

汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	14
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.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
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.....	67
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.....	68
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.....	68
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.....	68

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
7.12 投资组合报告附注.....	68
§ 8 基金份额持有人信息.....	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
8.3 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.....	70
§ 9 开放式基金份额变动.....	70
§ 10 重大事件揭示.....	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
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.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变.....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件	73
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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.....	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
§ 12 备查文件目录.....	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	74
12.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富中证 800 指数增强	
基金主代码	017896	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 05 月 19 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	184,537,947.34	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017896	017897
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	75,709,681.69	108,828,265.65

2.2 基金产品说明

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 800 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 8.00%，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；港股通标的股票的投资策略；存托凭证的投资策略；债券投资策略；可转债及可交换债投资策略；资产支持证券投资策略；股指期货投资策略；国债期货投资策略；股票期权投资策略；融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金除了投资 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。

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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	杨军智
	联系电话	021-28932888	010-60834299
	电子邮箱	service@99fund.com	yjz@citics.com
客户服务电话		400-888-9918	010-60836588
传真		021-28932998	010-60834004
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市朝阳区亮马桥路 48 号 中信证券大厦 5 层
邮政编码		200010	100125
法定代表人		鲁伟铭	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路 728 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 01 月 01 日 - 2025 年 06 月 30 日)	
	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C
本期已实现收益	3,022,656.82	4,641,360.93
本期利润	1,948,020.74	3,905,229.28
加权平均基金份额本	0.0234	0.0249

期利润		
本期加权平均净值利 润率	2.17%	2.33%
本期基金份额净值增 长率	3.21%	3.01%
3.1.2 期末数据和指 标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	9,159,427.19	12,151,141.05
期末可供分配基金份 额利润	0.1210	0.1117
期末基金资产净值	84,869,108.88	120,979,406.70
期末基金份额净值	1.1210	1.1117
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增 长率	12.10%	11.17%

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

汇添富中证 800 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
过去一 个月	3.43%	0.56%	2.82%	0.59%	0.61%	-0.03%
过去三 个月	3.00%	1.14%	1.15%	1.12%	1.85%	0.02%
过去六 个月	3.21%	1.01%	0.87%	1.03%	2.34%	-0.02%
过去一 年	15.25%	1.25%	14.55%	1.38%	0.70%	-0.13%

自基金 合同生 效起至 今	12.10%	1.04%	-1.03%	1.14%	13.13%	-0.10%
汇添富中证 800 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
过去一 个月	3.39%	0.56%	2.82%	0.59%	0.57%	-0.03%
过去三 个月	2.90%	1.14%	1.15%	1.12%	1.75%	0.02%
过去六 个月	3.01%	1.01%	0.87%	1.03%	2.14%	-0.02%
过去一 年	14.79%	1.25%	14.55%	1.38%	0.24%	-0.13%
自基金 合同生 效起至 今	11.17%	1.04%	-1.03%	1.14%	12.20%	-0.10%

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

汇添富中证800指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证800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：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023 年 05 月 19 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司、汇添富投资管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2025 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 363 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基金经理	2023 年 05 月 19 日	—	15	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业

					资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。 2015 年 11 月 24 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。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 12 月 2 日至 2024 年 7 月 11 日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 2025 年 3 月 8 日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。2023 年 7 月 19 日至今任汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 14 日至今任汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳元回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2024 年 3 月 28 日至今任
--	--	--	--	--	---

					汇添富稳兴 回报债券型 发起式证券 投资基金的 基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
许一尊	公募基金	8	6,933,148,142.60	2018年3月23日
	私募资产管理计划	1	10,512,840.91	2025年3月11日
	其他组合	-	-	
	合计	9	6,943,660,983.51	

注:“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。本报告期内兼任投资人员有产品离任情况,离任产品情况如下:

许一尊—离任产品类型:公募基金,离任数量:1只,离任时间:2025年3月8日;离任产品类型:私募资产管理计划,离任数量:0只,离任时间:无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 4 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中国经济在复杂外部环境下呈现复苏态势，整体保持韧性，但内生动能仍显

不足。一季度经济稳中有进，制造业 PMI 持续扩张，工业、消费和投资表现良好，工业生产偏强，消费逐步回暖，制造业与高技术产业投资保持高增长，基建托底作用延续，房地产边际改善。二季度经济修复呈现分化态势，生产端维持较强韧性，外需好于预期，但内需仍显疲软，企业内生融资需求不足，呈现弱修复特征。政策层面，财政政策聚焦科技创新、消费提振及稳定传统行业，同时防范房地产下行风险；货币政策维持适度宽松，通过降准、降息及公开市场操作保持流动性合理充裕。外部环境方面，中美贸易政策反复波动，关税加码与阶段性缓和交替出现，对市场预期形成扰动。

权益市场方面，上半年整体呈现震荡上行格局，结构性行情突出。科技成长板块持续领涨，半导体、AI 等新兴领域表现亮眼，带动市场情绪回暖；银行等高股息板块在二季度因避险需求走强，而地产链和传统消费相对疲弱。市场风格整体表现为小盘优于大盘、成长优于价值、高 Beta 优于低 Beta。选股因子方面，短期交易、盈利质量类因子有效性较高，而低估值等逆向类因子相对弱勢。

报告期内，本基金使用规则化的多因子选股策略构建组合，保持了相对均衡的因子配置，结合风险控制模型控制组合相对基准在风格、行业、个股上的偏离。由于质量、估值等稳健因子配置较多，而区间内高 Beta 风格相对更加强势，区间内超额收益比较一般。未来将继续努力保持对量化选股模型和风险控制模型的迭代更新，提高对市场风格变化的应对能力，提升超额收益的稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 800 指数增强 A 类份额净值增长率为 3.21%，同期业绩比较基准收益率为 0.87%。本报告期汇添富中证 800 指数增强 C 类份额净值增长率为 3.01%，同期业绩比较基准收益率为 0.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中国宏观经济预计在内外复杂环境下延续弱修复态势，呈现“财政托底、外需韧性、内需磨底”的特征。增长节奏或呈“N 型”：7-8 月受高基数、地产二次探底及出口脉冲回落影响，经济可能再度承压；9 月后随着基建投资、公共消费等财政增量工具逐步落地，四季度经济有望温和回升。物价方面，CPI 中枢维持低位，核心通胀疲软；PPI 同比跌幅因能源与黑色系低基数收窄，但难回正区间。政策层面，财政与货币协同发力，财政扩张窗口大概率延后至三季度末，重点支持城市更新、民生等领域；货币政策保持灵活宽松，可能通过降准、降息及国债买卖缓解流动性压力。外部环境方面，全球补库周期支撑外需韧性，但美国关税政策反复可能阶段性扰动出口，国际经贸磋商推进或部分对冲风险。

权益市场方面，随着经济基本面逐步企稳，叠加政策托底，市场下方风险有限。同时，利率处于低位，资金面有所好转，市场参与者对权益市场的信心提升，带动风险偏好回暖，有利于结构性行情的演绎。成长风格受益于流动性维持宽松、AI 产业链景气度提升、政策与地缘因素驱动，可能保持相对强势；同时，高股息资产如银行、公用事业等防御性板块在低利率环境下仍具吸引力，尤其是具备稳定盈利能力和分红能力的龙头个股。选股因子方面，随着上市公司治理水平的提升，长期资金逐步入市，理性投资、价值投资、长期投资得到进一步重视，高质量风格可能存在长期超额收益；在市场风险偏好回暖、交易活跃的背景下，景气度、预期及短期交易类因子也可能有较好表现。

