

汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 03 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。本年度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 2024 年 3 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。

本报告期自 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
4.9 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.....	21
§ 5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	21
§ 6 审计报告	22
6.1 审计报告的基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
§ 7 年度财务报表.....	23
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	25
7.3 净资产变动表	26
7.4 报表附注	27
§ 8 投资组合报告.....	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	54
8.3 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.....	55

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
8.6 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.....	70
8.7 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.....	70
8.8 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.....	70
8.9 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.....	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12 投资组合报告附注.....	70
§ 9 基金份额持有人信息.....	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
9.3 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.....	72
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	72
§ 10 开放式基金份额变动.....	72
§ 11 重大事件揭示.....	73
11.1 基金份额持有人大会决议.....	73
11.2 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.....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
11.4 基金投资策略的改变.....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11.8 其他重大事件.....	75
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
12.1 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.....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§ 13 备查文件目录.....	76
13.1 备查文件目录.....	76
13.2 存放地点.....	77
13.3 查阅方式.....	77

§ 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)	244,078,724.30	
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)	60,067,756.37	184,010,967.93

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%，年跟踪误差不得超过 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		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	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		李文	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 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	639,335.93	3,942,670.16
本期利润	-2,055,339.77	-1,777,778.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0281	-0.0082
本期加权平均净值利	-2.82%	-0.83%

润率		
本期基金份额净值增长率	-4.11%	-4.34%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
期末可供分配利润	-2,471,164.69	-7,990,775.46
期末可供分配基金份额利润	-0.0411	-0.0434
期末基金资产净值	57,596,591.68	176,020,192.47
期末基金份额净值	0.9589	0.9566
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
基金份额累计净值增长率	-4.11%	-4.34%

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。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2023 年 05 月 19 日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2023 年 12 月 31 日数据，特此说明。

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
过去三个月	-3.87%	0.65%	-6.06%	0.74%	2.19%	-0.09%
过去六个月	-5.40%	0.69%	-9.87%	0.79%	4.47%	-0.10%
自基金合同生效日起	-4.11%	0.66%	-12.16%	0.78%	8.05%	-0.12%

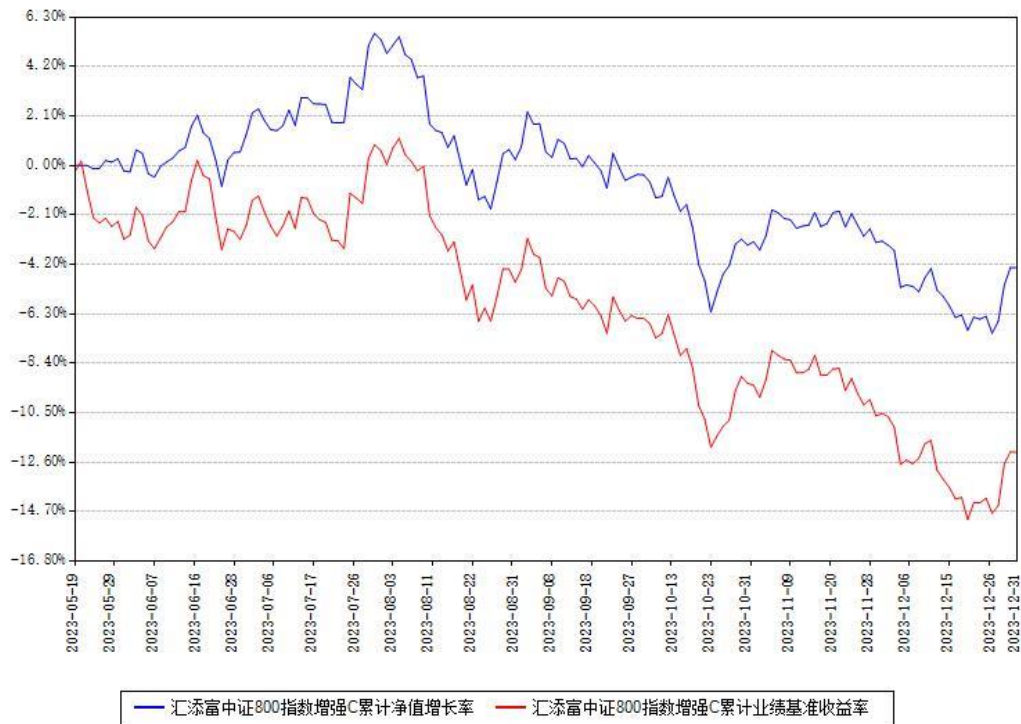
汇添富中证 800 指数增强 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.97%	0.65%	-6.06%	0.74%	2.09%	-0.09%
过去六个月	-5.58%	0.69%	-9.87%	0.79%	4.29%	-0.10%
自基金合同生效日起至今	-4.34%	0.66%	-12.16%	0.78%	7.82%	-0.12%

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



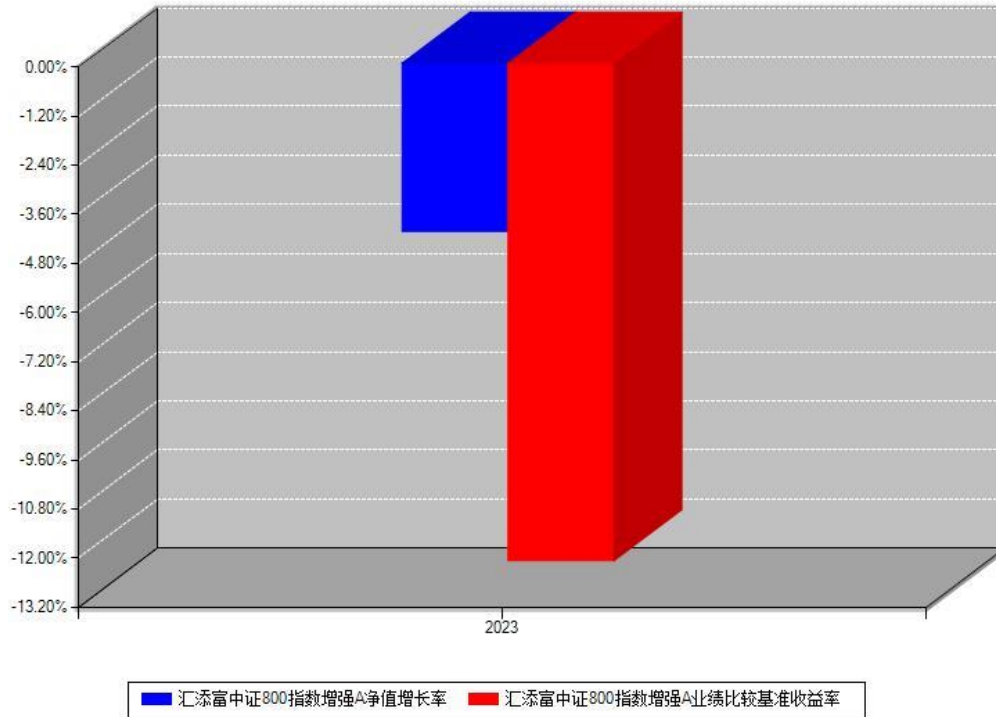
汇添富中证800指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



