2024年2月7日任汇添富中证1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年8月31日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022年10月31日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发

					起式联接基金（QDII）的基金经理。2022年12月7日至2026年8月3日任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023年4月13日至2026年8月3日任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023年5月24日至2024年7月5日任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年6月19日至2024年7月9日任汇添富中证1000交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023年8月23日至2025年5月9日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。2023年12月28日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年2月5日至今任汇添富MSCI美国50交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2024年3月1日至2026年8月11日任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024年4月1日至2025年5月9日任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024年4月19日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基

					金发起式联接基金的基金经理。2024年10月28日至今任汇添富中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年6月18日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年7月10日至2026年8月5日任汇添富国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年8月6日至今任汇添富国证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025年8月7日至2026年7月15日任汇添富中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经

					理。2025年8月27日至今任汇添富恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2026年6月17日至今任汇添富中证港股通信息技术综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026年8月4日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的基金经理。2026年8月12日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2026年8月12日至今任汇添富纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2026年8月12日至今任

					汇添富纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2026年8月12日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。
过蓓蓓	本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监	2019年10月08日	2026年07月08日	15	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司，曾任指数与量化投资部副总监，现已离职。2015年8月3日至2026年8月4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。2015年8月3日至2023年4月13日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月3日至2023年4月6日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015年8月3日至2026年7月27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。2015年8月3日至2026年8月4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。2015年8月18日至2023年8月29日任汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年8月18日至2023年5月22日任深

					证300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016年12月22日至2026年7月20日任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016年12月29日至2022年12月1日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年5月23日至2026年8月4日任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018年10月23日至2023年5月22日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年3月26日至2026年7月20日任汇添富中证医药卫生交易

					型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年4月15日至2022年6月13日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年10月8日至2026年7月8日任中证800交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年2月1日至2026年7月8日任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年6月3日至2026年7月8日任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年9月29日至2023年5月18日任汇添富中证800交易型开放式指数证券投资基金联接基

					金的基金经理。2022年2月28日至2022年10月31日任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年8月15日至2026年8月12日任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022年9月26日至2026年7月20日任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年10月20日至2024年4月8日任汇添富中证100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年12月2日至2026年7月27日任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基

					金（LOF）的基金经理。2023年3月14日至2026年8月12日任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023年3月30日至2026年8月12日任汇添富纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023年8月2日至2026年8月12日任汇添富纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023年8月23日至2026年8月4日任汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）的基金经理。

注:基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

4.3 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，保障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，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为0。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026年三季度，市场经历震荡调整。主要宽基指数普遍回调10%-15%，上半年表现强势的电子、通信等板块显著回撤，银行、能源、医药等表现相对突出。A股与港股在结构上表现较为一致，均有从科技类资产转向周期、金融的特征，成长类资产中的少数亮点之一是医药。

地缘冲突局势继续反复。6月美伊签署谅解备忘录之后，霍尔木兹海峡短暂恢复通航，带动油价回落，冲突烈度显著降温。但7月开始双方再度出现互相打击事件，对峙僵持状态重启。霍尔木兹海峡在6月底7月初短暂出现有限通航之后再度受限，航运量仍远低于冲突前的正常水平。油价从7月初开始快速攀升，一度升至每桶100美元以上，并维持高位震荡。

全球经济方面，欧洲央行、美联储、日本央行先后在9月加息。尽管美联储7月议息会议维持基准利率不变，但加息预期自6月释放强鹰信号起便开始抬升。9月加息正式落地，联邦基金利率目标区间达到3.75%-4.00%。根据衍生品市场数据，预计2026年内仍将大概率出现一次加息，且2027年预计还将延续加息两到三次。美债收益率在三季度显著上行，并创多年新高。尽管市场始终处于通胀上行的担忧中，但美国经济数据仍然表现强势，其中AI相关产业是重要的增量和动力来源。

国内方面，7-8月经济数据依旧表现出“生产强、消费弱”的状态，且相对二季度有所转弱。结构上看，出口保持韧性，固定资产投资的拖累有所扩大。7月召开的中央政治局会议指出“宏观政策要发力提效”，并强调了“有效扩大内需”、“营造公平有序的市场竞争环境”等重点方向，一定程度上增强了市场对稳增长政策出台的信心。9月下旬，中美开展了新一轮经贸磋商与领导人会晤，达成多项成果共识，有望带来积极的提振作用。