本基金使用量化选股模型挑选个股，保持风格和行业的相对均衡，具有较鲜明的大盘风格。随着经济企稳，经济关联度高，基本面质地优良，估值合理的大市值公司可能有所表现，给中证 800 增强策略带来较好的表现。未来将继续努力提升风险管理和组合精细化管理能力，提升对市场风格变动的适应能力，力争获得较为稳定的超额收益。

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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后

不能低于面值；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本报告期，由汇添富基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	10,911,238.30	26,446,421.24
结算备付金		32,146.39	31,931.17
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	191,986,463.35	282,345,391.03
其中：股票投资		191,984,763.24	282,345,391.03
基金投资		-	-
债券投资		1,700.11	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,017,693.11	16,867,494.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		210,947,541.15	325,691,237.50
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,753,707.40	22,600,674.15
应付管理人报酬		171,437.65	264,742.71
应付托管费		17,143.76	26,474.29
应付销售服务费		44,642.68	73,199.13
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	112,094.08	165,000.00
负债合计		5,099,025.57	23,130,090.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	184,537,947.34	279,739,384.35
未分配利润	6.4.7.9	21,310,568.24	22,821,762.87

净资产合计		205,848,515.58	302,561,147.22
负债和净资产总计		210,947,541.15	325,691,237.50

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 184,537,947.34 份。本基金下属汇添富中证 800 指数增强 A 基金份额净值 1.1210 元，基金份额总额 75,709,681.69 份；本基金下属汇添富中证 800 指数增强 C 基金份额净值 1.1117 元，基金份额总额 108,828,265.65 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		7,685,672.76	2,923,678.04
1. 利息收入		36,526.07	62,128.24
其中：存款利息收入	6.4.7.10	36,526.07	62,128.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,300,239.00	3,087,202.54
其中：股票投资收益	6.4.7.11	6,525,523.41	-827,575.51
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	0.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,774,715.48	3,914,778.05
以摊余成本计量的金融 资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.18	-1,810,767.73	-429,111.20
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	159,675.42	203,458.46
减：二、营业总支出		1,832,422.74	1,793,205.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,286,900.72	1,227,574.20
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	128,690.08	122,757.36
3. 销售服务费		335,009.08	358,338.21
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 21	81, 822. 86	84, 535. 36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5, 853, 250. 02	1, 130, 472. 91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5, 853, 250. 02	1, 130, 472. 91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5, 853, 250. 02	1, 130, 472. 91

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	279, 739, 384. 35	22, 821, 762. 87	302, 561, 147. 22
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	279, 739, 384. 35	22, 821, 762. 87	302, 561, 147. 22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-95, 201, 437. 01	-1, 511, 194. 63	-96, 712, 631. 64
（一）、综合收益总额	-	5, 853, 250. 02	5, 853, 250. 02
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-95, 201, 437. 01	-7, 364, 444. 65	-102, 565, 881. 66
其中：1. 基金申购款	785, 150, 367. 99	58, 656, 433. 98	843, 806, 801. 97
2. 基金赎回款	-880, 351, 805. 00	-66, 020, 878. 63	-946, 372, 683. 63
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	184,537,947.34	21,310,568.24	205,848,515.58
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	244,078,724.30	-10,461,940.15	233,616,784.15
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	244,078,724.30	-10,461,940.15	233,616,784.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	87,183,601.25	422,993.52	87,606,594.77
（一）、综合收益总额	-	1,130,472.91	1,130,472.91
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	87,183,601.25	-707,479.39	86,476,121.86
其中：1. 基金申购款	1,032,181,397.95	-31,337,502.65	1,000,843,895.30
2. 基金赎回款	-944,997,796.70	30,630,023.26	-914,367,773.44
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	331,262,325.55	-10,038,946.63	321,223,378.92

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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
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 800 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]130 号文《关于准予汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 5 月 19 日生效。首次设立基金募集规模为 378,056,803.03 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 60466941_B27 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券

（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

2. 增值税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

的单位外）及地方教育附加。

4. 企业所得税

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

6. 4. 7 重要财务报表项目的说明

6. 4. 7. 1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	3, 942, 962. 85
等于：本金	3, 941, 221. 19
加：应计利息	1, 741. 66
减：坏账准备	-
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	6,968,275.45
等于：本金	6,968,132.05
加：应计利息	143.40
减：坏账准备	-
合计	10,911,238.30

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		187,803,138.03	-	191,984,763.24	4,181,625.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,700.00	0.11	1,700.11	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	1,700.00	0.11	1,700.11	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		187,804,838.03	0.11	191,986,463.35	4,181,625.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	22,315.49
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	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	30,271.22
合计	112,094.08

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 800 指数增强 A		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	95,740,341.65	95,740,341.65
本期申购	135,922,337.21	135,922,337.21
本期赎回（以“-”号填列）	-155,952,997.17	-155,952,997.17
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	75,709,681.69	75,709,681.69
汇添富中证 800 指数增强 C		
项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	183,999,042.70	183,999,042.70
本期申购	649,228,030.78	649,228,030.78
本期赎回（以“-”号填列）	-724,398,807.83	-724,398,807.83
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	108,828,265.65	108,828,265.65

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

汇添富中证 800 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,352,209.68	-3,107,578.57	8,244,631.11
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	11,352,209.68	-3,107,578.57	8,244,631.11
本期利润	3,022,656.82	-1,074,636.08	1,948,020.74
本期基金份额交易产生的变动数	-2,558,824.49	1,525,599.83	-1,033,224.66

其中：基金 申购款	17,929,962.30	-7,180,677.62	10,749,284.68
基金赎回款	-20,488,786.79	8,706,277.45	-11,782,509.34
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	11,816,042.01	-2,656,614.82	9,159,427.19
汇添富中证 800 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,538,162.28	-5,961,030.52	14,577,131.76
加：会计政 策变更	-	-	-
本期期初	20,538,162.28	-5,961,030.52	14,577,131.76
本期利润	4,641,360.93	-736,131.65	3,905,229.28
本期基金份 额交易产生 的变动数	-9,214,493.28	2,883,273.29	-6,331,219.99
其中：基金 申购款	80,334,965.43	-32,427,816.13	47,907,149.30
基金赎回款	-89,549,458.71	35,311,089.42	-54,238,369.29
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	15,965,029.93	-3,813,888.88	12,151,141.05

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	29,434.52
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,717.23
结算备付金利息收入	215.22
其他	159.10
合计	36,526.07

注：“其他”包含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——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	548,315,082.03
减：卖出股票成本总额	541,269,487.11

减：交易费用	520,071.51
买卖股票差价收入	6,525,523.41

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.11
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-
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	0.11

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,774,715.48
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	2,774,715.48

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,810,767.73
——股票投资	-1,810,767.73
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,810,767.73

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	159,675.42
替代损益	-
其他	-
合计	159,675.42

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	—
银行费用	—
指数使用费	—
登记结算服务费	—
IOPV 计算与发布费	—
持有人大会-公证费	—
持有人大会-律师费	—
开户费	—
上市费	—
或有管理费	—
其他	—
合计	81,822.86

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, 基金注册登记机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	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（%）
中信证券	380,234,913.51	37.98	770,280,143.02	54.45

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 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（%）
中信证券	69,083.71	38.02	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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（%）
中信证券	316,339.39	53.75	-	-

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。截至 2024 年 6 月 30 日止，该类佣金协议的服务范围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等。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,286,900.72	1,227,574.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	514,843.73	150,425.00
应支付基金管理人的净管理费	772,056.99	1,077,149.20

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.00\%\div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 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。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	128,690.08	122,757.36

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C	合计
东方证券股份有限公司	-	1,142.00	1,142.00
汇添富基金管理股份有限公司	-	2,506.86	2,506.86
中信证券股份有限公司	-	193,740.06	193,740.06
合计	-	197,388.92	197,388.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C	合计
东方证券股份有限公司	-	618.96	618.96
汇添富基金管理股份有限公司	-	2,530.04	2,530.04
中信证券股份有限公司	-	222,692.76	222,692.76
合计	-	225,841.76	225,841.76

