

汇添富上证综合指数证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|--------|------------------|
| 基金简称 | 汇添富上证综合指数 |
| 基金主代码 | 470007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同 | 2009 年 07 月 01 日 |

| | |
|---------------|--|
| 生效日 | |
| 报告期末基金份额总额(份) | 814,170,876.57 |
| 投资目标 | 本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 6%，以实现对基准指数的有效跟踪。 |
| 投资策略 | 本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。本基金的投资策略主要包括：资产配置、抽样股票组合构建、股票组合调整、存托凭证的投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 上证综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。 |
| 基金管 | 汇添富基金管理股份有限公司 |

| | | |
|--------------------|----------------|---------------|
| 理人 | | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富上证综合指数 A | 汇添富上证综合指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 470007 | 018536 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 801,619,777.60 | 12,551,098.97 |

| | | |
|--|--|--|
| | | |
|--|--|--|

§ 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 07 月 01 日 - 2023 年 09 月 30 日) | |
|-----------------|--|---------------|
| | 汇添富上证综合指数 A | 汇添富上证综合指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | 10,794,822.27 | 10,973.59 |
| 2. 本期利润 | 264,349.01 | -117,430.58 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0003 | -0.0153 |
| 4. 期末基金资产净值 | 832,397,722.82 | 13,010,221.23 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.038 | 1.037 |

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

| 汇添富上证综合指数 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 | 0.00% | 0.75% | -2.71% | 0.74% | 2.71% | 0.01% |
| 过去六个月 | -0.29% | 0.76% | -4.69% | 0.74% | 4.40% | 0.02% |
| 过去一年 | 7.04% | 0.81% | 2.76% | 0.78% | 4.28% | 0.03% |
| 过去三年 | 3.76% | 0.90% | -2.98% | 0.89% | 6.74% | 0.01% |
| 过去五年 | 26.68% | 1.03% | 10.20% | 1.04% | 16.48% | -0.01% |
| 自基金合同生效日起至今 | 38.97% | 1.26% | 6.64% | 1.24% | 32.33% | 0.02% |

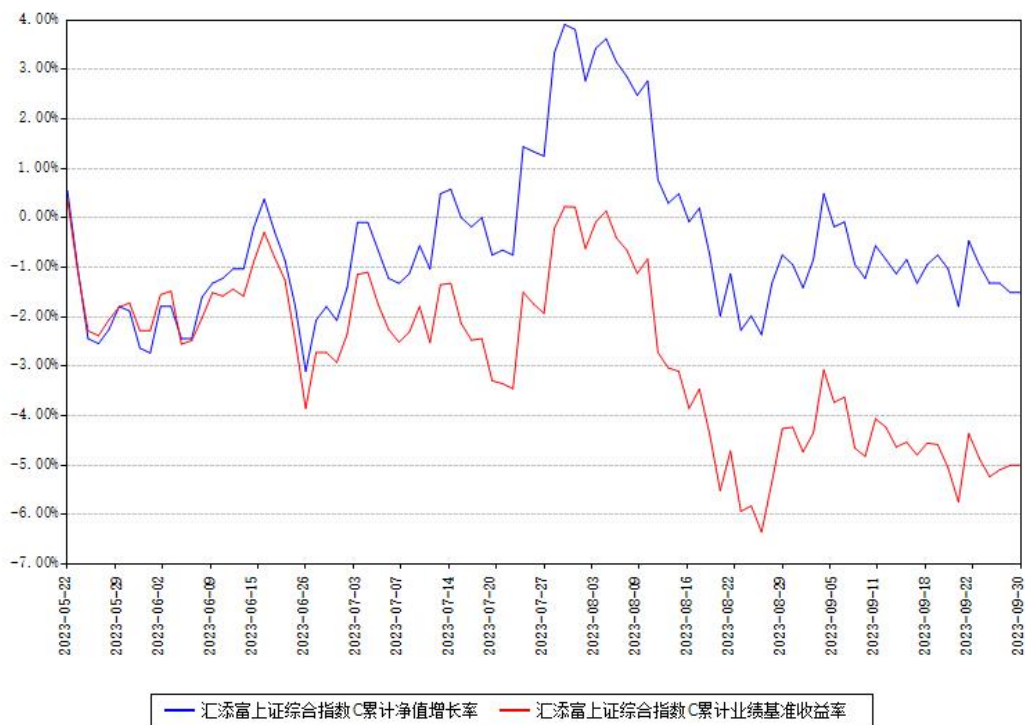
| 汇添富上证综合指数 C | | | | | | |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
| 过去三个月 | -0.10% | 0.75% | -2.71% | 0.74% | 2.61% | 0.01% |
| 自基金合同生效日起至今 | -1.51% | 0.74% | -5.00% | 0.73% | 3.49% | 0.01% |