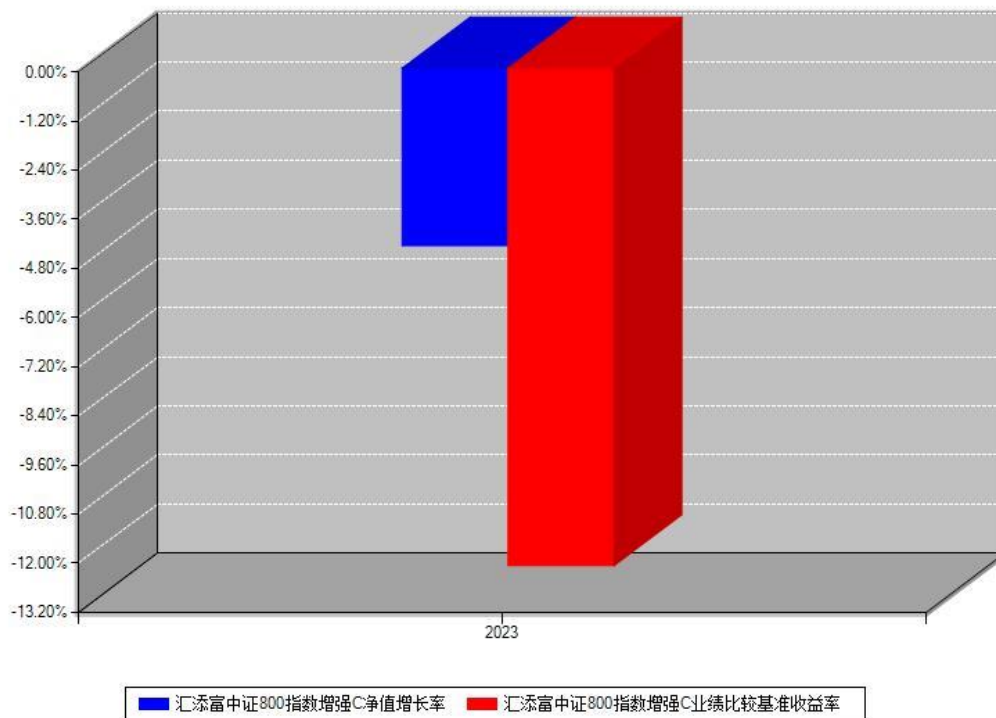
注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 05 月 19 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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每年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每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 05 月 19 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 05 月 19 日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

§ 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。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 年，汇添富基金新成立 48 只公募基金，包括 14 只混合型基金，21 只股票型基金，13 只债券型基金。2023 年底，公司公募基金产品总数达 318 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2023 年，汇添富基金坚持以“客户体验”为中心，以“创新”为宗旨，以“服务”为生命力，稳扎稳打实现互联网平台全方位发展。全年大力开拓投顾式销售及服务模式，持续提升自有平台创新能力。全面致力于基于买方视角下的投顾服务转型，提升客户投资的服务体验。通过打通公司投研端和销售端，实现资源共享最大化，为投顾转型提供更加充实的底层能力支持；同时针对客户端，通过投顾专区进行改版升级，优化投顾策略推荐逻辑，融入丰富的投资工具、工具使用场景和丰富的资讯、内容服务，提升客户投资体验，践行公司投

顾转型战略目标。

与此同时，积极拥抱第三方互联网基金销售平台，进一步加强与多家互联网巨头的深度合作。围绕客户需求，重构客户中心、资产中心、产品中心、内容中心、活动中心等，全面进行平台运营体系化建设。以开放、转型、服务、共享为目标，搭建以内容中台、营销运营中台、理财师中台、投顾中台等为主要模块的数字中台矩阵。坚持致力于为客户提供全生命周期服务，力争通过金融科技全流程赋能加持，进一步提升客户满意度。

2023 年，汇添富基金继续坚定推进与核心机构客户的合作战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司为机构投资者提供综合解决方案，并深受机构投资者信任。公司不断提升客户服务及产品运营能力，聚焦战略级机构客户，与银行及银行理财公司加快合作，保险规模维持市场领先地位。积极布局多只创新型品种，满足机构投资者专业化需求。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合账户数量持续增加。同时在数字化建设上开展系统平台建设，为客户及团队赋能。

2023 年渠道客户偏好低风险化、渠道运营线上线下一体化趋势愈加明显，公司持续深化核心渠道战略，始终秉持“客户第一”的价值观，围绕如何提升客户“获得感”，优化客户持有体验开展系列渠道服务和投资者教育工作。积极利用线上化数字营销工具，对客户进行分类经营和分层触达，建立精准的客户画像，提供标准化、体系化、专业化的客户陪伴。积极践行金融科技创新，搭建了一站式投研资讯服务平台，提供紧贴市场的专业投资服务，以及便捷高效的营销辅助工具，赋能渠道客户经理。全年合计开展超 8481 余场“价值投资添富行”线上、线下系列活动。大力开展走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列投资者教育活动，营销培训活动覆盖至各渠道分支机构。

2023 年是券商渠道业务服务深化的一年。为了更好地服务券商渠道客户，公司在 2023 年度组织了超过 2600 场的线上和线下投教、路演活动，主题包括 ETF 大讲堂、走进汇添富、基金经理面对面、投资策略报告会等，覆盖了各重点券商渠道的重点分支机构和营业部，旨在为一线投顾赋能的同时，也为广大投资者提供更全面的投资策略交流机会。此外，公司在重点券商渠道积极推广“指能添富”品牌和策略，并结合市场情况，为券商渠道提供相关 ETF 及指数增强产品的配置建议及以客户为中心的解决方案。

2023 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，优化客户服务体系，为公司各项业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2023 年，汇添富香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化，并继续发挥显着成效，国际业务总资产管理规模保持稳定。汇添富香港子公司发行汇添富美元货币市场基金，进一步完善海外产品线布局，涵盖境外权益、固收、货币类产品，为投资者全球资产分散化布局进一步打下基础，“汇添富中港策略基金”保持国际权威基金评级机构晨星五星评级。从 2023 年年初开始，继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通，进一步完善个性化客户服务体系，积极引导长期资金入市。

2023 年以来，汇添富积极投身公益慈善，充分发挥公募基金力量，履行社会责任，助力实现“共同富裕”。教育助学方面，连续十五年开展“河流·孩子”公益助学项目，组织党支部开展 9 场公益行活动，约 300 名党员、员工、客户与合作伙伴成为公益志愿者，相继回访了四川美姑、贵州黎平、云南怒江、青海互助、内蒙扎兰屯、宁夏泾源、广西百色、湖北恩施、湖南城步等中西部的添富小学，开展学校调研、梦想课堂、学生走访。在上海成功举办“河流·孩子”十五周年公益音乐会及艺术夏令营，帮助来自大山深处、偏远河畔的孩子们开阔眼界、增长见识、提升素养；举办第十六期“河流·孩子”乡村优秀青年教师培训，赋能了 80 位乡村优秀青年教师，助力乡村教师掌握先进的教育理念与教学方法。金融慈善方面，积极探索创新公益新模式，在中国基金业协会的指导和支持下，举办第二期、第三期“基业上善”慈善资产管理研修营，三期累计已为 87 家基金会培养了 190 名慈善资产管理专业人才，涵盖的慈善资产规模超过 148 亿元，用专业力量推动我国公益慈善事业的可持续发展。参与中国慈善联合会《慈善组织投资管理指南》团体标准起草，助力慈善资产管理的规范化和高质量发展。爱国拥军方面，携手上海市拥军优属基金会开展“崇敬英雄”公益项目，成为“爱国拥军支持单位”，进一步服务国防建设及拥军优属事业。社区公益方面，携手小东门街道开展南外滩健康直通车项目，参与小东门社区公益发展专项基金，支持本地社区建设，共建更有温度的美好社区。乡村振兴方面，参加云南、青海、内蒙古等地产业、教育和养老助老帮扶等项目，深化东西部协作帮扶，助力乡村振兴。

2024 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

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）	证券从业年限	说明
----	----	---------------	--------	----

		期限		(年)	
		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	-	13	<p>国籍：中国。</p> <p>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 日至今任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至今任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今</p>

					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。
--	--	--	--	--	---

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

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老保险组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合;涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:

在研究分析环节,公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统,规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程,使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节,公司建立健全投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限,合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节,本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门,实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易,内部制定了相应的交易管理规则,保证各投资组合获得公平的交易执行机会;对于银行间市场的现券、回购等场外交易,交易部在交易市场开展独立、公平的询价,确保交易得到公平执行;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配,确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节,公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式,对投资交易全过程实施监督,对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 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。