资本市场角度，结构化特征仍然明显，但其方向与上半年相反。上半年表现强势的AI

产业相关资产出现大幅回调，而金融、资源等周期性资产表现相对突出。AI产业趋势并没有出现重大变化，模型迭代、头部企业收入数据仍不断超预期，乃至引发是否要主动克制前沿领域研发的讨论。上半年A股财报数据的亮点也主要集中在AI相关产业，但行情在三季度并没有与业绩数据同步，出现了较大幅度的情绪降温。市场在上半年的高度分化之后，存在一定的均值回归倾向。另有全球地缘冲突与流动性环境变化带来的扰动。

中证800是A股市场代表性宽基指数，覆盖A股数千只个股中市值较大、流动性较好的前800只股票，风格均衡，是A股市场核心资产的代表。本基金是这一代表性指数的产品化形式，为投资者提供了整体配置国内权益资产的优质工具。

4.5 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-12.90%，同期业绩比较基准收益率为-13.97%。

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

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	4,445,877,327.83	97.42
	其中：股票	4,445,877,327.83	97.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	753.00	0.00
	其中：债券	753.00	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	102,135,963.45	2.24

8	其他资产	15,510,907.57	0.34
9	合计	4,563,524,951.85	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	31,224,101.90	0.68
B	采矿业	232,343,796.42	5.10
C	制造业	2,689,687,408.85	59.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	130,289,113.31	2.86
E	建筑业	50,297,183.55	1.10
F	批发和零售业	25,359,721.22	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	113,837,445.54	2.50
H	住宿和餐饮业	1,014,410.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	244,809,164.48	5.37
J	金融业	773,327,813.05	16.97
K	房地产业	22,111,095.75	0.49
L	租赁和商务服务业	30,355,429.88	0.67
M	科学研究和技术服务业	66,933,546.22	1.47
N	水利、环境和公共设施管理业	4,364,623.40	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,945,116.74	0.17
R	文化、体育和娱乐业	8,270,573.40	0.18
S	综合	-	-
	合计	4,432,170,543.71	97.23

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,390.75	0.00
C	制造业	13,699,677.37	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,716.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,706,784.12	0.30

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	300308	中际旭创	148,300	119,891,652.00	2.63
2	600519	贵州茅台	83,215	104,736,063.30	2.30
3	300750	宁德时代	352,340	102,569,697.40	2.25
4	601318	中国平安	1,419,656	75,653,468.24	1.66
5	300502	新易盛	185,740	72,252,860.00	1.59
6	600036	招商银行	1,648,300	68,008,858.00	1.49
7	601899	紫金矿业	2,194,600	65,377,134.00	1.43
8	603259	药明康德	329,181	55,085,148.54	1.21
9	000333	美的集团	647,261	51,845,606.10	1.14
10	600900	长江电力	1,628,740	46,484,239.60	1.02

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产

				（元）	净值比例（%）
1	688825	长鑫科技	295,247	11,411,296.55	0.25
2	301666	大普微	1,220	403,990.80	0.01
3	301660	粤芯半导体	28,853	346,524.53	0.01
4	688820	盛合晶微	2,391	268,891.86	0.01
5	688781	视涯科技	6,335	233,444.75	0.01

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	753.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	753.00	0.00

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	123282	震裕转02	5	753.00	0.00

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2610	IC2610	73.00	108,466,320.00	-1,268,160.00	
公允价值变动总额合计（元）					-1,268,160.00
股指期货投资本期收益（元）					-8,958,917.25
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-10,481,320.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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,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。

5.11.2

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,144,160.56
2	应收证券清算款	366,747.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,510,907.57

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	11,411,296.55	0.25	新股流通受限

2	301666	大普微	403,990.80	0.01	新股流通受限
3	301660	粤芯半导体	346,524.53	0.01	新股流通受限
4	688820	盛合晶微	268,891.86	0.01	新股流通受限
5	688781	视涯科技	233,444.75	0.01	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	3,021,437,198.00
本报告期基金总申购份额	1,471,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	760,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,732,437,198.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		份额比例达到或者超过20%的时间区间					（%）
机构	1	2026年7月1日至2026年7月23日,2026年9月2日至2026年9月30日	787,598,100.00	-	-	787,598,100.00	21.10
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。							

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、中国证监会批准中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内中证 800 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

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

2026 年 10 月 27 日