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 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固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中信证 券	6,294,203.11	5,410.38	8,295,765.52	6,166.05
----------	--------------	----------	--------------	----------

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
					-	-	-	-	-	
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
123257	安 克 转 债	2025 年 06 月 16 日	14 个 交 易 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.01	17	1,700.00	1,700.11	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市

场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配,确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外,本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2025 年 06 月 30 日	1 个月以内	1- 3 个月	3 个月-1 年	1- 5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	10,911,238.30	-	-	-	-	-	10,911,238.30
结算备付金	32,146.39	-	-	-	-	-	32,146.39
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	1,700.11	-	-	191,984,763.24	191,986,463.35
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	8,017,693.11	8,017,693.11
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-

资产							
资产总计	10,943,384.69	-	1,700.11	-	-	200,002,456.35	210,947,541.15
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	-	-	-	-	-	4,753,707.40	4,753,707.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	171,437.65	171,437.65
应付托管费	-	-	-	-	-	17,143.76	17,143.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	44,642.68	44,642.68
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	-	-	-	-	-	112,094.08	112,094.08
负债总计	-	-	-	-	-	5,099,025.57	5,099,025.57
利率敏感 度缺口	10,943,384.69	-	1,700.11	-	-	194,903,430.78	205,848,515.58
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	26,446,421.24	-	-	-	-	-	26,446,421.24
结算备付金	31,931.17	-	-	-	-	-	31,931.17
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	282,345,391.03	282,345,391.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	16,867,494.06	16,867,494.06
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	26,478,352.41	-	-	-	-	299,212,885.09	325,691,237.50
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	-	-	-	-	-	22,600,674.15	22,600,674.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	264,742.71	264,742.71
应付托管费	-	-	-	-	-	26,474.29	26,474.29
应付销售服务	-	-	-	-	-	73,199.13	73,199.13

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	-	-	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债 总计	-	-	-	-	-	23,130,090.28	23,130,090.28
利率 敏感 度缺 口	26,478,352.41	-	-	-	-	276,082,794.81	302,561,147.22

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	191,984,763.24	93.27	282,345,391.03	93.32
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,700.11	0.00	—	—
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	191,986,463.35	93.27	282,345,391.03	93.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证 800 指数上涨 5%	9,407,514.35	12,757,235.44
	中证 800 指数下跌 5%	-9,407,514.35	-12,757,235.44

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 06 月 30 日
第一层次	191,984,763.24
第二层次	1,700.11
第三层次	-
合计	191,986,463.35

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	191,984,763.24	91.01
	其中：股票	191,984,763.24	91.01
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,700.11	0.00
	其中：债券	1,700.11	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	10,943,384.69	5.19
8	其他各项资产	8,017,693.11	3.80
9	合计	210,947,541.15	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	880,318.00	0.43
B	采矿业	7,065,778.00	3.43
C	制造业	84,428,392.08	41.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,137,935.00	2.01
E	建筑业	3,883,228.00	1.89
F	批发和零售业	1,146,729.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	3,009,552.60	1.46
H	住宿和餐饮业	83,529.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,707,491.27	4.72
J	金融业	41,073,871.23	19.95
K	房地产业	1,055,195.00	0.51
L	租赁和商务服务业	447,319.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	824,577.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	24,804.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	668,928.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	549,614.00	0.27
S	综合	68,617.00	0.03

	合计	159,055,878.18	77.27
--	----	----------------	-------

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	126,734.00	0.06
C	制造业	26,506,798.41	12.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,075,274.00	0.52
E	建筑业	938,429.00	0.46
F	批发和零售业	259,876.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	409,130.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,436,425.65	0.70
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	373,198.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	254,966.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	136,151.00	0.07
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	1,411,903.00	0.69
S	综合	-	-
	合计	32,928,885.06	16.00

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	600519	贵州茅台	4,600	6,483,792.00	3.15
2	300750	宁德时代	19,060	4,807,313.20	2.34

3	601318	中国平安	84,000	4,660,320.00	2.26
4	600036	招商银行	90,600	4,163,070.00	2.02
5	000333	美的集团	33,600	2,425,920.00	1.18
6	002594	比亚迪	6,500	2,157,415.00	1.05
7	601288	农业银行	361,500	2,125,620.00	1.03
8	000858	五粮液	17,600	2,092,640.00	1.02
9	601899	紫金矿业	103,500	2,018,250.00	0.98
10	688981	中芯国际	22,783	2,008,777.11	0.98
11	601398	工商银行	263,200	1,997,688.00	0.97
12	601166	兴业银行	79,300	1,850,862.00	0.90
13	601728	中国电信	235,400	1,824,350.00	0.89
14	600887	伊利股份	63,100	1,759,228.00	0.85
15	600031	三一重工	93,600	1,680,120.00	0.82
16	601688	华泰证券	90,703	1,615,420.43	0.78
17	000166	申万宏源	299,800	1,504,996.00	0.73
18	600900	长江电力	49,300	1,485,902.00	0.72
19	002475	立讯精密	42,600	1,477,794.00	0.72
20	002415	海康威视	51,700	1,433,641.00	0.70
21	000725	京东方 A	352,900	1,408,071.00	0.68
22	600050	中国联通	258,900	1,382,526.00	0.67
23	601328	交通银行	171,400	1,371,200.00	0.67
24	002736	国信证券	116,500	1,342,080.00	0.65
25	601766	中国中车	179,900	1,266,496.00	0.62
26	600999	招商证券	68,900	1,211,951.00	0.59
27	601818	光大银行	291,000	1,207,650.00	0.59
28	000063	中兴通讯	37,100	1,205,379.00	0.59
29	000001	平安银行	97,500	1,176,825.00	0.57
30	601658	邮储银行	209,300	1,144,871.00	0.56
31	601857	中国石油	132,700	1,134,585.00	0.55
32	000338	潍柴动力	72,400	1,113,512.00	0.54
33	600219	南山铝业	282,900	1,083,507.00	0.53
34	300059	东方财富	46,200	1,068,606.00	0.52
35	601668	中国建筑	184,600	1,065,142.00	0.52
36	601600	中国铝业	147,900	1,041,216.00	0.51
37	000050	深天马 A	121,700	1,036,884.00	0.50
38	300408	三环集团	30,400	1,015,360.00	0.49
39	601816	京沪高铁	175,700	1,010,275.00	0.49
40	600000	浦发银行	72,400	1,004,912.00	0.49
41	600690	海尔智家	40,100	993,678.00	0.48
42	601800	中国交建	109,700	975,233.00	0.47
43	600019	宝钢股份	144,417	951,708.03	0.46
44	600941	中国移动	8,400	945,420.00	0.46
45	600028	中国石化	160,700	906,348.00	0.44