4.3.3 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 45 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

回顾 2023 年，中国宏观经济整体呈现结构性复苏态势。经济趋势温和回暖，上半年节后复工复产加快，出行链持续修复，工业生产逐步复苏；下半年宏观调控组合政策发力显效，局部数据企稳回升，经济向好的态势得到延续。经济在结构上呈现新旧动能转换态势，消费和服务业、高端制造等对经济的贡献在上升，而地产、投资、出口的贡献在下降。政策方向上坚持高质量发展，宏观调控注重精准，维持流动性合理充裕，中央财政加杠杆和提高存量政策有效性等政策思路显现。海外方面，2023 年前三季度美债收益率和美元指数持续波动上涨，抑制全球风险资产表现；四季度美债利率见顶下行，美元指数走低，全球风险资产有所提振。

受经济复苏节奏、资金边际流向、投资者预期、人工智能热潮、央企价值重估等因素的影响，全年市场整体震荡下行，行业和风格波动较大，行业板块方面，AI 及中特估相关板块上涨较多，地产链及消费板块跌幅靠前；风格方面，整体仍呈现小盘优于大盘、价值优于成长的特性。量化选股因子方面，质量、低波动、低估值等逆向类因子以及交易类因子仍延续之前的较好表现，与此同时，成长、预期等因子整体表现一般。

报告期内，本基金遵循指数增强基金的投资原则，相对业绩比较基准保持了相对均衡的行业配置和风格配置，在质量、估值、市场面等各类选股因子上保持了相对均衡的暴露，跟踪误差在预期范围内。团队在新因子开发上持续努力，一些创新类因子整体表现出色，对超额收益有所贡献。未来仍需要不断推进对量化选股模型的迭代优化，提升组合精细化管理和对市场风格变动的适应能力。

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-4.11%，同期业绩比较基准收益率为-12.16%。本报告期汇添富中证 800 指数增强 C 类份额净值增长率为-4.34%，同期业绩比较基准收益率为-12.16%。

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 2024 年，高质量发展仍是时代主题，整体宏观经济以稳为主。调控效果预计在新的一年里逐步显现，三大工程相关的财政准财政支撑有望缓解地产的下滑困境，居民消费潜力仍有释放空间，这些因素有利于巩固经济回升态势。同时，随着海外通胀逐步得到控制，外部流动性有望边际宽松；海外地区冲突造成的不确定性逐步被市场消化；AI 等科技创新有望推动产业革新和提升生产力。总体来看，投资面临的不确定性可能会降低。然而，我们也需要看到一些中长期的挑战：内需的提振需要长期信心的修复，居民端预期和企业端投资需

求仍在低位，可能需要较长时间的恢复过程；地产链的风险在短期内逐步化解，但长期受城镇化程度、人口结构和出生率等因素影响；外需仍受到压制，海外主要经济体受到加息周期的滞后影响仍面临一定下行压力。从政策预期来看，财政准财政政策可能成为托底经济的主导力量，同时货币政策提供适度的流动性支持，降准降息存在一定空间，总体仍然是稳总量重结构，强调政策的精准有效。总体来说，机遇大于挑战，我们有理由对市场前景相对乐观。

目前 A 股整体估值仍然处于历史低位，具有较高的估值性价比和安全边际，向下空间有限。随着经济复苏和市场信心修复，市场很可能迎来较好的投资机会。在行业方面，科技创新、经济复苏和战略安全相关行业仍可能存在相对长期的投资机会。在风格方面，随着经济增长和外部不确定性的降低，投资者信心有望修复，可能重新拉长“投资久期”，关注公司的基本面价值，成长和价值、大盘及小盘风格间可能出现一定的再平衡。选股因子表现也有望更为均衡，除了去年表现较好的质量、估值、交易类因子外，基本面趋势相关的成长、盈利、预期类因子也可能出现超额修复。

汇添富中证 800 指数增强基金使用量化选股模型挑选个股，同时保持风格和行业的相对均衡，具有较鲜明的大中盘均衡风格。随着经济企稳，经济关联度高，基本面质地优良，估值合理的大中市值公司可能有所表现，给中证 800 增强带来较好的投资机会。未来，我们将进一步加大量化模型的研究深度，扩展新技术、新数据在量化投资中的应用，提高信息的发掘和利用效率，提升风险管理和组合精细化管理能力。汇添富中证 800 指数增强基金将继续严格遵守基金合同，追求相对业绩比较基准的较为稳定的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规法务管理

公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的公司价值观，完善合规管理体系，提升专业能力，优化合规资源配置，不断提升合规管理工作的有效性。公司坚持广泛开展合规培训、强化从业人员合规意识，不断夯实公司合规文化体系基础；持续完善公司制度流程体系、优化合规管理制度机制，通过统一的合规审核标准、动态调整的合规管理指引，有效把控各类业务的合规关键点，防范潜在风险，保障各项业务规范开展；深入细致开展合规审查工作，为各部门提供有效的合规咨询与法务支持，督促强化一线合规执行效果；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；优化从业人员管理机制，加强管理措施，严格执行合规考核问责机制，引导全体员工不断提升合规执业意识，强化公司合规履职保障。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品的设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报告与监督；通过协调并协助监管机构、第三方独立机构开展各项自查、核查以及审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过对各项检查、审计发现的风险隐患的整改情况进行跟踪检查，持续优化内控管理水平，切实维护基金持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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,汇添富基金管理股份有限公司在汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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 托管人对本年度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年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2024)审字第 70015647_B282 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 5 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 5 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止</p>

	<p>运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔺育化 韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2024 年 03 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	11,955,595.87
结算备付金		31,316.72
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	218,412,976.54
其中：股票投资		218,412,976.54
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
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		6,364,309.16
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		236,764,198.29
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		2,753,086.17
应付管理人报酬		197,534.76
应付托管费		19,753.51
应付销售服务费		57,039.70
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	7.4.7.7	120,000.00
负债合计		3,147,414.14
净资产：		
实收基金	7.4.7.8	244,078,724.30
未分配利润	7.4.7.9	-10,461,940.15
净资产合计		233,616,784.15
负债和净资产总计		236,764,198.29

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 244,078,724.30 份。本基金下属汇添富中证 800 指数增强 A 基金份额净值 0.9589 元，基金份额总额 60,067,756.37 份；本基金下属汇添富中证 800 指数增强 C 基金份额净值 0.9566 元，基金份额总额 184,010,967.93 份。

2、本基金合同于 2023 年 05 月 19 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2023 年 12 月 31 日数据，特此说明。

7.2 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：2023 年 05 月 19 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,211,837.50
1. 利息收入		234,674.90
其中：存款利息收入	7.4.7.10	234,674.90
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）		6,856,594.04
其中：股票投资收益	7.4.7.11	123,059.03
基金投资收益	7.4.7.12	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	6,733,535.01

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）	7.4.7.18	-8,415,124.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	112,017.68
减：二、营业总支出		2,621,280.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,786,984.37
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	178,698.54
3. 销售服务费		534,397.62
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	7.4.7.20	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.21	121,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,833,118.03
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,833,118.03
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-3,833,118.03

注：本基金合同于 2023 年 05 月 19 日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

7.3 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：2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	378,056,803.03	-	378,056,803.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-133,978,078.73	-10,461,940.15	-144,440,018.88

(一)、综合收益总额	-	-3,833,118.03	-3,833,118.03
(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)	-133,978,078.73	-6,628,822.12	-140,606,900.85
其中: 1. 基金申购款	298,877,972.28	-4,312,800.85	294,565,171.43
2. 基金赎回款	-432,856,051.01	-2,316,021.27	-435,172,072.28
(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	244,078,724.30	-10,461,940.15	233,616,784.15

注: 本基金合同于 2023 年 05 月 19 日生效, 本报无上年度可比期间, 特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>张暉</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

