

# 汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2023 年第 4 季度报告

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：中信银行股份有限公司

送出日期：2024 年 01 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富中证 1000ETF 联接
基金主代码	017161
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 06 月 19 日
报告期末基金份额总额(份)	62,202,024.12
投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。在正常市场情况下，本基金力争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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误

	差进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；目标 ETF 的投资策略；成份股、备选成份股投资策略；存托凭证的投资策略；债券投资策略；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 1000 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为汇添富中证 1000 ETF 的联接基金，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。本基金通过投资目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 1000ETF 联接 A	汇添富中证 1000ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	017161	017162
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	10,679,646.62	51,522,377.50

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	560110
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 07 月 29 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 08 月 08 日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中信银行股份有限公司

### 2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资投资策略、参与转融

	通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023 年 10 月 01 日 - 2023 年 12 月 31 日)	
	汇添富中证 1000ETF 联接 A	汇添富中证 1000ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	-801,732.94	-1,046,267.48
2. 本期利润	-611,506.63	-1,003,085.35
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0558	-0.0595
4. 期末基金资产净值	9,438,475.98	45,427,350.91
5. 期末基金份额净值	0.8838	0.8817

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

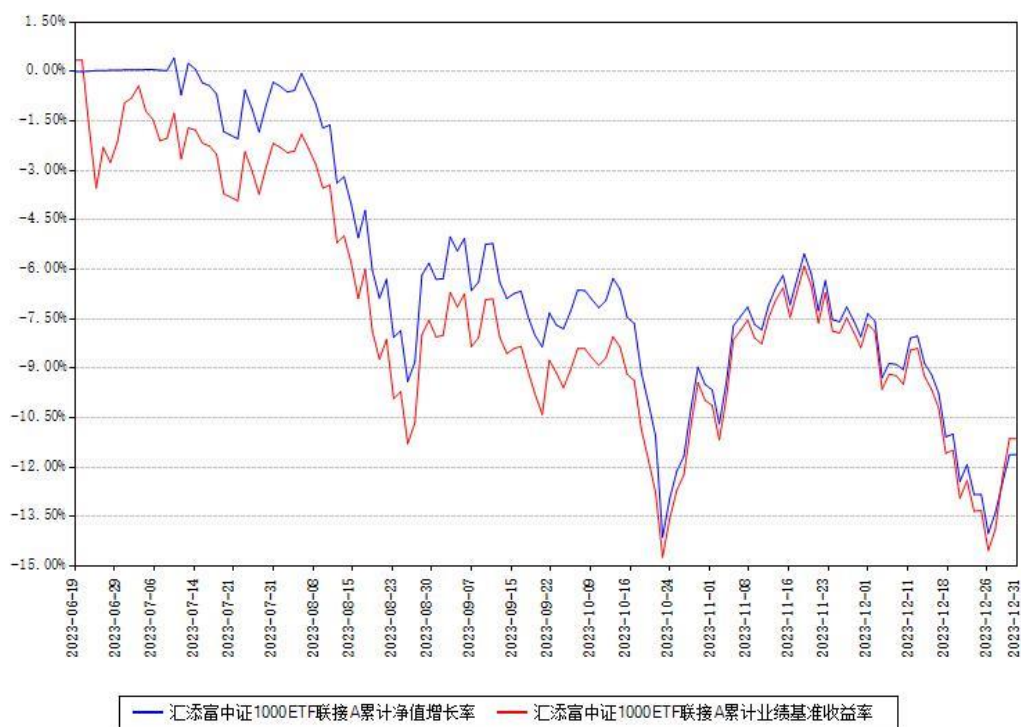
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 1000ETF 联接 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	-5.33%	0.99%	-2.98%	0.98%	-2.35%	0.01%
过去六个月	-11.66%	0.92%	-10.28%	0.95%	-1.38%	-0.03%

自基金合同生效日起至今	-11.62%	0.89%	-11.13%	0.97%	-0.49%	-0.08%
汇添富中证100ETF联接 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	-5.45%	1.00%	-2.98%	0.98%	-2.47%	0.02%
过去六个月	-11.86%	0.92%	-10.28%	0.95%	-1.58%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	-11.83%	0.90%	-11.13%	0.97%	-0.70%	-0.07%

### 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100ETF联接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1000ETF联接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 06 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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穹	本基金的基金经理	2023 年 06 月 19 日	-	9	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月

					<p>15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>券投资基金联接基金的基金经理。2021年9月29日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021年10月26日至2022年10月30日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2021年10月29日至今任汇添富MSCI中国A50互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年12月28日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022年1月11日至2023年11月28日任汇添富MSCI中国A50互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年3月29日至2022年11月21日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年6月13日至2023年9月28日任中证</p>
--	--	--	--	--	--