46	688256	寒武纪科技	1,500	902,250.00	0.44
47	600497	驰宏锌锗	169,300	895,597.00	0.44
48	002371	北方华创	2,000	884,420.00	0.43
49	600276	恒瑞医药	16,900	877,110.00	0.43
50	601138	工业富联	40,900	874,442.00	0.42
51	601169	北京银行	127,300	869,459.00	0.42
52	600089	特变电工	71,600	854,188.00	0.41
53	688041	海光信息	5,939	839,121.31	0.41
54	000651	格力电器	18,600	835,512.00	0.41
55	002500	山西证券	135,600	791,904.00	0.38
56	600663	陆家嘴	88,900	787,654.00	0.38
57	600299	安迪苏	81,600	787,440.00	0.38
58	300760	迈瑞医疗	3,500	786,625.00	0.38
59	002179	中航光电	19,100	770,876.00	0.37
60	002230	科大讯飞	15,900	761,292.00	0.37
61	600406	国电南瑞	33,600	752,976.00	0.37
62	601319	中国人保	86,400	752,544.00	0.37
63	601088	中国神华	18,400	745,936.00	0.36
64	601390	中国中铁	130,800	733,788.00	0.36
65	601988	中国银行	129,900	730,038.00	0.35
66	600959	江苏有线	200,400	689,376.00	0.33
67	300207	欣旺达	33,500	672,010.00	0.33
68	300015	爱尔眼科	53,600	668,928.00	0.32
69	300124	汇川技术	10,300	665,071.00	0.32
70	600487	亨通光电	43,300	662,490.00	0.32
71	601211	国泰海通	34,200	655,272.00	0.32
72	600919	江苏银行	54,800	654,312.00	0.32
73	600660	福耀玻璃	11,400	649,914.00	0.32
74	600741	华域汽车	36,800	649,520.00	0.32
75	601601	中国太保	17,200	645,172.00	0.31
76	002414	高德红外	62,600	641,650.00	0.31
77	600061	国投资本	85,200	640,704.00	0.31
78	000027	深圳能源	99,300	633,534.00	0.31
79	300628	亿联网络	17,800	618,728.00	0.30
80	603259	药明康德	8,700	605,085.00	0.29
81	688111	金山办公	2,100	588,105.00	0.29
82	600517	国网英大	115,200	587,520.00	0.29
83	601877	正泰电器	25,600	580,352.00	0.28
84	002352	顺丰控股	11,800	575,368.00	0.28
85	000895	双汇发展	22,400	546,784.00	0.27
86	601186	中国铁建	66,700	534,267.00	0.26
87	002252	上海莱士	77,000	528,990.00	0.26

88	688008	澜起科技	6,400	524,800.00	0.25
89	600104	上汽集团	31,700	508,785.00	0.25
90	000768	中航西飞	18,600	508,524.00	0.25
91	000728	国元证券	63,100	497,859.00	0.24
92	000807	云铝股份	30,300	484,194.00	0.24
93	601958	金铝股份	43,700	478,078.00	0.23
94	600809	山西汾酒	2,700	476,253.00	0.23
95	600362	江西铜业	19,900	466,257.00	0.23
96	601225	陕西煤业	24,100	463,684.00	0.23
97	300498	温氏股份	27,000	461,160.00	0.22
98	601633	长城汽车	21,400	459,672.00	0.22
99	300999	金龙鱼	15,100	445,903.00	0.22
100	600309	万华化学	8,100	439,506.00	0.21
101	000708	中信特钢	37,300	438,648.00	0.21
102	000157	中联重科	58,900	425,847.00	0.21
103	002236	大华股份	26,700	423,996.00	0.21
104	601229	上海银行	38,700	410,607.00	0.20
105	002714	牧原股份	9,600	403,296.00	0.20
106	603288	海天味业	10,300	400,773.00	0.19
107	600918	中泰证券	62,300	400,589.00	0.19
108	600150	中国船舶	12,300	400,242.00	0.19
109	601919	中远海控	26,500	398,560.00	0.19
110	601717	郑煤机	23,900	397,218.00	0.19
111	600482	中国动力	17,200	396,804.00	0.19
112	601989	中国重工	84,900	393,936.00	0.19
113	600196	复星医药	15,700	393,913.00	0.19
114	002601	龙佰集团	24,000	389,040.00	0.19
115	600585	海螺水泥	17,800	382,166.00	0.19
116	600066	宇通客车	15,100	375,386.00	0.18
117	688009	中国通号	71,393	366,960.02	0.18
118	688012	中微半导体设备	2,000	364,600.00	0.18
119	600885	宏发股份	16,120	359,637.20	0.17
120	600584	长电科技	10,600	357,114.00	0.17
121	601607	上海医药	19,700	352,236.00	0.17
122	600016	民生银行	73,600	349,600.00	0.17
123	000425	徐工机械	44,500	345,765.00	0.17
124	603501	豪威集团	2,700	344,655.00	0.17
125	300595	欧普康视	22,100	337,467.00	0.16
126	002056	横店东磁	23,800	336,770.00	0.16
127	601669	中国电建	68,700	334,569.00	0.16
128	600875	东方电气	19,900	333,126.00	0.16
129	601168	西部矿业	20,000	332,600.00	0.16

130	002027	分众传媒	44,100	321,930.00	0.16
131	601985	中国核电	34,500	321,540.00	0.16
132	003022	联泓新科	20,100	318,183.00	0.15
133	000538	云南白药	5,700	318,003.00	0.15
134	601098	中南传媒	24,000	314,880.00	0.15
135	000636	风华高科	22,800	313,272.00	0.15
136	002138	顺络电子	11,000	309,320.00	0.15
137	600637	东方明珠	41,310	308,585.70	0.15
138	002202	金风科技	29,600	303,400.00	0.15
139	000776	广发证券	17,800	299,218.00	0.15
140	002493	荣盛石化	35,700	295,596.00	0.14
141	002142	宁波银行	10,800	295,488.00	0.14
142	300308	中际旭创	2,000	291,720.00	0.14
143	000938	紫光股份	11,800	283,082.00	0.14
144	000783	长江证券	40,600	281,358.00	0.14
145	002410	广联达	20,800	278,928.00	0.14
146	000568	泸州老窖	2,400	272,160.00	0.13
147	300919	中伟股份	8,100	266,328.00	0.13
148	002241	歌尔股份	11,400	265,848.00	0.13
149	601628	中国人寿	6,200	255,378.00	0.12
150	601006	大秦铁路	38,501	254,106.60	0.12
151	603986	兆易创新	2,000	253,060.00	0.12
152	600015	华夏银行	31,800	251,538.00	0.12
153	688396	华润微电子	5,320	250,891.20	0.12
154	300274	阳光电源	3,700	250,749.00	0.12
155	000100	TCL 科技	56,900	246,377.00	0.12
156	688271	联影医疗	1,900	242,706.00	0.12
157	600795	国电电力	49,600	240,064.00	0.12
158	600436	片仔癀	1,200	240,012.00	0.12
159	600489	中金黄金	16,400	239,932.00	0.12
160	600739	辽宁成大	21,800	239,800.00	0.12
161	601939	建设银行	25,300	238,832.00	0.12
162	000625	长安汽车	18,500	236,060.00	0.11
163	300502	新易盛	1,820	231,176.40	0.11
164	600011	华能国际	32,200	229,908.00	0.11
165	300014	亿纬锂能	5,000	229,050.00	0.11
166	601012	隆基绿能	15,200	228,304.00	0.11
167	300433	蓝思科技	10,100	225,230.00	0.11
168	600109	国金证券	25,600	224,512.00	0.11
169	002001	新 和 成	10,500	223,335.00	0.11
170	601916	浙商银行	65,200	221,028.00	0.11
171	300033	同花顺	800	218,408.00	0.11