7.4 报表附注

7.4.1 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。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。

本基金的标的指数为中证 800 指数。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托

凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具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)。本基金还可根据法律法规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:本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。其中,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 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 12 月 31

日的财务状况以及 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础,对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项,本基金运用简化计量方法,按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产,本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加,如果信用风险自初始确认后未显著增加,处于第一阶段,本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果初始确认后发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照摊余成本和实际利率计算利息收入;

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础,通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险,以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况;

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括:通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值,以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息;

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时,该金融资产成为已发生信用减值的金融资产;

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融

负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不

可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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；

2、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；

3、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；

4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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；

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	4,036,263.96
等于：本金	4,032,305.83
加：应计利息	3,958.13
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	7,919,331.91
等于：本金	7,918,923.20
加：应计利息	408.71
减：坏账准备	-

合计	11,955,595.87
----	---------------

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	226,828,100.66	-	218,412,976.54	-8,415,124.12
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	226,828,100.66	-	218,412,976.54	-8,415,124.12

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

7.4.7.5.2 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。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	50,000.00
应付信息披露费	70,000.00
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	-
其他	-
合计	120,000.00

7.4.7.8 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 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	82,755,143.11	82,755,143.11
本期申购	34,092,171.90	34,092,171.90
本期赎回（以“-”号填列）	-56,779,558.64	-56,779,558.64
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	60,067,756.37	60,067,756.37
汇添富中证 800 指数增强 C		
项目	本期 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	295,301,659.92	295,301,659.92
本期申购	264,785,800.38	264,785,800.38
本期赎回（以“-”号填列）	-376,076,492.37	-376,076,492.37
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	184,010,967.93	184,010,967.93

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

2、本基金合同于 2023 年 05 月 19 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 377,988,745.07 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 68,057.96 元，以上实收基金（本息）合计人民币 378,056,803.03 元，折合 378,056,803.03 份人民币基金份额。

7.4.7.9 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	639,335.93	-2,694,675.70	-2,055,339.77
本期基金份额交易产生的变动数	-406,257.45	-9,567.47	-415,824.92
其中：基金申购款	912,393.48	-1,175,455.25	-263,061.77
基金赎回款	-1,318,650.93	1,165,887.78	-152,763.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	233,078.48	-2,704,243.17	-2,471,164.69
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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,942,670.16	-5,720,448.42	-1,777,778.26

本期基金份额交易产生的变动数	-3,657,938.97	-2,555,058.23	-6,212,997.20
其中：基金申购款	5,922,802.00	-9,972,541.08	-4,049,739.08
基金赎回款	-9,580,740.97	7,417,482.85	-2,163,258.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	284,731.19	-8,275,506.65	-7,990,775.46

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	183,519.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	20,838.53
结算备付金利息收入	30,316.72
其他	-
合计	234,674.90

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,160,966,635.16
减：卖出股票成本总额	1,158,611,375.32
减：交易费用	2,232,200.81
买卖股票差价收入	123,059.03

7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 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。

7.4.7.16.2 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。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,733,535.01
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	6,733,535.01

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-8,415,124.12
——股票投资	-8,415,124.12
——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	-8,415,124.12

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	112,017.68
替代损益	-
其他	-
合计	112,017.68

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	70,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	1,200.00
上市费	-
或有管理费	-
其他	-
合计	121,200.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (新加坡) 有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 05 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
中信证券	1,412,429,837.81	55.47

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 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 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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	602,605.35	55.46	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,786,984.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	136,929.81
应支付基金管理人的净管理费	1,650,054.56

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于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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年
----	---

	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	178,698.54

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。

7.4.10.2.3 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 2023 年 05 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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
中信证券股份有限公司	-	298,152.11	298,152.11
东方证券股份有限公司	-	205.30	205.30
汇添富基金管理股份有限公司	-	25,271.80	25,271.80
合计	-	323,629.21	323,629.21

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注:本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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:本基金本报告期末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。

7.4.10.4.2 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:本基金本报告期末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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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末运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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:本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金本报告期末无由关联方保管的银行存款余额,本报告期末有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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。

7.4.12 期末(2023年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2023 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	11,955,595.87	-	-	-	-	-	11,955,595.87
结算备付金	31,316.72	-	-	-	-	-	31,316.72
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	218,412,976.54	218,412,976.54
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	-	-	-	-	-	6,364,309.16	6,364,309.16
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,986,912.59	-	-	-	-	224,777,285.70	236,764,198.29

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	-	-	-	-	-	2,753,086.17	2,753,086.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	197,534.76	197,534.76
应付托管费	-	-	-	-	-	19,753.51	19,753.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	57,039.70	57,039.70
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	-	-	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,147,414.14	3,147,414.14
利率敏感度缺口	11,986,912.59	-	-	-	-	221,629,871.56	233,616,784.15

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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	218,412,976.54	93.49
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	218,412,976.54	93.49

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日
	中证 800 指数上涨 5%	8,971,900.65
	中证 800 指数下跌 5%	-8,971,900.65

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	218,412,976.54
第二层次	-
第三层次	-
合计	218,412,976.54

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.4 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。

7.4.14.5 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。

7.4.15 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“4.9 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	218,412,976.54	92.25
	其中：股票	218,412,976.54	92.25
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	11,986,912.59	5.06
8	其他各项资产	6,364,309.16	2.69
9	合计	236,764,198.29	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	225,767.00	0.10
B	采矿业	10,997,382.00	4.71
C	制造业	99,184,867.26	42.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,134,204.90	2.20
E	建筑业	2,542,273.00	1.09
F	批发和零售业	4,173,396.00	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	5,128,755.21	2.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,854,764.20	1.65
J	金融业	41,219,382.10	17.64
K	房地产业	3,409,309.00	1.46
L	租赁和商务服务业	1,040,560.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	257,573.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	1,099,625.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	583,451.40	0.25
R	文化、体育和娱乐业	157,542.00	0.07
S	综合	219,538.00	0.09
	合计	179,228,390.07	76.72

8.2.2 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	37,099,629.10	15.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,916.00	0.03
E	建筑业	48,391.77	0.02
F	批发和零售业	118,821.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	483,448.00	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	889,400.00	0.38
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	395,676.60	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	90,304.00	0.04

0	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	39,184,586.47	16.77

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	6,300	10,873,800.00	4.65
2	601318	中国平安	116,500	4,694,950.00	2.01
3	300750	宁德时代	24,060	3,928,035.60	1.68
4	600036	招商银行	137,200	3,816,904.00	1.63
5	002415	海康威视	85,000	2,951,200.00	1.26
6	000725	京东方 A	716,000	2,792,400.00	1.20
7	000333	美的集团	49,800	2,720,574.00	1.16
8	000858	五粮液	18,900	2,651,859.00	1.14
9	601328	交通银行	436,800	2,507,232.00	1.07
10	601166	兴业银行	148,600	2,408,806.00	1.03
11	000338	潍柴动力	162,700	2,220,855.00	0.95
12	600028	中国石化	373,800	2,085,804.00	0.89
13	601088	中国神华	65,000	2,037,750.00	0.87
14	000651	格力电器	62,100	1,997,757.00	0.86
15	600900	长江电力	81,000	1,890,540.00	0.81
16	600276	恒瑞医药	41,240	1,865,285.20	0.80
17	600016	民生银行	441,100	1,649,714.00	0.71
18	600875	东方电气	112,400	1,643,288.00	0.70
19	002138	顺络电子	60,000	1,620,600.00	0.69
20	002185	华天科技	189,000	1,610,280.00	0.69
21	601211	国泰君安	107,800	1,604,064.00	0.69
22	002475	立讯精密	46,300	1,595,035.00	0.68
23	601398	工商银行	328,600	1,570,708.00	0.67

