

# 中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安银行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 01 月 01 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 .....	5
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 .....	9
§ 4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	21
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 .....	22
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	23
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	24
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	25
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	25
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 .....	25
§ 5 托管人报告 .....	25
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	26
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 .....	26
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 .....	26
§ 6 审计报告 .....	26
6.1 审计报告的基本信息 .....	26
6.2 审计报告的基本内容 .....	26
§ 7 年度财务报表 .....	28
7.1 资产负债表 .....	28
7.2 利润表 .....	29
7.3 净资产变动表 .....	30
7.4 报表附注 .....	32
§ 8 投资组合报告 .....	126
8.1 期末基金资产组合情况 .....	126
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	127
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 .....	128

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	163
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	165
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.....	165
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.....	165
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.....	165
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.....	165
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	166
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	166
8.12 投资组合报告附注.....	166
§ 9 基金份额持有人信息.....	167
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	167
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	168
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	169
9.4 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.....	169
9.5 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.....	169
§ 10 开放式基金份额变动.....	169
§ 11 重大事件揭示.....	169
11.1 基金份额持有人大会决议.....	169
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.....	170
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	170
11.4 基金投资策略的改变.....	170
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	170
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.....	170
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	170
11.8 其他重大事件.....	173
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	175
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.....	175
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	175
§ 13 备查文件目录.....	175
13.1 备查文件目录.....	176
13.2 存放地点.....	176
13.3 查阅方式.....	176

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 08 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	8,166,937,198.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 16 日

注：扩位证券简称：800ETF。

### 2.2 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，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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		平安银行股份有限公司
信息披露	姓名	李鹏	潘琦
负责人	联系电话	021-28932888	0755-22168257

电子邮箱	service@99fund.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话	400-888-9918	95511-3
传真	021-28932998	0755-82080387
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	200010	518001
法定代表人	李文	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 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	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-250,957,513.39	-18,812,314.48	239,618,415.23
本期利润	-696,623,165.87	-423,151,107.97	54,953,581.80
加权平均基金份额本期利润	-0.1733	-0.2531	0.0341
本期加权平均净值利润率	-17.57%	-22.33%	2.59%
本期基金份额净值增长率	-8.25%	-19.33%	2.04%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-975,820,862.70	129,057,039.83	526,489,465.14
期末可供分配基金份额利润	-0.1195	0.0739	0.3312
期末基金资产净值	7,191,116,335.30	1,874,494,237.83	2,115,926,663.14
期末基金份额净值	0.8805	1.0739	1.3312
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-1.47%	7.39%	33.12%

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

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.28%	0.78%	-6.38%	0.78%	0.10%	0.00%
过去六个月	-9.52%	0.83%	-10.39%	0.83%	0.87%	0.00%
过去一年	-8.25%	0.81%	-10.37%	0.82%	2.12%	-0.01%

过去三年	-24.48%	1.06%	-30.01%	1.07%	5.53%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-1.47%	1.15%	-5.61%	1.16%	4.14%	-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