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

汇添富上证综合指数A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富上证综合指数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（2009年07月01日）起3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金于2023年05月19日新增C类份额，新增份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限（年） | 说明 |
|-----|-----------------------|-------------|------|-----------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴振翔 | 本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监 | 2010年02月06日 | - | 17 | 国籍：中国。 学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。</p> <p>2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。</p> <p>2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>投资基金的基金经理。</p> <p>2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 16 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。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6</p> |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>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</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>金经理。</p> <p>2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互</p> |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 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联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数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 6 月 6 日至今任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年</p> |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 9 月 1 日至 今任汇添富 稳健回报债 券型证券投 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遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律
法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金
资产,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,确保公平交易制度
的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公
司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

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

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

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场

成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 14 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在三季度，国内经济继续展现复苏势头，特别值得注意的是，虽然 7 月份的经济数据整体呈现疲软，但 8 月份出现了内生性修复迹象，且表现普遍好于市场预期。期间政府出台了多项经济刺激政策，覆盖了民营经济和资本市场等多个领域，政治局会议继续强调了稳增长的基调，而这些政策对经济产生的影响在三季度尚未充分体现，后续经济有望持续修复。在货币政策方面，8 月份 MLF 利率下调了 0.15 个百分点，一年期 LPR 也下调了 0.10 个百分点，9 月份金融机构存款准备金率下调了 0.25 个百分点，市场流动性整体保持了合理充裕。

此外，三季度的全球经济格局也对市场产生了影响。通胀普遍有所回落，美元指数在 7 月下旬开始表现强势。从国际合作角度看，中美之间在 8 月成立了贸易工作组，随后在 9 月底宣布成立了经济和金融两个工作组，这有助于逐步建立细分领域的对话机制，预计未来在多个领域的沟通交流有望得到进一步改善。