24	600690	海尔智家	74,700	1,568,700.00	0.67
25	600887	伊利股份	58,600	1,567,550.00	0.67
26	300296	利亚德	258,300	1,549,800.00	0.66
27	601319	中国人保	314,000	1,519,760.00	0.65
28	600332	白云山	51,000	1,458,600.00	0.62
29	600489	中金黄金	145,700	1,451,172.00	0.62
30	601225	陕西煤业	66,700	1,393,363.00	0.60
31	600918	中泰证券	203,100	1,393,266.00	0.60
32	000089	深圳机场	210,200	1,351,586.00	0.58
33	002423	中粮资本	201,800	1,348,024.00	0.58
34	000623	吉林敖东	88,800	1,344,432.00	0.58
35	600497	驰宏锌锗	263,600	1,331,180.00	0.57
36	600739	辽宁成大	112,300	1,322,894.00	0.57
37	000636	风华高科	96,600	1,319,556.00	0.56
38	002608	江苏国信	199,700	1,312,029.00	0.56
39	601231	环旭电子	84,800	1,281,328.00	0.55
40	600000	浦发银行	192,700	1,275,674.00	0.55
41	000559	万向钱潮	245,700	1,275,183.00	0.55
42	601607	上海医药	75,600	1,264,788.00	0.54
43	601668	中国建筑	261,600	1,258,296.00	0.54
44	000568	泸州老窖	6,900	1,237,998.00	0.53
45	002736	国信证券	138,500	1,182,790.00	0.51
46	000877	天山股份	175,600	1,173,008.00	0.50
47	601688	华泰证券	81,980	1,143,621.00	0.49
48	002064	华峰化学	170,000	1,140,700.00	0.49
49	601288	农业银行	312,100	1,136,044.00	0.49
50	000729	燕京啤酒	129,800	1,120,174.00	0.48
51	600580	卧龙电驱	94,100	1,103,793.00	0.47
52	000967	盈峰环境	231,500	1,099,625.00	0.47
53	601568	北元集团	230,790	1,093,944.60	0.47
54	600309	万华化学	14,100	1,083,162.00	0.46
55	000783	长江证券	196,300	1,056,094.00	0.45
56	600663	陆家嘴	117,724	1,030,085.00	0.44
57	001914	招商积余	86,100	1,029,756.00	0.44
58	300009	安科生物	100,400	1,026,088.00	0.44
59	000513	丽珠集团	28,700	1,004,787.00	0.43
60	000166	申万宏源	223,100	990,564.00	0.42
61	600999	招商证券	70,700	964,348.00	0.41
62	002563	森马服饰	164,900	951,473.00	0.41
63	000401	冀东水泥	142,600	911,214.00	0.39
64	600104	上汽集团	66,600	901,098.00	0.39
65	600390	五矿资本	185,400	867,672.00	0.37
66	002010	传化智联	187,200	864,864.00	0.37

67	002683	广东宏大	42,900	861,432.00	0.37
68	600837	海通证券	91,900	861,103.00	0.37
69	600885	宏发股份	31,000	856,840.00	0.37
70	001872	招商港口	53,600	855,456.00	0.37
71	601988	中国银行	208,600	832,314.00	0.36
72	000001	平安银行	88,500	831,015.00	0.36
73	000060	中金岭南	188,000	812,160.00	0.35
74	000063	中兴通讯	29,900	791,752.00	0.34
75	601601	中国太保	32,400	770,472.00	0.33
76	000100	TCL 科技	177,600	763,680.00	0.33
77	000887	中鼎股份	59,700	738,489.00	0.32
78	600827	百联股份	77,000	730,730.00	0.31
79	000959	首钢股份	204,200	706,532.00	0.30
80	688819	天能电池 集团股份	25,000	698,000.00	0.30
81	601985	中国核电	92,400	693,000.00	0.30
82	601186	中国铁建	87,600	666,636.00	0.29
83	600919	江苏银行	99,200	663,648.00	0.28
84	601857	中国石油	93,500	660,110.00	0.28
85	002600	领益智造	95,200	643,552.00	0.28
86	601816	京沪高铁	126,500	622,380.00	0.27
87	600061	国投资本	90,200	607,948.00	0.26
88	300001	特锐德	30,100	605,010.00	0.26
89	002690	美亚光电	30,800	604,912.00	0.26
90	601766	中国中车	114,620	602,901.20	0.26
91	603927	中科软	20,000	599,600.00	0.26
92	002001	新 和 成	35,200	596,992.00	0.26
93	002236	大华股份	32,200	594,090.00	0.25
94	600126	杭钢股份	111,300	593,229.00	0.25
95	002511	中顺洁柔	58,500	585,000.00	0.25
96	601728	中国电信	104,600	565,886.00	0.24
97	000830	鲁西化工	55,800	559,674.00	0.24
98	600660	福耀玻璃	14,700	549,633.00	0.24
99	002841	视源股份	12,000	549,120.00	0.24
99	600498	烽火通信	33,000	549,120.00	0.24
101	601006	大秦铁路	75,901	547,246.21	0.23
102	601390	中国中铁	94,900	539,032.00	0.23
103	601138	工业富联	35,600	538,272.00	0.23
104	300015	爱尔眼科	33,720	533,450.40	0.23
105	601298	青岛港	85,100	525,918.00	0.23
106	601939	建设银行	76,700	499,317.00	0.21
107	600380	健康元	39,000	484,770.00	0.21
108	600801	华新水泥	37,500	466,125.00	0.20

109	002056	横店东磁	34,400	465,776.00	0.20
110	600637	东方明珠	61,510	462,555.20	0.20
111	600848	上海临港	45,400	456,270.00	0.20
112	601216	君正集团	111,800	418,132.00	0.18
113	300408	三环集团	14,000	412,300.00	0.18
114	002050	三花智控	13,900	408,660.00	0.17
115	600019	宝钢股份	68,400	405,612.00	0.17
116	000538	云南白药	8,240	404,996.00	0.17
117	601577	长沙银行	59,300	404,426.00	0.17
118	601336	新华保险	12,900	401,577.00	0.17
119	000938	紫光股份	20,700	400,545.00	0.17
120	002594	比亚迪	2,000	396,000.00	0.17
121	600584	长电科技	13,100	391,166.00	0.17
122	600741	华域汽车	23,800	387,464.00	0.17
123	002152	广电运通	31,600	387,416.00	0.17
124	002128	电投能源	27,000	385,290.00	0.16
125	600893	航发动力	10,300	385,014.00	0.16
126	601658	邮储银行	87,300	379,755.00	0.16
127	601377	兴业证券	64,600	379,202.00	0.16
128	601600	中国铝业	66,315	374,016.60	0.16
129	601009	南京银行	47,995	354,203.10	0.15
130	002373	千方科技	31,400	351,994.00	0.15
131	002304	洋河股份	3,200	351,680.00	0.15
132	300760	迈瑞医疗	1,200	348,720.00	0.15
133	600352	浙江龙盛	41,500	348,600.00	0.15
134	600050	中国联通	79,000	346,020.00	0.15
135	002202	金风科技	43,000	344,000.00	0.15
136	601169	北京银行	74,900	339,297.00	0.15
137	000963	华东医药	8,100	335,826.00	0.14
138	600597	光明乳业	38,200	333,486.00	0.14
139	600588	用友网络	18,600	330,894.00	0.14
140	000932	华菱钢铁	64,200	330,630.00	0.14
141	600015	华夏银行	58,600	329,332.00	0.14
142	600009	上海机场	10,000	327,800.00	0.14
143	002422	科伦药业	10,800	313,740.00	0.13
144	002925	盈趣科技	15,900	309,573.00	0.13
145	000157	中联重科	47,300	308,869.00	0.13
146	001979	招商蛇口	32,400	308,772.00	0.13
147	600795	国电电力	73,500	305,760.00	0.13
148	600048	保利发展	30,400	300,960.00	0.13
149	600809	山西汾酒	1,300	299,949.00	0.13
150	300999	金龙鱼	8,600	287,068.00	0.12
151	000002	万科A	27,100	283,466.00	0.12