添富中证800ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



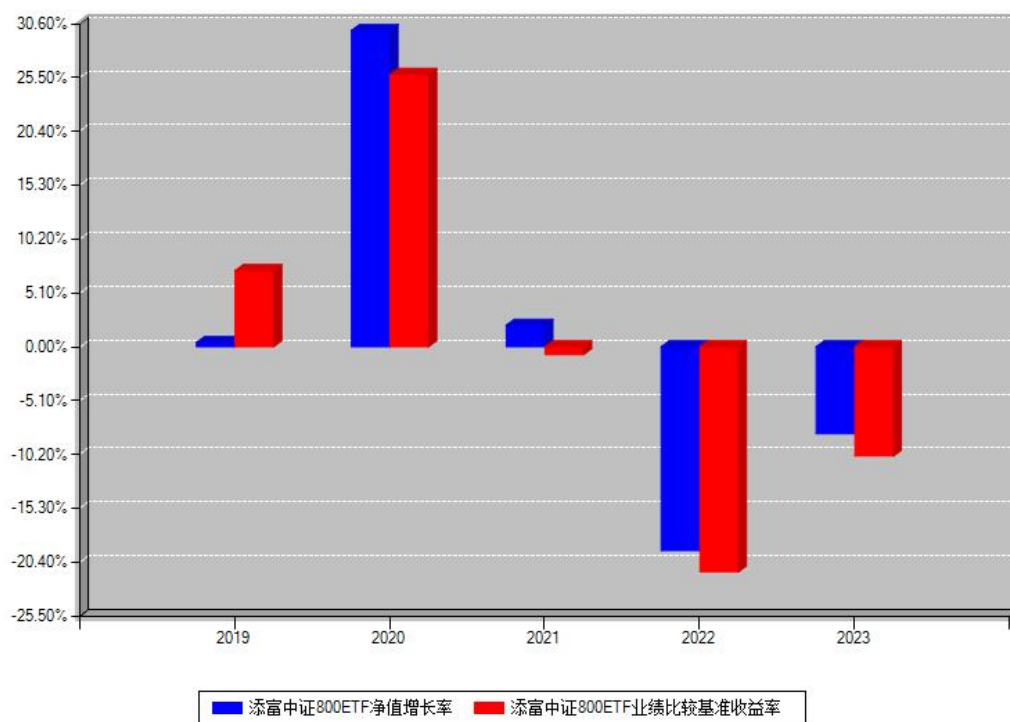
注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019年10月08日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

### 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



添富中证800ETF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 2019 年 10 月 08 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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	1.1200	929,368,966.13	0.00	929,368,966.13	-
2022 年	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
2021 年	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
合计	1.1200	929,368,966.13	0.00	929,368,966.13	-

## § 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战略合作。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，旨在为广大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、宁夏涇源、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）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穹	本基金的基金经理	2019 年 10 月 08 日	-	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分析师。

				<p>2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。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。</p> <p>2021 年 9 月 29</p>
--	--	--	--	--

				<p>日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	--	--	--	---

				<p>投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</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</p>
--	--	--	--	---

					<p>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。</p>
过蓓蓓	<p>本基金的基金经理,指数与量化投资部副总监</p>	<p>2019年10月08日</p>	-	12	<p>国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015年6月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2015年8月3日至今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</p>



				<p>金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 13 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 6 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 3 日至今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。</p> <p>2015 年 8 月 3 日至今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>2015 年 8 月 18 日至 2023 年 8 月 29 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 18 日至 2023 年 5 月 22 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 12 月 29 日至</p>
--	--	--	--	---

				<p>2022 年 12 月 1 日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 10 月 23 日至 2023 年 5 月 22 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新</p>
--	--	--	--	--

				<p>能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年9月29日至2023年5月18日任汇添富中证800交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年2月28日至2022年10月31日任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年8月15日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022年9月26日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年10月20日至今任汇添富中证100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年12月2日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。2023年3月14日至今任</p>
--	--	--	--	---

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

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、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

2023 年，资本市场先在经济复苏背景下显现出修复行情，但自二季度起开始震荡下行，四季度呈现成交收缩、情绪持续低迷的态势。一季度受人工智能革命驱动的计算机、电子、通信等板块显著超越其他，但下半年基本面验证较为有限，进入消化估值的阶段。市场下行明显的三四季度，具备红利属性的资产受到市场关注，同时成长板块中的电子、医药有阶段性修复。结构上看，全年行业分化依然显著，且行业主题行情通常缺乏持续性。