172	002939	长城证券	26,000	217,880.00	0.11
173	002673	西部证券	27,500	216,700.00	0.11
174	601127	赛力斯	1,600	214,912.00	0.10
175	600096	云天化	9,600	210,912.00	0.10
176	300017	网宿科技	18,900	202,608.00	0.10
177	002273	水晶光电	10,100	201,697.00	0.10
178	002064	华峰化学	30,400	200,944.00	0.10
179	601456	国联民生	19,200	198,720.00	0.10
180	600704	物产中大	37,700	198,679.00	0.10
181	600332	白云山	7,500	197,700.00	0.10
182	600893	航发动力	5,100	196,554.00	0.10
183	603993	洛阳钼业	23,000	193,660.00	0.09
184	601568	北元集团	45,600	189,240.00	0.09
185	603799	华友钴业	5,100	188,802.00	0.09
186	600038	中直股份	4,800	186,288.00	0.09
187	601009	南京银行	15,900	184,758.00	0.09
188	000738	航发控制	8,900	184,675.00	0.09
189	600027	华电国际	33,600	183,792.00	0.09
190	002311	海大集团	3,100	181,629.00	0.09
191	601360	三六零	17,700	180,540.00	0.09
192	601555	东吴证券	20,600	180,250.00	0.09
193	603658	安图生物	4,800	180,000.00	0.09
194	002532	天山铝业	20,900	173,679.00	0.08
195	600372	中航机载	14,300	172,458.00	0.08
196	000999	华润三九	5,300	165,784.00	0.08
197	002223	鱼跃医疗	4,600	163,760.00	0.08
198	601377	兴业证券	26,300	162,797.00	0.08
199	601995	中金公司	4,500	159,120.00	0.08
200	601336	新华保险	2,700	157,950.00	0.08
201	600118	中国卫星	5,400	154,278.00	0.07
202	688249	晶合集成	7,600	154,052.00	0.07
203	600535	天士力	9,800	153,370.00	0.07
204	601901	方正证券	19,300	152,663.00	0.07
205	688099	晶晨半导体	2,097	148,907.97	0.07
206	603019	中科曙光	2,100	147,840.00	0.07
207	002299	圣农发展	10,300	147,187.00	0.07
208	002028	思源电气	2,000	145,820.00	0.07
209	600183	生益科技	4,800	144,720.00	0.07
210	601881	中国银河	8,400	144,060.00	0.07
211	002185	华天科技	14,200	143,420.00	0.07
212	002920	德赛西威	1,400	142,982.00	0.07
213	600989	宝丰能源	8,700	140,418.00	0.07

214	688122	西部超导	2,700	140,076.00	0.07
215	003816	中国广核	38,200	139,048.00	0.07
216	600886	国投电力	9,400	138,556.00	0.07
217	600085	同仁堂	3,800	137,028.00	0.07
218	000423	东阿阿胶	2,600	135,980.00	0.07
219	601179	中国西电	21,500	132,010.00	0.06
220	001965	招商公路	11,000	132,000.00	0.06
221	600369	西南证券	29,800	129,630.00	0.06
222	000963	华东医药	3,200	129,152.00	0.06
223	002841	视源股份	3,700	128,020.00	0.06
224	600547	山东黄金	4,000	127,720.00	0.06
225	601788	光大证券	7,100	127,658.00	0.06
226	601838	成都银行	6,300	126,630.00	0.06
227	600909	华安证券	21,700	126,511.00	0.06
228	002152	广电运通	9,400	126,336.00	0.06
229	002422	科伦药业	3,500	125,720.00	0.06
230	600426	华鲁恒升	5,800	125,686.00	0.06
231	605499	东鹏饮料	400	125,620.00	0.06
232	600938	中国海油	4,800	125,328.00	0.06
233	600062	华润双鹤	6,700	125,022.00	0.06
234	300373	扬杰科技	2,400	124,560.00	0.06
235	601228	广州港	38,500	124,355.00	0.06
236	600176	中国巨石	10,900	124,260.00	0.06
237	000825	太钢不锈	34,600	124,214.00	0.06
238	600380	健康元	11,200	123,536.00	0.06
239	600674	川投能源	7,700	123,508.00	0.06
240	600029	南方航空	20,900	123,310.00	0.06
241	600009	上海机场	3,800	120,726.00	0.06
242	600845	宝信软件	5,000	118,100.00	0.06
243	002340	格林美	18,400	116,840.00	0.06
244	002926	华西证券	13,000	116,220.00	0.06
245	603596	伯特利	2,200	115,918.00	0.06
246	600048	保利发展	14,300	115,830.00	0.06
247	601878	浙商证券	10,600	115,646.00	0.06
248	600862	中航高科	4,400	114,752.00	0.06
249	601019	山东出版	12,100	114,587.00	0.06
250	300496	中科创达	2,000	114,440.00	0.06
251	600879	航天电子	10,900	114,123.00	0.06
252	600346	恒力石化	8,000	114,080.00	0.06
253	601111	中国国航	14,200	112,038.00	0.05
254	300339	润和软件	2,200	111,826.00	0.05
255	601117	中国化学	14,500	111,215.00	0.05
256	000792	盐湖股份	6,500	111,020.00	0.05

257	600460	士兰微	4,400	109,208.00	0.05
258	002430	杭氧股份	5,500	106,810.00	0.05
259	600498	烽火通信	5,000	105,150.00	0.05
260	000060	中金岭南	22,900	104,882.00	0.05
261	601965	中国汽研	5,900	104,725.00	0.05
262	002916	深南电路	970	104,575.70	0.05
263	600352	浙江龙盛	10,200	103,632.00	0.05
264	000830	鲁西化工	9,900	101,970.00	0.05
265	601799	星宇股份	800	100,000.00	0.05
266	688777	中控技术	2,200	98,802.00	0.05
267	601108	财通证券	12,480	98,716.80	0.05
268	600600	青岛啤酒	1,400	97,244.00	0.05
269	600023	浙能电力	17,900	94,870.00	0.05
270	603260	合盛硅业	2,000	94,800.00	0.05
271	600060	海信视像	4,000	92,080.00	0.04
272	000977	浪潮信息	1,800	91,584.00	0.04
273	002709	天赐材料	5,000	90,600.00	0.04
274	002850	科达利	800	90,536.00	0.04
275	601696	中银证券	8,400	89,796.00	0.04
276	600582	天地科技	14,900	89,251.00	0.04
277	002078	太阳纸业	6,600	88,836.00	0.04
278	002595	豪迈科技	1,500	88,830.00	0.04
279	000739	普洛药业	6,300	88,200.00	0.04
280	000021	深科技	4,700	88,078.00	0.04
281	601577	长沙银行	8,800	87,472.00	0.04
282	300896	爱美客	500	87,405.00	0.04
283	600111	北方稀土	3,500	87,150.00	0.04
284	002938	鹏鼎控股	2,700	86,481.00	0.04
285	000960	锡业股份	5,600	85,680.00	0.04
286	300832	新产业	1,500	85,080.00	0.04
287	002507	涪陵榨菜	6,600	84,414.00	0.04
288	600188	兖矿能源	6,900	83,973.00	0.04
289	601615	明阳智能	7,300	83,877.00	0.04
290	002472	双环传动	2,500	83,725.00	0.04
291	000528	柳工	8,700	83,607.00	0.04
292	300223	北京君正	1,200	83,040.00	0.04
293	002180	纳思达	3,600	82,584.00	0.04
294	601898	中煤能源	7,500	82,050.00	0.04
295	300395	菲利华	1,600	81,760.00	0.04
296	603369	今世缘	2,100	81,753.00	0.04
297	300529	健帆生物	3,700	79,809.00	0.04
298	000876	新希望	8,500	79,730.00	0.04
299	600079	人福医药	3,800	79,724.00	0.04