152	601139	深圳燃气	41,000	282,490.00	0.12
153	002252	上海莱士	35,200	281,600.00	0.12
154	600737	中粮糖业	34,000	280,160.00	0.12
155	600150	中国船舶	9,400	276,736.00	0.12
156	600745	闻泰科技	6,500	275,015.00	0.12
157	002500	山西证券	51,000	274,890.00	0.12
158	600989	宝丰能源	18,400	271,768.00	0.12
159	603993	洛阳钼业	52,200	271,440.00	0.12
160	300316	晶盛机电	6,100	268,949.00	0.12
161	002653	海思科	11,500	266,225.00	0.11
162	000895	双汇发展	9,800	261,758.00	0.11
163	600760	中航沈飞	6,060	255,610.80	0.11
164	601077	渝农商行	60,600	247,248.00	0.11
165	000933	神火股份	14,600	245,280.00	0.10
166	600570	恒生电子	8,500	244,460.00	0.10
167	601818	光大银行	82,800	240,120.00	0.10
168	601111	中国国航	32,100	235,614.00	0.10
169	000661	长春高新	1,600	233,280.00	0.10
170	600161	天坛生物	7,500	232,050.00	0.10
171	003816	中国广核	74,300	231,073.00	0.10
172	002028	思源电气	4,400	228,976.00	0.10
173	300285	国瓷材料	9,900	228,888.00	0.10
174	600372	中航机载	17,300	228,014.00	0.10
175	601633	长城汽车	8,900	224,458.00	0.10
176	601877	正泰电器	10,400	223,704.00	0.10
177	600176	中国巨石	22,400	220,192.00	0.09
178	300012	华测检测	15,500	220,100.00	0.09
179	000009	中国宝安	18,700	219,538.00	0.09
180	600879	航天电子	28,300	218,193.00	0.09
181	000786	北新建材	9,300	217,248.00	0.09
182	300682	朗新科技	13,200	216,348.00	0.09
183	601898	中煤能源	22,300	216,087.00	0.09
184	002493	荣盛石化	20,800	215,280.00	0.09
185	600585	海螺水泥	9,500	214,320.00	0.09
186	002129	TCL 中环	13,700	214,268.00	0.09
187	000423	东阿阿胶	4,200	207,144.00	0.09
188	601838	成都银行	18,200	204,932.00	0.09
189	601899	紫金矿业	16,200	201,852.00	0.09
190	600183	生益科技	11,000	201,410.00	0.09
191	600418	江淮汽车	11,600	187,340.00	0.08
192	002532	天山铝业	30,800	185,108.00	0.08
193	600031	三一重工	13,300	183,141.00	0.08
194	600362	江西铜业	10,200	182,172.00	0.08

195	000738	航发控制	9,000	179,100.00	0.08
196	600873	梅花生物	18,700	178,585.00	0.08
197	600511	国药股份	6,200	177,444.00	0.08
198	600927	永安期货	11,200	175,952.00	0.08
199	002027	分众传媒	27,800	175,696.00	0.08
200	600177	雅戈尔	25,700	168,335.00	0.07
201	000728	国元证券	24,600	168,018.00	0.07
202	603659	璞泰来	8,000	167,440.00	0.07
203	600406	国电南瑞	7,400	165,168.00	0.07
204	600066	宇通客车	12,400	164,300.00	0.07
205	600029	南方航空	28,400	163,584.00	0.07
206	002673	西部证券	25,400	161,798.00	0.07
207	002340	格林美	29,554	161,364.84	0.07
208	000581	威孚高科	10,600	159,742.00	0.07
209	601696	中银证券	15,500	159,495.00	0.07
210	002739	万达电影	12,100	157,542.00	0.07
211	000878	云南铜业	14,300	155,727.00	0.07
212	600765	中航重机	8,000	152,880.00	0.07
213	000876	新希望	16,300	151,916.00	0.07
214	002065	东华软件	24,600	151,782.00	0.06
215	000997	新大陆	7,700	150,997.00	0.06
216	600060	海信视像	7,200	150,480.00	0.06
217	600867	通化东宝	13,700	148,371.00	0.06
218	000400	许继电气	6,700	147,132.00	0.06
219	600132	重庆啤酒	2,200	146,190.00	0.06
220	300146	汤臣倍健	8,500	144,755.00	0.06
221	600025	华能水电	16,500	142,395.00	0.06
222	002384	东山精密	7,600	138,168.00	0.06
223	600549	厦门钨业	8,000	137,440.00	0.06
224	300595	欧普康视	6,000	135,480.00	0.06
225	000617	中油资本	24,400	131,760.00	0.06
226	300024	机器人	10,800	128,196.00	0.05
227	002153	石基信息	13,000	126,620.00	0.05
228	000960	锡业股份	8,800	126,016.00	0.05
229	002399	海普瑞	10,700	125,511.00	0.05
230	000039	中集集团	16,200	123,930.00	0.05
231	002439	启明星辰	4,500	121,500.00	0.05
232	002294	信立泰	3,700	120,842.00	0.05
233	300088	长信科技	18,000	120,420.00	0.05
234	603156	养元饮品	5,600	119,056.00	0.05
235	600521	华海药业	8,100	118,827.00	0.05
236	002926	华西证券	15,300	118,728.00	0.05
237	600655	豫园股份	18,200	113,022.00	0.05

238	603233	大参林	4,500	112,050.00	0.05
239	002938	鹏鼎控股	4,900	109,368.00	0.05
240	000547	航天发展	12,900	107,973.00	0.05
241	002595	豪迈科技	3,600	107,172.00	0.05
242	002507	涪陵榨菜	7,440	106,317.60	0.05
243	600219	南山铝业	36,100	106,134.00	0.05
244	002019	亿帆医药	7,000	103,460.00	0.04
245	002179	中航光电	2,600	101,400.00	0.04
246	600704	物产中大	22,800	101,004.00	0.04
247	300498	温氏股份	5,000	100,300.00	0.04
248	002120	韵达股份	13,100	97,726.00	0.04
249	601000	唐山港	26,900	94,150.00	0.04
250	600967	内蒙一机	11,300	93,338.00	0.04
251	000970	中科三环	9,000	93,150.00	0.04
252	600018	上港集团	19,000	93,100.00	0.04
253	002920	德赛西威	700	90,657.00	0.04
254	600926	杭州银行	9,000	90,090.00	0.04
255	600600	青岛啤酒	1,200	89,700.00	0.04
256	300896	爱美客	300	88,299.00	0.04
257	600905	三峡能源	20,100	87,837.00	0.04
258	601966	玲珑轮胎	4,500	86,535.00	0.04
259	300357	我武生物	2,900	84,100.00	0.04
260	600582	天地科技	15,200	82,688.00	0.04
261	601611	中国核建	11,300	78,309.00	0.03
262	600460	士兰微	3,400	77,622.00	0.03
263	600517	国网英大	15,900	75,843.00	0.03
264	600901	江苏金租	15,600	75,504.00	0.03
265	688002	睿创微纳	1,700	75,174.00	0.03
266	688187	时代电气	2,054	74,621.82	0.03
267	600062	华润双鹤	4,000	74,400.00	0.03
268	600167	联美控股	12,900	73,143.00	0.03
269	002142	宁波银行	3,600	72,396.00	0.03
270	601717	郑煤机	5,600	70,840.00	0.03
271	600315	上海家化	3,300	69,894.00	0.03
272	601058	赛轮轮胎	5,600	65,800.00	0.03
273	002916	深南电路	900	63,891.00	0.03
274	600598	北大荒	5,300	63,441.00	0.03
275	688208	道通科技	2,616	62,130.00	0.03
276	300628	亿联网络	2,100	62,055.00	0.03
277	600528	中铁工业	8,200	61,008.00	0.03
278	000733	振华科技	1,000	58,840.00	0.03
279	002223	鱼跃医疗	1,700	58,786.00	0.03
280	601608	中信重工	15,200	58,672.00	0.03