全球来看，美联储在 2 月、3 月、5 月、7 月各加息 25 个基点，加息周期接近尾声的认知随着通胀数据不断回落得以逐步确认。美元指数在四季度显著回落，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，2023 年全年 GDP 增长 5.2%，分季度呈波动态势。一季度存在积压需求释放的反弹，经济数据表现较为强劲。二季度经济数据为全年低点，且低于预期，6 月起略有改善，体现出底部修复的态势。逆周期调节的政策基调下，政策力度和政策传导速度均略有不达预期。三季度起，主要经济数据出现好转，内生修复的势头开始显现。多项经济刺激政策出台，覆盖民营经济、资本市场等多个层面，央行连续降息呵护流动性，政治局会议继续强调稳增长基调。四季度需求边际变弱，经济内生动能放缓。

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，截至年末市场已经位于估值低位，具备长期投资价值。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-8.25%。同期业绩比较基准收益率为-10.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年全球多国将迎来领导人选举，外部局势或将频繁变化。全球经济面临复杂的发展环境，风险与机遇并存。

国内来看，2024 年经济有望筑底企稳、温和修复。经济结构性转型需要经历新旧动能切换，带来阶段性阵痛。同时，前几年的外部冲击背景下，居民就业及收入预期改善需要时间。政策基调在最近一次中央经济工作会议上明确为偏积极，有望促进市场信心稳定，加快转型出清。

资本市场目前面临对经济信心不足、财富效应收缩的问题。在经济修复出现实质性改善之前，交易情绪难以显著回暖。对长期配置来说，当前估值具备吸引力，但仍需关注阶段性震荡波动的风险。

#### 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：本基金的收益分配采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本报告期内，本基金于 2023 年 09 月 20 日实施利润分配，每 10 份基金份额派发红利 1.1200 元人民币。

#### 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

#### 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，本托管人复核的财务指标、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_B131 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	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中证 800 交易型开放式指数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 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的中证 800 交易型开放式指数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，公允反映了中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	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

	<p>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，我们独立于中证 800 交易型开放式指数证券投资基金，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>中证 800 交易型开放式指数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，管理层负责评估中证 800 交易型开放式指数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、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中证 800 交易型开放式指数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</p>

	<p>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，就可能导致对中证 800 交易型开放式指数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中证 800 交易型开放式指数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	许培菁   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：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	31,664,606.54	48,997,016.89
结算备付金		20,496,024.86	12,872,963.06
存出保证金		11,218,473.50	6,905,655.01
交易性金融资产	7.4.7.2	7,092,656,805.20	1,806,097,361.02
其中：股票投资		7,092,532,901.40	1,806,097,361.02
基金投资		-	-
债券投资		123,903.80	-
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	-6,390.42	-
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		57,357,928.62	15,120,161.65
应收股利		19,940.00	10,409.12
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	136,954.82	33,615.61
资产总计		7,213,544,343.12	1,890,037,182.36
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		19,898,301.48	14,783,502.54
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		946,482.10	240,190.34
应付托管费		315,494.03	80,063.42
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14,095.58	4,092.81
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	1,253,634.63	435,095.42
负债合计		22,428,007.82	15,542,944.53
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	8,166,937,198.00	1,745,437,198.00
未分配利润	7.4.7.9	-975,820,862.70	129,057,039.83
净资产合计		7,191,116,335.30	1,874,494,237.83
负债和净资产总计		7,213,544,343.12	1,890,037,182.36