300	300759	康龙化成	3,200	78,528.00	0.04
301	300677	英科医疗	3,300	78,144.00	0.04
302	600906	财达证券	11,400	77,748.00	0.04
303	600998	九州通	15,000	77,100.00	0.04
304	300604	长川科技	1,700	76,347.00	0.04
305	300699	光威复材	2,400	76,008.00	0.04
306	601698	中国卫通	3,700	75,739.00	0.04
307	000513	丽珠集团	2,100	75,684.00	0.04
308	001979	招商蛇口	8,600	75,422.00	0.04
309	600298	安琪酵母	2,100	73,857.00	0.04
310	600549	厦门钨业	3,500	73,220.00	0.04
311	600803	新奥股份	3,800	71,820.00	0.03
312	688036	传音控股	900	71,730.00	0.03
313	300285	国瓷材料	4,100	71,135.00	0.03
314	002385	大北农	17,500	70,700.00	0.03
315	600873	梅花生物	6,600	70,554.00	0.03
316	600153	建发股份	6,800	70,516.00	0.03
317	000630	铜陵有色	21,100	70,474.00	0.03
318	000301	东方盛虹	8,300	69,139.00	0.03
319	600926	杭州银行	4,100	68,962.00	0.03
320	600025	华能水电	7,200	68,760.00	0.03
321	601990	南京证券	8,500	68,680.00	0.03
322	600673	东阳光	5,900	68,617.00	0.03
323	600177	雅戈尔	9,300	67,890.00	0.03
324	688120	华海清科	400	67,480.00	0.03
325	000983	山西焦煤	10,300	65,920.00	0.03
326	002409	雅克科技	1,200	65,628.00	0.03
327	300001	特锐德	2,700	64,719.00	0.03
328	603160	汇顶科技	900	63,927.00	0.03
329	601618	中国中冶	21,400	63,772.00	0.03
330	600765	中航重机	3,700	62,456.00	0.03
331	000009	中国宝安	7,000	62,160.00	0.03
332	600018	上港集团	10,800	61,668.00	0.03
333	002444	巨星科技	2,400	61,224.00	0.03
334	002129	TCL 中环	7,900	60,672.00	0.03
335	000598	兴蓉环境	8,300	59,843.00	0.03
336	600141	兴发集团	2,900	59,537.00	0.03
337	601598	中国外运	12,000	59,160.00	0.03
338	688469	芯联集成	12,400	59,148.00	0.03
339	300413	芒果超媒	2,700	58,914.00	0.03
340	603858	步长制药	3,500	56,840.00	0.03
341	000709	河钢股份	26,300	56,808.00	0.03
342	000034	神州数码	1,500	56,460.00	0.03

343	603345	安井食品	700	56,294.00	0.03
344	688187	时代电气	1,300	55,445.00	0.03
345	601888	中国中免	900	54,873.00	0.03
346	601928	凤凰传媒	4,900	54,733.00	0.03
347	601216	君正集团	9,900	54,648.00	0.03
348	600528	中铁工业	7,400	54,612.00	0.03
349	600754	锦江酒店	2,400	53,856.00	0.03
350	688047	龙芯中科	401	53,489.39	0.03
351	600008	首创环保	17,400	52,548.00	0.03
352	600801	华新水泥	4,400	52,096.00	0.03
353	600312	平高电气	3,300	50,787.00	0.02
354	601231	环旭电子	3,400	49,742.00	0.02
355	002508	老板电器	2,600	49,426.00	0.02
356	000683	博源化工	10,300	49,337.00	0.02
357	605358	立昂微	2,100	48,930.00	0.02
358	688126	上海硅产业集团	2,600	48,672.00	0.02
359	600373	中文传媒	4,700	48,269.00	0.02
360	300140	节能环境	7,800	48,126.00	0.02
361	601665	齐鲁银行	7,600	48,032.00	0.02
362	688188	上海柏楚 电子科技	360	47,397.60	0.02
363	600021	上海电力	5,300	46,587.00	0.02
364	600970	中材国际	5,400	46,332.00	0.02
365	601058	赛轮轮胎	3,500	45,920.00	0.02
366	600578	京能电力	10,200	45,798.00	0.02
367	688728	格科微有 限公司	2,900	44,660.00	0.02
368	603298	杭叉集团	2,100	43,995.00	0.02
369	600511	国药股份	1,500	43,740.00	0.02
370	603225	新凤鸣	4,100	43,665.00	0.02
371	300054	鼎龙股份	1,500	43,020.00	0.02
372	600098	广州发展	6,800	42,500.00	0.02
373	603000	人民网	2,100	42,441.00	0.02
374	300979	华利集团	800	42,056.00	0.02
375	002423	中粮资本	3,400	41,582.00	0.02
376	600760	中航沈飞	700	41,034.00	0.02
377	600685	中船防务	1,500	40,785.00	0.02
378	600271	航天信息	4,400	40,656.00	0.02
379	002966	苏州银行	4,600	40,388.00	0.02
380	600160	巨化股份	1,400	40,152.00	0.02
381	000596	古井贡酒	300	39,945.00	0.02
382	600007	中国国贸	1,900	39,102.00	0.02

383	600995	南网储能	3,900	38,142.00	0.02
384	002429	兆驰股份	8,700	38,106.00	0.02
385	600848	上海临港	4,100	37,187.00	0.02
386	000959	首钢股份	10,900	37,060.00	0.02
387	300012	华测检测	3,100	36,239.00	0.02
388	601198	东兴证券	3,200	35,680.00	0.02
389	001286	陕西能源	4,100	35,670.00	0.02
390	600707	彩虹股份	5,500	35,530.00	0.02
391	601212	白银有色	11,300	35,369.00	0.02
392	600161	天坛生物	1,800	34,542.00	0.02
393	000878	云南铜业	2,700	34,344.00	0.02
394	000563	陕国投 A	9,600	34,272.00	0.02
395	688082	盛美上海 半导体	300	34,182.00	0.02
396	688563	航空材料 股份	600	33,978.00	0.02
397	688425	铁建重工	8,300	33,864.00	0.02
398	002156	通富微电	1,300	33,306.00	0.02
399	300623	捷捷微电	1,100	32,780.00	0.02
400	600563	法拉电子	300	32,727.00	0.02
401	000623	吉林敖东	1,900	32,205.00	0.02
402	601808	中海油服	2,300	31,648.00	0.02
403	688387	中信科移 动	5,600	31,640.00	0.02
404	600566	济川药业	1,200	31,596.00	0.02
405	002120	韵达股份	4,700	31,490.00	0.02
406	000921	海信家电	1,200	30,840.00	0.01
407	600056	中国医药	2,900	29,986.00	0.01
408	603806	福斯特	2,300	29,808.00	0.01
409	600258	首旅酒店	2,100	29,673.00	0.01
410	000898	鞍钢股份	12,300	28,536.00	0.01
411	002294	信立泰	600	28,398.00	0.01
412	601666	平煤股份	3,800	28,158.00	0.01
413	688002	睿创微纳	400	27,888.00	0.01
414	601966	玲珑轮胎	1,900	27,873.00	0.01
415	688819	天能电池 集团股份	1,002	27,815.52	0.01
416	003031	中瓷电子	500	26,605.00	0.01
417	002831	裕同科技	1,100	25,762.00	0.01
418	600295	鄂尔多斯	2,900	25,259.00	0.01
419	603568	伟明环保	1,300	24,804.00	0.01
420	601106	中国一重	8,800	24,640.00	0.01
421	300316	晶盛机电	900	24,435.00	0.01