281	601997	贵阳银行	11,300	58,082.00	0.02
282	688006	浙江杭可科技	2,400	56,352.00	0.02
283	002299	圣农发展	3,200	54,976.00	0.02
284	003022	联泓新科	2,900	53,099.00	0.02
285	002508	老板电器	2,400	52,272.00	0.02
286	603866	桃李面包	6,600	50,556.00	0.02
287	300059	东方财富	3,600	50,544.00	0.02
288	600233	圆通速递	4,100	50,389.00	0.02
289	600547	山东黄金	2,200	50,314.00	0.02
290	600566	济川药业	1,600	50,288.00	0.02
291	300244	迪安诊断	2,100	50,001.00	0.02
292	002203	海亮股份	4,400	49,060.00	0.02
293	002273	水晶光电	3,600	48,744.00	0.02
294	603885	吉祥航空	3,700	44,400.00	0.02
295	600350	山东高速	6,300	43,722.00	0.02
296	000563	陕国投 A	13,900	42,256.00	0.02
297	603056	德邦股份	2,900	41,963.00	0.02
298	300373	扬杰科技	1,100	40,370.00	0.02
299	002408	齐翔腾达	7,000	36,960.00	0.02
299	600011	华能国际	4,800	36,960.00	0.02
301	601233	桐昆股份	2,400	36,312.00	0.02
302	688567	孚能科技	2,200	35,882.00	0.02
303	000021	深科技	2,200	35,662.00	0.02
304	300433	蓝思科技	2,700	35,640.00	0.02
305	002557	洽洽食品	1,000	34,820.00	0.01
306	600166	福田汽车	12,700	34,671.00	0.01
307	001203	大中矿业	3,400	34,578.00	0.01
308	600369	西南证券	7,600	31,084.00	0.01
309	002939	长城证券	3,800	30,400.00	0.01
309	600299	安迪苏	3,800	30,400.00	0.01
311	001289	龙源电力	1,500	29,715.00	0.01
312	603369	今世缘	600	29,250.00	0.01
313	600516	方大炭素	5,300	27,772.00	0.01
314	300347	泰格医药	500	27,485.00	0.01
315	000539	粤电力 A	5,600	27,384.00	0.01
316	603218	日月股份	2,200	27,214.00	0.01
317	000958	电投产融	6,700	26,398.00	0.01
318	600398	海澜之家	3,500	25,970.00	0.01
319	600803	新奥股份	1,300	21,866.00	0.01
320	000553	安道麦 A	3,100	21,514.00	0.01
321	002049	紫光国微	300	20,235.00	0.01
322	000825	太钢不锈	5,000	18,650.00	0.01

323	301029	怡合达	700	18,046.00	0.01
324	600377	宁沪高速	1,700	17,425.00	0.01
325	601958	金钼股份	1,800	17,010.00	0.01
325	603858	步长制药	1,000	17,010.00	0.01
327	600115	中国东航	4,200	16,296.00	0.01
328	600271	航天信息	1,500	15,960.00	0.01
329	000930	中粮科技	2,400	15,936.00	0.01
330	600056	中国医药	1,400	15,638.00	0.01
331	603225	新凤鸣	1,100	15,620.00	0.01
332	600438	通威股份	600	15,018.00	0.01
333	600141	兴发集团	800	14,600.00	0.01
334	600535	天士力	700	11,914.00	0.01
335	300383	光环新网	1,200	11,664.00	0.00
336	603355	莱克电气	500	11,150.00	0.00
337	002008	大族激光	500	10,360.00	0.00
338	688248	南方电网 电力科技	400	9,988.00	0.00
339	300037	新宙邦	200	9,460.00	0.00
340	002230	科大讯飞	200	9,276.00	0.00
341	002414	高德红外	1,200	8,760.00	0.00
342	000998	隆平高科	500	7,050.00	0.00
343	000027	深圳能源	2	12.90	0.00

8.3.2 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	603328	依顿电 子	95,546	778,699.90	0.33
2	300543	朗科智 能	71,300	778,596.00	0.33
3	300120	经纬辉 开	106,800	775,368.00	0.33
4	300932	三友联 众	47,100	766,788.00	0.33
5	300447	全信股 份	52,700	764,150.00	0.33
6	300439	美康生 物	65,600	761,616.00	0.33

7	605066	天正电气	82,300	755,514.00	0.32
8	002073	软控股份	114,900	754,893.00	0.32
9	605100	华丰股份	46,900	746,179.00	0.32
10	300632	光莆股份	58,800	742,056.00	0.32
11	002381	双箭股份	97,500	739,050.00	0.32
12	300018	中元股份	120,900	738,699.00	0.32
13	601956	东贝集团	123,700	738,489.00	0.32
14	300673	佩蒂股份	55,100	732,830.00	0.31
15	300800	力合科技	53,600	732,712.00	0.31
16	600835	上海机电	60,600	719,322.00	0.31
17	002730	电光科技	75,500	715,740.00	0.31
18	002130	沃尔核材	93,100	702,905.00	0.30
19	300615	欣天科技	44,200	698,802.00	0.30
20	002367	康力电梯	89,800	675,296.00	0.29
21	300154	瑞凌股份	87,300	646,020.00	0.28
22	300708	聚灿光电	56,400	636,192.00	0.27
23	600480	凌云股份	69,800	635,878.00	0.27
24	603680	今创集团	67,000	633,150.00	0.27
25	600623	华谊集团	95,900	617,596.00	0.26
26	002057	中钢天源	73,900	594,156.00	0.25
27	603339	四方科技	47,600	565,964.00	0.24
28	002249	大洋电机	112,900	561,113.00	0.24

29	688681	科汇电力自动化	34,600	534,570.00	0.23
30	688607	康众数字医疗科技	25,700	523,766.00	0.22
31	003003	天元股份	45,000	517,050.00	0.22
32	002842	翔鹭铝业	58,200	507,504.00	0.22
33	300701	森霸传感	43,900	503,972.00	0.22
34	688227	品高股份	26,400	503,448.00	0.22
35	300424	航新科技	38,300	501,730.00	0.21
36	605155	西大门	32,400	501,552.00	0.21
37	002817	黄山胶囊	57,100	500,196.00	0.21
38	603500	祥和实业	40,800	499,800.00	0.21
39	301182	凯旺科技	21,300	497,994.00	0.21
40	300306	远方信息	41,200	497,696.00	0.21
41	688093	世华科技	27,300	497,133.00	0.21
42	300016	北陆药业	69,300	493,416.00	0.21
43	601018	宁波港	135,800	483,448.00	0.21
44	300177	中海达	67,200	483,168.00	0.21
45	002365	永安药业	49,400	483,132.00	0.21
46	002443	金洲管道	69,200	474,020.00	0.20
47	603331	百达精工	35,000	458,500.00	0.20
48	605058	澳弘电子	19,900	455,909.00	0.20
49	605500	森林包装	53,800	426,634.00	0.18
50	603948	建业股份	17,700	402,498.00	0.17

51	603017	中衡设计	39,500	395,395.00	0.17
52	300743	天地数码	28,100	390,028.00	0.17
53	600059	古越龙山	39,500	367,350.00	0.16
54	300838	浙江力诺	22,200	363,192.00	0.16
55	003012	东鹏控股	42,900	353,925.00	0.15
56	603303	得邦照明	26,400	339,240.00	0.15
57	300246	宝莱特	31,800	327,540.00	0.14
58	300963	中洲特材	23,190	304,252.80	0.13
59	300407	凯发电气	30,300	286,032.00	0.12
60	000589	贵州轮胎	46,400	283,968.00	0.12
61	002815	崇达技术	29,400	281,652.00	0.12
62	300717	华信新材	15,900	266,961.00	0.11
63	300641	正丹股份	45,700	257,748.00	0.11
64	603683	晶华新材	22,700	255,602.00	0.11
65	300243	瑞丰高材	25,500	249,135.00	0.11
66	002863	今飞凯达	39,500	245,295.00	0.10
67	000404	长虹华意	41,100	242,079.00	0.10
68	300349	金卡智能	18,800	233,496.00	0.10
69	605003	众望布艺	11,700	230,958.00	0.10
70	603685	晨丰科技	12,200	186,538.00	0.08
71	002743	富煌钢构	30,900	184,782.00	0.08
72	603798	康普顿	18,600	179,862.00	0.08
73	600746	江苏索	24,300	177,876.00	0.08