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8805 元，基金份额总额

8,166,937,198.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日

		日	日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-687,327,550.17</b>	<b>-418,574,857.45</b>
1. 利息收入		3,423,243.52	2,743,740.68
其中：存款利息收入	7.4.7.10	530,394.70	602,409.21
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		19,171.23	-
其他利息收入		2,873,677.59	2,141,331.47
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-248,887,897.64	-17,180,872.82
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-293,720,990.96	-39,998,174.37
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	181,581.24	941,432.65
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	-12,402,435.17	-16,777,219.69
股利收益	7.4.7.17	57,053,947.25	38,653,088.59
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	-445,665,652.48	-404,338,793.49
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	3,802,756.43	201,068.18
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>9,295,615.70</b>	<b>4,576,250.52</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,925,364.65	2,842,512.68
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,975,121.57	947,504.21
3. 销售服务费		-	-
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		19,473.23	7,712.56
8. 其他费用	7.4.7.21	1,375,656.25	778,521.07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-696,623,165.87</b>	<b>-423,151,107.97</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-696,623,165.87</b>	<b>-423,151,107.97</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-696,623,165.87</b>	<b>-423,151,107.97</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 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	1,745,437,198.00	129,057,039.83	1,874,494,237.83
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,745,437,198.00	129,057,039.83	1,874,494,237.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,421,500,000.00	-1,104,877,902.53	5,316,622,097.47
（一）、综合收益总额	-	-696,623,165.87	-696,623,165.87
（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）	6,421,500,000.00	521,114,229.47	6,942,614,229.47
其中：1. 基金申购款	8,639,750,000.00	323,099,324.43	8,962,849,324.43
2. 基金赎回款	-2,218,250,000.00	198,014,905.04	-2,020,235,094.96
（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）	-	-929,368,966.13	-929,368,966.13
四、本期期末净资产	8,166,937,198.00	-975,820,862.70	7,191,116,335.30
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	1,589,437,198.00	526,489,465.14	2,115,926,663.14
加：会计政策变更	-	-	-

二、本期期初净资产	1,589,437,198.00	526,489,465.14	2,115,926,663.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	156,000,000.00	-397,432,425.31	-241,432,425.31
（一）、综合收益总额	-	-423,151,107.97	-423,151,107.97
（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）	156,000,000.00	25,718,682.66	181,718,682.66
其中：1. 基金申购款	420,000,000.00	56,237,922.61	476,237,922.61
2. 基金赎回款	-264,000,000.00	-30,519,239.95	-294,519,239.95
（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	1,745,437,198.00	129,057,039.83	1,874,494,237.83

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

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（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[2019]162 号文《关于准予中证 800 交易型开放式指数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 2019 年 10 月 8 日生效。首次设立基金募集规模为 6,601,437,198.00 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（2019）验字第 60466941\_A04 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限



不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）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的相关规定）。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率。

#### 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 01 月 01 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。

#### 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和托管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、每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金的收益分配采用现金分红；

3、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

4、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

5、法律法规或监管机关另有规定的，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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	31,664,606.54	48,997,016.89
等于：本金	31,657,593.50	48,991,784.18
加：应计利息	7,013.04	5,232.71
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	31,664,606.54	48,997,016.89

##### 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	7,744,730,226.03	-	7,092,532,901.40	652,197,324.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3.80	123,903.80	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	123,900.00	3.80	123,903.80
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,744,854,126.03	3.80	7,092,656,805.20	652,197,324.63
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,010,921,313.17	-	1,806,097,361.02	204,823,952.15
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	2,010,921,313.17	-	1,806,097,361.02	204,823,952.15

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
----	----------------------

	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	68,375,360.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	68,375,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	68,375,360.00	-	-	-
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	56,991,300.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	56,991,300.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	56,991,300.00	-	-	-

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2401	IC2401	17	18,485,120.00	-7,680.00
IF2401	IF2401	49	50,565,060.00	682,500.00
合计				674,820.00
减：可抵销期货暂收款				674,820.00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

## 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-6,390.42	-
银行间市场	-	-
合计	-6,390.42	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	136,954.82	33,615.61
待摊费用	-	-
合计	136,954.82	33,615.61

#### 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	上年度末 2022 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	487,135.72	84,821.78
其中：交易所市场	487,135.72	84,821.78
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	70,000.00	90,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	576,498.91	140,273.64
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	1,253,634.63	435,095.42

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,745,437,198.00	1,745,437,198.00