422	600699	均胜电子	1,400	24,416.00	0.01
423	600905	三峡能源	5,600	23,856.00	0.01
424	002372	伟星新材	2,300	23,828.00	0.01
425	603195	公牛集团	480	23,160.00	0.01
426	600155	华创云信	3,300	22,968.00	0.01
427	601139	深圳燃气	3,600	22,896.00	0.01
428	000617	中油资本	3,100	22,630.00	0.01
429	603786	科博达	400	22,164.00	0.01
430	688475	萤石网络	700	22,064.00	0.01
431	603556	海兴电力	800	20,376.00	0.01
432	000750	国海证券	4,900	20,188.00	0.01
433	600928	西安银行	5,100	19,992.00	0.01
434	603939	益丰药房	800	19,576.00	0.01
435	600820	隧道股份	3,100	18,910.00	0.01
436	002608	江苏国信	2,500	18,325.00	0.01
437	601233	桐昆股份	1,700	18,020.00	0.01
438	600529	山东药玻	800	17,712.00	0.01
439	600588	用友网络	1,300	17,381.00	0.01
440	002563	森马服饰	3,300	17,358.00	0.01
441	002739	万达电影	1,500	17,145.00	0.01
442	600132	重庆啤酒	300	16,530.00	0.01
443	600131	国网信通	900	15,930.00	0.01
444	600598	北大荒	1,100	15,862.00	0.01
445	002008	大族激光	600	14,622.00	0.01
446	688172	燕东微电子股份	700	13,762.00	0.01
447	002050	三花智控	500	13,190.00	0.01
448	001289	龙源电力	800	12,944.00	0.01
449	603156	养元饮品	600	12,696.00	0.01
450	000537	中绿电	900	7,524.00	0.00
451	601699	潞安环能	700	7,385.00	0.00
452	300037	新宙邦	200	7,040.00	0.00
453	001213	中铁特货	1,600	6,496.00	0.00
454	002304	洋河股份	100	6,455.00	0.00
455	002262	恩华药业	300	6,234.00	0.00
456	000933	神火股份	300	4,992.00	0.00
457	688538	和辉光电	2,100	4,914.00	0.00
458	601238	广汽集团	600	4,494.00	0.00
459	600925	苏能股份	100	523.00	0.00

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	300160	秀强股份	161,800	909,316.00	0.44
2	600488	津药药业	211,900	883,623.00	0.43
3	002160	常铝股份	203,400	878,688.00	0.43
4	300241	瑞丰光电	153,400	874,380.00	0.42
5	002454	松芝股份	112,100	865,412.00	0.42
6	000404	长虹华意	121,800	864,780.00	0.42
7	300259	新天科技	240,900	855,195.00	0.42
8	002367	康力电梯	117,900	828,837.00	0.40
9	002375	亚厦股份	213,200	820,820.00	0.40
10	002228	合兴包装	220,500	778,365.00	0.38
11	601999	出版传媒	109,300	764,007.00	0.37
12	002782	可立克	56,200	729,476.00	0.35
13	300303	聚飞光电	110,300	699,302.00	0.34
14	300939	秋田微	22,200	674,880.00	0.33
15	600742	富维股份	69,500	660,945.00	0.32
16	603987	康德莱	82,500	635,250.00	0.31
17	002282	博深股份	79,900	596,853.00	0.29
18	002950	奥美医疗	68,200	586,520.00	0.28
19	002863	今飞凯达	115,100	583,557.00	0.28
20	600237	铜峰电子	71,400	517,650.00	0.25
21	300800	力合科技	44,600	494,614.00	0.24

22	688128	中国电 器研究 院	19,971	489,289.50	0.24
23	603187	海容冷 链	41,500	488,040.00	0.24
24	300335	迪森股 份	88,400	482,664.00	0.23
25	603230	内蒙新 华	36,900	476,379.00	0.23
26	601609	金田股 份	67,400	472,474.00	0.23
27	603115	海星股 份	31,400	453,102.00	0.22
28	603303	得邦照 明	35,700	430,899.00	0.21
29	002479	富春环 保	85,000	425,850.00	0.21
30	300219	鸿利智 汇	60,700	407,904.00	0.20
31	300686	智动力	39,200	391,608.00	0.19
32	002322	理工能 科	32,000	387,200.00	0.19
33	000156	华数传 媒	47,500	377,150.00	0.18
34	000153	丰原药 业	60,000	370,200.00	0.18
35	600662	外服控 股	70,400	359,744.00	0.17
36	002540	亚太科 技	56,200	327,646.00	0.16
37	300150	世纪瑞 尔	63,200	317,264.00	0.15
38	603387	基蛋生 物	39,300	312,435.00	0.15
39	603609	禾丰股 份	37,800	312,228.00	0.15
40	600703	三安光 电	24,200	300,564.00	0.15
41	600496	精工钢 构	93,000	297,600.00	0.14
42	603861	白云电 器	29,500	291,165.00	0.14
43	300232	洲明科 技	39,900	288,876.00	0.14

44	300319	麦捷科技	26,000	279,240.00	0.14
45	688517	金冠电气	18,501	266,044.38	0.13
46	002328	新朋股份	43,900	255,498.00	0.12
47	002483	润邦股份	40,700	254,375.00	0.12
48	600269	赣粤高速	48,400	244,904.00	0.12
49	000551	创元科技	18,800	241,580.00	0.12
50	300239	东宝生物	40,400	239,572.00	0.12
51	603886	元祖股份	18,300	239,181.00	0.12
52	688616	西力科技	18,400	234,048.00	0.11
53	002209	达意隆	17,900	224,645.00	0.11
54	600268	国电南自	28,100	219,742.00	0.11
55	002303	美盈森	58,300	207,548.00	0.10
56	688334	西高院	11,900	204,442.00	0.10
57	688586	江航飞机装备	17,701	199,136.25	0.10
58	600330	天通股份	27,100	194,307.00	0.09
59	300193	佳士科技	19,800	179,190.00	0.09
60	603601	再升科技	43,400	176,204.00	0.09
61	002394	联发股份	21,300	175,299.00	0.09
62	601811	新华文轩	10,600	154,442.00	0.08
63	300978	东箭科技	13,500	150,660.00	0.07
64	600640	国脉文化	11,600	140,592.00	0.07
65	603408	建霖家居	12,600	138,222.00	0.07
66	000726	鲁泰	21,700	137,578.00	0.07

		A			
67	002912	中新赛克	5,700	135,945.00	0.07
68	688681	科汇电力自动化	9,400	131,600.00	0.06
69	002661	克明食品	12,700	127,127.00	0.06
70	002817	黄山胶囊	17,200	126,936.00	0.06
71	002745	木林森	15,700	123,716.00	0.06
72	601369	陕鼓动力	14,100	123,657.00	0.06
73	000758	中色股份	23,800	119,714.00	0.06
74	002091	江苏国泰	16,300	118,501.00	0.06
75	300289	利德曼	22,500	117,000.00	0.06
76	000553	安道麦 A	16,100	116,242.00	0.06
77	300658	延江股份	17,500	113,225.00	0.06
78	600717	天津港	23,600	107,616.00	0.05
79	301006	迈拓股份	6,800	105,672.00	0.05
80	688015	交控科技	5,000	104,200.00	0.05
81	300447	全信股份	6,600	103,422.00	0.05
82	601200	上海环境	12,600	100,044.00	0.05
83	600594	益佰制药	25,700	98,945.00	0.05
84	002363	隆基机械	12,600	95,886.00	0.05
85	000789	万年青	15,300	83,538.00	0.04
86	601886	江河集团	13,100	80,565.00	0.04
87	688432	有研硅	7,001	77,291.04	0.04
88	600874	创业环保	12,900	77,013.00	0.04
89	603687	大胜达	9,300	69,099.00	0.03
90	000862	银星能源	12,600	68,922.00	0.03