尽管整个三季度 A 股市场总体呈现出调整的态势，但风格上的分化明显。上半年表现较好的小盘股和成长板块出现了回落，而价值和红利股表现相对较好。在行业主题方面，能源和金融等顺周期板块涨幅领先，而医药、科技和新能源等板块则持续调整。展望未来，随着宏观经济预期的逐渐改善，且整体市场估值仍然相对较低，A 股市场当前的投资价值比较显著。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富上证综合指数 A 类份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为-2.71%。本报告期汇添富上证综合指数 C 类份额净值增长率为-0.10%，同期业绩比较基准收益率为-2.71%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 789,051,131.69 | 93.17 |
| | 其中：股票 | 789,051,131.69 | 93.17 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 6,083,887.78 | 0.72 |
| | 其中：债券 | 6,083,887.78 | 0.72 |
| | 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 | 50,556,884.47 | 5.97 |
| 8 | 其他资产 | 1,170,569.30 | 0.14 |
| 9 | 合计 | 846,862,473.24 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,439,609.79 | 0.17 |
| B | 采矿业 | 81,661,252.45 | 9.66 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业 | 322,162,482.79 | 38.11 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 32,684,043.13 | 3.87 |
| E | 建筑业 | 24,703,085.43 | 2.92 |
| F | 批发和零售业 | 12,691,960.16 | 1.50 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 34,464,612.13 | 4.08 |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,056,388.00 | 0.12 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 23,963,578.21 | 2.83 |
| J | 金融业 | 207,624,634.04 | 24.56 |
| K | 房地产业 | 13,958,707.21 | 1.65 |
| L | 租赁和商务服务业 | 6,268,028.77 | 0.74 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 8,116,456.06 | 0.96 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,180,347.76 | 0.49 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 2,823,704.00 | 0.33 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,183,792.28 | 0.61 |
| S | 综合 | 741,369.28 | 0.09 |
| | 合计 | 783,724,051.49 | 92.70 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 4,875,660.27 | 0.58 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|--------------|------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 299,864.34 | 0.04 |
| 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 | 151,555.59 | 0.02 |
| 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 | 5,327,080.20 | 0.63 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 （元） | 占基金资产 净值比例 （%） |
|----|--------|------|-----------|-------------------|----------------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 31,062 | 55,866,560. 10 | 6.61 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 9,685,473 | 34,867,702. 80 | 4.12 |
| 3 | 601988 | 中国银行 | 7,512,611 | 28,322,543. 47 | 3.35 |
| 4 | 601857 | 中国石油 | 3,545,657 | 28,294,342. | 3.35 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| | | | | 86 | |
| 5 | 601628 | 中国人寿 | 425,271 | 15,420,326.46 | 1.82 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 466,815 | 15,390,890.55 | 1.82 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 251,523 | 12,148,560.90 | 1.44 |
| 8 | 600028 | 中国石化 | 1,936,377 | 11,753,808.39 | 1.39 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 335,915 | 10,480,548.00 | 1.24 |
| 10 | 600900 | 长江电力 | 461,711 | 10,268,452.64 | 1.21 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------|------------|--------------|
| 1 | 688361 | 中科飞测 | 6,642 | 527,630.95 | 0.06 |
| 2 | 688443 | 智翔金泰 | 14,124 | 433,083.15 | 0.05 |
| 3 | 688549 | 中巨芯科技 | 42,933 | 410,223.31 | 0.05 |
| 4 | 688472 | 阿特斯阳光电力 | 27,613 | 390,918.38 | 0.05 |
| 5 | 688563 | 航空材料股份 | 5,873 | 361,286.87 | 0.04 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

| | | | |
|----|-----------|--------------|------|
| 1 | 国家债券 | 6,083,887.78 | 0.72 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 地方政府债 | - | - |
| 10 | 其他 | - | - |
| 11 | 合计 | 6,083,887.78 | 0.72 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 （元） | 占基金资产 净值比例 （%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|----------------------|
| 1 | 019694 | 23 国债 01 | 52,000 | 5,271,566.25 | 0.62 |
| 2 | 019688 | 22 国债 23 | 8,000 | 812,321.53 | 0.10 |

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 17,020.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,153,548.35 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,170,569.30 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|------|------|----------------|--------------|----------|
|----|------|------|----------------|--------------|----------|

| | | | | | |
|---|--------|---------|-----------|------|--------|
| 1 | 688361 | 中科飞测 | 50,666.35 | 0.01 | 新股流通受限 |
| 2 | 688443 | 智翔金泰 | 41,075.91 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 3 | 688472 | 阿特斯阳光电力 | 38,134.40 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 4 | 688563 | 航空材料股份 | 34,303.92 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 5 | 688549 | 中巨芯科技 | 32,720.28 | 0.00 | 新股流通受限 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 汇添富上证综合指数 A | 汇添富上证综合指数 C |
|---------------|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 769,392,972.89 | 1,450,366.15 |
| 本报告期基金总申购份额 | 100,596,228.74 | 29,629,255.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 68,369,424.03 | 18,528,522.18 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 801,619,777.60 | 12,551,098.97 |

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未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无

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

9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号

汇添富基金管理股份有限公司

9.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 10 月 25 日