本期申购	8,639,750,000.00	8,639,750,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,218,250,000.00	-2,218,250,000.00
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	8,166,937,198.00	8,166,937,198.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	594,577,074.49	-465,520,034.66	129,057,039.83
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	594,577,074.49	-465,520,034.66	129,057,039.83
本期利润	-250,957,513.39	-445,665,652.48	-696,623,165.87
本期基金份额交易产生的变动数	2,211,240,794.30	-1,690,126,564.83	521,114,229.47
其中：基金申购款	2,709,644,300.19	-2,386,544,975.76	323,099,324.43
基金赎回款	-498,403,505.89	696,418,410.93	198,014,905.04
本期已分配利润	-929,368,966.13	-	-929,368,966.13
本期末	1,625,491,389.27	-2,601,312,251.97	-975,820,862.70

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
活期存款利息收入	215,299.15	212,430.34
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	299,012.58	387,466.67
其他	16,082.97	2,512.20
合计	530,394.70	602,409.21

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 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-212,133,729.22	-31,568,672.69
股票投资收益——赎回差价收入	-81,587,261.74	-8,429,501.68
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-293,720,990.96	-39,998,174.37

## 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,684,617,432.83	431,397,098.58
减：卖出股票成本总额	2,891,310,703.18	461,834,234.05
减：交易费用	5,440,458.87	1,131,537.22
买卖股票差价收入	-212,133,729.22	-31,568,672.69

## 7.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	2,020,235,094.96	294,519,239.95
减：现金支付赎回款总额	842,551,980.96	128,572,822.95
减：赎回股票成本总额	1,259,270,375.74	174,375,918.68
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-81,587,261.74	-8,429,501.68

## 7.4.7.11.4 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比区间均无证券出借差价收入。

## 7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

## 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

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	173.99	657.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	181,407.25	940,775.41
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	181,581.24	941,432.65

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,100,526.74	6,367,372.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	918,900.00	5,425,800.00
减：应计利息总额	175.44	719.96
减：交易费用	44.05	77.35
买卖债券差价收入	181,407.25	940,775.41

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均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：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均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

单位：人民币元



项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-	-
外汇远期投资收益	-	-
股指期货投资收益	-12,402,435.17	-16,777,219.69
外汇期货投资收益	-	-

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	57,053,947.25	38,653,088.59
其中：证券出借权益补偿收入	1,073,787.77	2,210,903.69
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	57,053,947.25	38,653,088.59

#### 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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-447,373,372.48	-404,173,313.49
——股票投资	-447,373,372.48	-404,173,313.49
——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	1,707,720.00	-165,480.00
——权证投资	-	-
——期货投资	1,707,720.00	-165,480.00
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	-445,665,652.48	-404,338,793.49

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月
----	-------------------------------------	--

	31 日	31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	3,802,756.43	201,068.18
其他	-	-
合计	3,802,756.43	201,068.18

#### 7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	-	-
指数使用费	1,185,072.95	568,502.59
持有人大会- 公证费	-	-
持有人大会- 律师费	-	-
开户费	-	-
上市费	-	-
或有管理费	-	-
其他	583.30	18.48
合计	1,375,656.25	778,521.07

#### 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
平安银行股份有限公司 (“平安银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东

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
汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	2,006,059,466.38	27.30	218,866,676.44	22.59

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	866,020.78	78.69	1,469,970.11	23.09

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 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 01 月 01 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 (%)
东方证券	1,474,877.63	43.43	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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 (%)
东方证券	157,724.18	30.60	2,608.27	3.08

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,925,364.65	2,842,512.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,879.98	-
应支付基金管理人的净管理费	5,918,484.67	2,842,512.68

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送

基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,975,121.57	947,504.21

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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

单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

东方证券	38,945,545.00	27,412.31	-	-
------	---------------	-----------	---	---

#### 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

单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	57,634,573.00	1.00~3.50	1.97	46,312.46	2,951,202.00	1,404.15
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	21,722,394.00	3.40~3.70	3.46	29,460.22	-	-

#### 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及上年度可比期间均未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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	15,420,310.00	0.19	4,421,869.00	0.25

汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	84,814,400.00	1.04	48,610,000.00	2.78
------------------------------	---------------	------	---------------	------