					<p>长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2022 年 7 月 29 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富恒生指数型证券投资基金（QDII-LOF）的基金经理。2023 年 5 月 24 日至今任汇添富中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 19 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证</p>
--	--	--	--	--	--

					券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 28 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

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

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 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。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用

交易系统中的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 6 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年四季度，市场普遍下跌，成交收缩。结构上看，周期、电子、医药等行业有阶段性表现。

全球来看，美联储在四季度维持联邦基金目标利率不变，货币周期转向信号逐渐得以确认。美元指数四季度显著回落，国内汇率压力有所缓解。10 月起，较高级别的国际交流与互动日益频繁，释放国际关系回暖信号，对市场信心带来提振。

国内来看，前三季度 GDP 累计同比增速 5.2%，全年实现 5% 的目标是大概率事件，经济维持温和复苏节奏，符合市场预期。经济数据分项来看，生产整体强于消费，但消费存在边际改善迹象。11 月工业增加值当月环比改善好于季节性，累计同比增速 4.3%，较 9 月、10 月略有放缓。投资方面，基建依然保持相对高增长，房地产投资继续下滑。消费方面，尽管 11 月社零增速弱于预期，但前三季度居民人均可支配收入同比增加 6.3%，第三季度居民消费倾向已修复至历史平均水平以上。

政策层面看，10 月末召开了中央金融工作会议，12 月召开了中央经济工作会议。中央金融工作会议强调金融服务实体经济的定位，以提供高质量金融服务作为发展导向目标，提出全面加强金融监管防风险。中央经济工作会议提出当前风险隐患仍然较多，2024 年政策主基调需坚持稳中求进、以进促稳、先立后破。会议同时指出，积极的财政政策要适度加力、提质增效，稳健的货币政策要灵活适度、精准有效。

资本市场方面，四季度市场继续走弱，交易情绪较为低迷。当前市场整体位于估值低位，具备长期投资价值。

中证 1000ETF 基金及其联接基金跟踪中证 1000 指数。中证 1000 指数是中证系列宽基指数中的小盘风格代表，权重高度分散，与沪深 300、中证 500 等大中盘宽基之间有着差异化的行业分布特征。当前大中小盘宽基的产品生态逐步完善，中证 1000ETF 基金结合期货、期权等衍生品，能够让投资者构建丰富的策略组合。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 1000ETF 联接 A 类份额净值增长率为-5.33%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%。本报告期汇添富中证 1000ETF 联接 C 类份额净值增长率为-5.45%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2023 年 10 月 10 日起至 2023 年 12 月 27 日，本基金连续 57 个工作日基金资产净值低于五千万元。自 2023 年 12 月 28 日起至报告期末，本基金未再出现基金资产净值预警情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	23,450.00	0.03
	其中：股票	23,450.00	0.03
2	基金投资	50,200,328.00	73.62
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	16,214,167.20	23.78
8	其他资产	1,747,843.64	2.56
9	合计	68,185,788.84	100.00

## 5.2 期末投资目标基金明细

基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	汇添富基金管理股份有限公司	50,200,328.00	91.50

## 5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,689.00	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,761.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,450.00	0.04

### 5.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	603983	丸美股份	700	17,689.00	0.03
2	603565	中谷物流	700	5,761.00	0.01

### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.8 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。

## 5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

## 5.11 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。

## 5.12 投资组合报告附注

### 5.12.1

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

### 5.12.2

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。

### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	21,877.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,725,965.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,747,843.64

#### 5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 1000ETF 联接 A	汇添富中证 1000ETF 联接 C
本报告期期初基金份额总额	13,043,365.65	43,045,365.16
本报告期基金总申购份额	3,857,515.67	47,460,731.19
减：本报告期基金总赎回份额	6,221,234.70	38,983,718.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,679,646.62	51,522,377.50

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序	持	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额



类别	号	有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间					占比 (%)
机构	1	2023 年 12 月 28 日至 2023 年 12 月 31 日	-	23,142,791.02	-	23,142,791.02	37.21
	2	2023 年 12 月 28 日至 2023 年 12 月 31 日	-	15,042,814.16	-	15,042,814.16	24.18

	日					
3	2023年10月1日至2023年10月22日	21,765,153.99	-	21,765,153.99	-	-
4	2023年10月23日至2023年10月26日	5,407,159.08	-	5,407,159.08	-	-
产品特有风险						
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>						

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

2、《汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

3、《汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

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 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金在规定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 9.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2024 年 01 月 22 日