91	002662	峰璟股份	19,600	67,032.00	0.03
92	688689	常州银河微电	2,800	64,596.00	0.03
93	002419	天虹股份	11,700	62,712.00	0.03
94	002441	众业达	6,900	62,583.00	0.03
95	688558	国盛智科股份	2,401	60,601.24	0.03
96	000557	西部创业	11,100	56,610.00	0.03
97	603309	维力医疗	4,300	54,696.00	0.03
98	002516	旷达科技	10,400	53,560.00	0.03
99	300079	数码视讯	9,000	52,650.00	0.03
100	688739	成大生物	1,900	50,160.00	0.02
101	002382	蓝帆医疗	8,800	49,280.00	0.02
102	605365	立达信	3,300	48,609.00	0.02
103	603339	四方科技	4,000	48,000.00	0.02
104	002578	闽发铝业	14,000	46,900.00	0.02
105	603926	铁流股份	4,000	45,440.00	0.02
106	000920	沃顿科技	4,200	45,360.00	0.02
107	300560	中富通	3,100	41,881.00	0.02
108	601002	晋亿实业	8,200	40,426.00	0.02
109	003008	开普检测	1,800	38,250.00	0.02
110	002081	金螳螂	10,800	37,044.00	0.02
111	600075	新疆天业	7,300	30,879.00	0.02
112	600420	国药现代	2,800	29,820.00	0.01
113	002871	伟隆股份	2,500	27,825.00	0.01

114	600626	申达股份	7,500	27,225.00	0.01
115	002331	皖通科技	3,300	26,565.00	0.01
116	002022	科华生物	4,200	25,788.00	0.01
117	600469	风神股份	4,400	24,860.00	0.01
118	000401	冀东水泥	5,500	24,090.00	0.01
119	000978	桂林旅游	3,900	23,907.00	0.01
120	000931	中关村	4,200	22,806.00	0.01
121	605567	春雪食品	2,200	22,506.00	0.01
122	601126	四方股份	1,300	21,151.00	0.01
123	600983	惠而浦	2,000	20,760.00	0.01
124	002884	凌霄泵业	1,300	20,722.00	0.01
125	603385	惠达卫浴	2,800	18,592.00	0.01
126	002942	新农股份	1,000	17,380.00	0.01
127	601801	皖新传媒	2,500	17,075.00	0.01
128	002787	华源控股	2,000	16,340.00	0.01
129	001210	金房能源	1,100	15,059.00	0.01
130	603311	金海高科	1,300	14,378.00	0.01
131	000990	诚志股份	1,900	14,364.00	0.01
132	600351	亚宝药业	2,300	13,961.00	0.01
133	603235	天新药业	500	13,645.00	0.01
134	002344	海宁皮城	3,100	13,454.00	0.01
135	688055	昆山龙腾光电	3,600	13,320.00	0.01

136	300206	理邦仪器	1,100	13,222.00	0.01
137	002788	鹭燕医药	1,500	12,855.00	0.01
138	001218	丽臣实业	700	12,775.00	0.01
139	300732	设研院	1,700	12,274.00	0.01
140	688057	金达莱环保	1,000	12,200.00	0.01
141	603010	万盛股份	1,100	10,934.00	0.01
142	600745	闻泰科技	300	10,059.00	0.00
143	300389	艾比森	800	9,264.00	0.00
144	600784	鲁银投资	1,200	7,680.00	0.00
145	600508	上海能源	600	7,020.00	0.00
146	601686	友发集团	1,200	6,816.00	0.00
147	688296	和达科技	505	6,630.65	0.00
148	603053	成都燃气	600	5,766.00	0.00
149	600335	国机汽车	500	3,225.00	0.00
150	688030	山石网科	200	3,198.00	0.00
151	002763	汇洁股份	400	2,760.00	0.00
152	002585	双星新材	300	1,638.00	0.00
153	600819	耀皮玻璃	200	1,164.00	0.00
154	603558	健盛集团	100	911.00	0.00
155	300787	海能实业	40	554.00	0.00

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	300750	宁德时代	4,310,292.00	1.42
2	600519	贵州茅台	4,303,569.00	1.42
3	601318	中国平安	3,838,388.00	1.27
4	600036	招商银行	3,449,661.00	1.14
5	601288	农业银行	3,362,063.00	1.11
6	601398	工商银行	3,271,286.00	1.08
7	002475	立讯精密	3,216,388.00	1.06
8	000333	美的集团	3,018,091.00	1.00
9	002152	广电运通	2,976,262.00	0.98
10	002241	歌尔股份	2,939,926.00	0.97
11	600941	中国移动	2,808,276.00	0.93
12	601658	邮储银行	2,749,086.00	0.91
13	600487	亨通光电	2,734,053.00	0.90
14	601766	中国中车	2,663,205.00	0.88
15	601857	中国石油	2,557,330.00	0.85
16	002594	比亚迪	2,523,988.00	0.83
17	600050	中国联通	2,519,772.00	0.83
18	300433	蓝思科技	2,512,115.00	0.83
19	600031	三一重工	2,502,690.00	0.83
20	000858	五粮液	2,462,172.00	0.81

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	600519	贵州茅台	6,725,857.00	2.22
2	601318	中国平安	6,636,148.00	2.19
3	300750	宁德时代	5,474,422.00	1.81
4	600036	招商银行	4,975,667.00	1.64
5	000333	美的集团	4,457,852.00	1.47
6	300433	蓝思科技	4,354,446.97	1.44
7	600050	中国联通	4,008,830.00	1.32
8	601211	国泰海通	3,803,445.00	1.26
9	002475	立讯精密	3,650,742.00	1.21
10	002152	广电运通	3,400,563.00	1.12
11	601166	兴业银行	3,281,453.00	1.08
12	601138	工业富联	3,246,279.00	1.07
13	601766	中国中车	3,182,468.00	1.05

14	002594	比亚迪	3,141,233.00	1.04
15	002241	歌尔股份	3,122,625.00	1.03
16	600887	伊利股份	2,946,999.00	0.97
17	601088	中国神华	2,886,660.00	0.95
18	601899	紫金矿业	2,850,375.00	0.94
19	601728	中国电信	2,793,316.00	0.92
20	601169	北京银行	2,750,539.00	0.91

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	452,719,627.05
卖出股票收入（成交）总额	548,315,082.03

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	1,700.11	0.00
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,700.11	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	17	1,700.11	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,017,693.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,017,693.11

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

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。

§ 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

份额 级别	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 (%)
汇添 富中 证 800 指数 增强 A	2,189	34,586.42	42,035,237.48	55.52	33,674,444.21	44.48
汇添 富中 证 800 指数 增强 C	3,009	36,167.59	8,032,988.99	7.38	100,795,276.66	92.62
合计	5,198	35,501.72	50,068,226.47	27.13	134,469,720.87	72.87

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 （%）
基金管理人所有	汇添富中证 800	636,361.32	0.84

从业人员持有本基金	指数增强 A		
	汇添富中证 800 指数增强 C	673.24	0.00
	合计	637,034.56	0.35

8.3 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	份额级别	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	汇添富中证 800 指数增强 A	0
	汇添富中证 800 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 800 指数增强 A	10~50
	汇添富中证 800 指数增强 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 800 指数增强 A	汇添富中证 800 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 05 月 19 日）基金份额总额	82,755,143.11	295,301,659.92
本报告期期初基金份额总额	95,740,341.65	183,999,042.70
本报告期基金总申购份额	135,922,337.21	649,228,030.78
减：本报告期基金总赎回份额	155,952,997.17	724,398,807.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	75,709,681.69	108,828,265.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内无其他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况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	

			(%)		(%)	
中信 证券	2	380,234,913.51	37.98	69,083.71	38.02	
中信 证券 华南	3	357,579,720.95	35.72	64,876.91	35.71	
国泰 海通	3	263,220,074.62	26.29	47,740.59	26.27	

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 (%)
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券 华南	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 海通	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司,租用其交易单元。
- (2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限,需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)

- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。
- (6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第四季度报告	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报	2025 年 01 月 22 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年年报	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 31 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 上证报	2025 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 22 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 05 月 23 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 深交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 05 月 23 日
7	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 16 日
8	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行（中国）有限公司合作关系的公告	上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

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 800 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2025 年 08 月 29 日