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	31,664,606.54	215,299.15	48,997,016.89	212,430.34

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
				-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	600958	东方证券	原股东优先配售	79,744.00	674,634.24

#### 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

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理

人的股东东方证券发行的股票东方证券，和基金托管人平安银行发行的股票平安银行。于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 1,571,544.00 股，持有平安银行 2,907,867.00 股。（于上年度末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 375,544.00 股，持有平安银行 696,867.00 股。）

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 09 月 20 日	2023 年 09 月 21 日		1.1200	929,368,966.13	-	929,368,966.13	
合计	-	-		1.1200	929,368,966.13	-	929,368,966.13	

注：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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代	证	成功	受	流	认购价	期末估	数量	期末成本总	期末估值总	备



码	券名称	认购日	限期	通受限类型	格	值单价	(单位:张)	额	额	注
127102	浙建转债	2023年12月25日	15个交易日	新债流通受限	100.00	100.00	1,239	123,900.00	123,903.80	

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年08月30日	重大事项停牌	0.01		-	371,600	952,476.03	3,716.00	

注：截止 2023 年 12 月 31 日，本基金合计持有中天 3（在深圳证券交易所退市时的股票简称为\*ST 中天，证券代码为 000540）371,600 股。根据中天金融集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 6 月 29 日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市暨摘牌的公告》，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。

于 2023 年 6 月 17 日起，为维护基金持有人利益，根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定，依据中天金融集团股份有限公司公开披露的信息，汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人协商一致，将本基金所持有\*ST 中天（000540.SZ）按每股 0.01 元人民币估值。

根据公司于 2023 年 8 月 28 日发布的《中天金融集团股份有限公司股票转让公告》，公司可

在全国中小企业股份转让系统有限责任公司依托原证券公司代办股份转让系统设立并代为管理的两网公司及退市公司板块（以下简称“退市板块”）转让仅限于原在深圳证券交易所（以下简称“深交所”）挂牌交易的流通股份，确权代码（即挂牌退市板块后的股票代码）：400174，开始转让日为 2023 年 8 月 30 日。根据公司于同日发布的《中天金融集团股份有限公司关于公司股票挂牌当日即暂停转让的公告》，因公司正在进行重整事项，经向全国股转公司申请，公司股票自 2023 年 8 月 30 日起暂停转让。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日		期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额
1	000002	万科 A	2024 年 01 月 02 日	2024 年 01 月 08 日	10.46	395,100	4,132,746.00
2	000625	长安汽车	2024 年 01 月 02 日	2024 年 01 月 10 日	16.83	236,600	3,981,978.00
3	002230	科大讯飞	2024 年 01 月 02 日	2024 年 01 月 08 日	46.38	77,000	3,571,260.00
4	688271	联影医疗	2024 年 01 月 08 日	2024 年 01 月 08 日	137.01	23,000	3,151,230.00
5	688041	海光信息	2024 年 01 月 08 日	2024 年 01 月 10 日	70.98	41,000	2,910,180.00

			日	日				
6	688012	中微 半导 体设 备	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	153.60	18,000	2,764,800.00
7	601006	大秦 铁路	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	7.21	353,900	2,551,619.00
8	300308	中际 旭创	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	112.91	21,000	2,371,110.00
9	600048	保利 发展	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	9.90	229,400	2,271,060.00
10	002920	德赛 西威	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	129.51	15,900	2,059,209.00
11	600111	北方 稀土	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	19.34	103,800	2,007,492.00
12	600674	川投 能源	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	15.12	128,000	1,935,360.00
13	600010	包钢 股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	1.46	1,320,200	1,927,492.00
14	601600	中国 铝业	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	5.64	337,300	1,902,372.00
15	000977	浪潮 信息	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	33.20	55,200	1,832,640.00
16	601360	三六 零	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	9.01	193,500	1,743,435.00