		普			
74	002879	长缆科技	10,200	163,404.00	0.07
75	002801	微光股份	7,264	157,992.00	0.07
76	001217	华尔泰	11,100	156,732.00	0.07
77	603990	麦迪科技	11,800	152,456.00	0.07
78	605208	永茂泰	16,000	152,000.00	0.07
79	002763	汇洁股份	16,800	141,288.00	0.06
80	600628	新世界	15,500	108,655.00	0.05
81	000823	超声电子	11,100	106,227.00	0.05
82	002297	博云新材	13,300	106,001.00	0.05
83	002391	长青股份	16,200	102,060.00	0.04
84	600054	黄山旅游	8,300	90,304.00	0.04
85	002674	兴业科技	7,000	85,190.00	0.04
86	603515	欧普照明	4,400	76,472.00	0.03
87	600488	津药药业	12,800	62,720.00	0.03
88	002382	蓝帆医疗	9,300	62,124.00	0.03
89	688655	迅捷兴科技	4,000	60,400.00	0.03
90	605169	洪通燃气	5,200	58,916.00	0.03
91	003018	金富科技	5,300	56,445.00	0.02
92	002706	良信股份	5,900	52,097.00	0.02
93	002909	集泰股份	6,700	51,121.00	0.02
94	300621	维业股份	4,200	48,258.00	0.02
95	002923	润都股份	3,600	44,424.00	0.02
96	603166	福达股	5,500	38,005.00	0.02

		份			
97	002029	七匹狼	6,000	34,380.00	0.01
98	002546	新联电子	6,300	31,500.00	0.01
99	603012	创力集团	5,200	30,732.00	0.01
100	002724	海洋王	3,600	29,592.00	0.01
101	688336	三生国健	800	18,008.00	0.01
102	000990	诚志股份	1,500	12,315.00	0.01
103	603390	通达电气	1,200	12,060.00	0.01
104	600829	人民同泰	1,300	10,166.00	0.00
105	300358	楚天科技	700	7,490.00	0.00
106	603192	汇得科技	200	3,930.00	0.00
107	605005	合兴股份	100	1,754.00	0.00
108	688330	宏力达信息	40	1,136.40	0.00
109	603776	永安行	20	281.60	0.00
110	002116	中国海诚	13	133.77	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	23,175,328.55	9.92
2	601318	中国平安	13,714,494.00	5.87
3	300750	宁德时代	11,990,293.00	5.13
4	000858	五粮液	10,307,235.99	4.41
5	000333	美的集团	9,267,218.20	3.97
6	600036	招商银行	8,874,621.00	3.80
7	002415	海康威视	7,393,574.00	3.16
8	601766	中国中车	7,197,886.80	3.08

9	000063	中兴通讯	6,724,056.00	2.88
10	601688	华泰证券	6,459,059.00	2.76
11	000725	京东方 A	6,450,011.00	2.76
12	688981	中芯国际	6,415,672.69	2.75
13	600837	海通证券	6,329,063.00	2.71
14	600820	隧道股份	6,147,880.00	2.63
15	601899	紫金矿业	6,046,311.00	2.59
16	000878	云南铜业	5,984,269.00	2.56
17	000651	格力电器	5,968,922.00	2.56
18	600028	中国石化	5,957,389.00	2.55
19	601328	交通银行	5,763,265.00	2.47
20	601607	上海医药	5,706,476.00	2.44
21	601166	兴业银行	5,628,774.00	2.41
22	600580	卧龙电驱	5,349,751.75	2.29
23	601012	隆基绿能	5,086,629.00	2.18
24	002594	比亚迪	4,991,461.00	2.14
25	600999	招商证券	4,949,713.00	2.12
26	002129	TCL 中环	4,895,419.75	2.10
27	000559	万向钱潮	4,756,152.60	2.04
28	601088	中国神华	4,749,723.00	2.03

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	13,001,609.20	5.57
2	601318	中国平安	8,581,026.50	3.67
3	300750	宁德时代	7,128,749.80	3.05
4	000858	五粮液	7,059,733.00	3.02
5	601766	中国中车	6,516,811.00	2.79
6	000333	美的集团	6,477,753.00	2.77
7	688981	中芯国际	6,462,615.38	2.77
8	601899	紫金矿业	6,215,659.00	2.66
9	600820	隧道股份	6,103,958.00	2.61
10	601688	华泰证券	5,890,128.00	2.52
11	000063	中兴通讯	5,868,411.14	2.51
12	600837	海通证券	5,820,798.78	2.49
13	000878	云南铜业	5,725,295.00	2.45
14	601012	隆基绿能	4,979,566.04	2.13
15	002415	海康威视	4,630,948.00	1.98

16	002594	比亚迪	4,626,819.00	1.98
17	600036	招商银行	4,408,443.00	1.89
18	601229	上海银行	4,392,814.78	1.88
19	600406	国电南瑞	4,382,669.00	1.88
20	600580	卧龙电驱	4,296,710.00	1.84

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。

8.4.3 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	1,385,439,475.98
卖出股票收入（成交）总额	1,160,966,635.16

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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、交通银行股份有限公司、兴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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	6,364,309.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,364,309.16

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	838	71,679.90	17,206,402.15	28.64	42,861,354.22	71.36

证 800 指数 增强 A						
汇添 富中 证 800 指数 增强 C	3,280	56,100.90	21,315,951.50	11.58	162,695,016.43	88.42
合计	4,118	59,271.18	38,522,353.65	15.78	205,556,370.65	84.22

9.2 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 从业人员持有本 基金	汇添富中证 800 指 数增强 A	621,276.21	1.03
	汇添富中证 800 指 数增强 C	0.00	0.00
	合计	621,276.21	0.25

9.3 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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

§ 10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	34,092,171.90	264,785,800.38
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	56,779,558.64	376,076,492.37
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	60,067,756.37	184,010,967.93

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

本基金托管人的专门基金托管部门有如下重大人事变动：自 2023 年 12 月 28 日起，孙沛涛先生任托管部行政负责人，吴俊文女士不再担任托管部行政负责人。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2023 年 05 月 19 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 50,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	3	1,412,429,837.81	55.47	602,605.35	55.46	
中信证券华南	2	652,861,584.53	25.64	278,755.76	25.65	
海通证券	2	481,114,688.80	18.89	205,227.04	18.89	

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。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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:

本基金本报告期内新增 3 家证券公司的 7 个交易单元:中信证券(北交所单元,深交所单元,上交所单元)、中信证券华南(上交所单元,深交所单元)、海通证券(深交所单元,上交所单元)。

11.8 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	汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金发行文件	公司网站, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 10 日
2	关于汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金线上直销系统认购费率执行标准的公告	公司网站, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 27 日
3	汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	公司网站, 证券日报, 中国证监会基金电子	2023 年 05 月 20 日

		披露网站	
4	汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	公司网站, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 05 日
5	关于汇添富基金管理股份有限公司运用自有资金投资旗下基金的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日
6	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与南京途牛基金销售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	2023 年 09 月 04 日
7	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与凤凰金信(海口)基金销售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	2023 年 09 月 12 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第三季度报告	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 10 月 25 日
9	关于汇添富运用自有资金投资旗下基金的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 09 日
10	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 11 月 17 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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

13.3 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

2024 年 03 月 29 日