			日	日				
17	300418	昆仑 万维	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	37.40	44,400	1,660,560.00
18	600157	永泰 能源	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	1.37	1,205,000	1,650,850.00
19	600418	江淮 汽车	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	16.15	100,500	1,623,075.00
20	000988	华工 科技	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	29.76	54,100	1,610,016.00
21	000538	云南 白药	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	49.15	32,600	1,602,290.00
22	000975	银泰 黄金	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	15.00	105,000	1,575,000.00
23	002555	三七 互娱	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	18.81	83,100	1,563,111.00
24	601058	赛轮 轮胎	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	11.75	131,600	1,546,300.00
25	601633	长城 汽车	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	25.22	60,700	1,530,854.00
26	301236	软通 动力	2024 年 01 月 08 日	-	2024 年 01 月 10 日	46.20	33,000	1,524,600.00
27	688036	传音 控股	2024 年 01 月 02	-	2024 年 01 月 02	138.40	11,000	1,522,400.00

			日	日				
28	300661	圣邦股份	2024年01月02日	-	2024年01月02日	89.01	16,900	1,504,269.00
29	688256	寒武纪科技	2024年01月02日	-	2024年01月10日	134.96	11,000	1,484,560.00
30	601868	中国能建	2024年01月03日	-	2024年01月10日	2.10	702,600	1,475,460.00
31	600515	海南机场	2024年01月02日	-	2024年01月08日	3.70	396,200	1,465,940.00
32	300896	爱美客	2024年01月10日	-	2024年01月10日	294.33	4,900	1,442,217.00
33	002812	恩捷股份	2024年01月02日	-	2024年01月08日	56.82	25,200	1,431,864.00
34	002271	东方雨虹	2024年01月02日	-	2024年01月10日	19.20	72,200	1,386,240.00
35	300502	新易盛	2024年01月08日	-	2024年01月08日	49.32	28,000	1,380,960.00
36	002460	赣锋锂业	2024年01月02日	-	2024年01月10日	42.80	31,700	1,356,760.00
37	600585	海螺水泥	2024年01月02日	-	2024年01月03日	22.56	59,200	1,335,552.00
38	000063	中兴通讯	2024年01月02日	-	2024年01月02日	26.48	49,000	1,297,520.00

			日	日				
39	601138	工业富联	2024年01月02日	-	2024年01月08日	15.12	85,500	1,292,760.00
40	002517	恺英网络	2024年01月08日	-	2024年01月10日	11.17	115,600	1,291,252.00
41	001979	招商蛇口	2024年01月02日	-	2024年01月10日	9.53	135,000	1,286,550.00
42	601168	西部矿业	2024年01月02日	-	2024年01月10日	14.27	88,700	1,265,749.00
43	000786	北新建材	2024年01月02日	-	2024年01月10日	23.36	54,000	1,261,440.00
44	600183	生益科技	2024年01月02日	-	2024年01月10日	18.31	68,000	1,245,080.00
45	603392	万泰生物	2024年01月03日	-	2024年01月10日	75.13	15,800	1,187,054.00
46	603596	伯特利	2024年01月02日	-	2024年01月10日	69.30	17,100	1,185,030.00
47	600536	中国软件	2024年01月02日	-	2024年01月10日	36.26	32,500	1,178,450.00
48	002463	沪电股份	2024年01月02日	-	2024年01月10日	22.12	53,000	1,172,360.00
49	600415	小商品城	2024年01月02日	-	2024年01月08日	7.32	154,900	1,133,868.00

			日	日				
50	300136	信维通信	2024年01月02日	-	2024年01月10日	23.60	48,000	1,132,800.00
51	000066	中国长城	2024年01月02日	-	2024年01月08日	10.12	111,000	1,123,320.00
52	300474	景嘉微	2024年01月02日	-	2024年01月08日	70.71	15,800	1,117,218.00
53	000301	东方盛虹	2024年01月02日	-	2024年01月02日	9.60	114,600	1,100,160.00
54	300394	天孚通信	2024年01月08日	-	2024年01月10日	91.52	12,000	1,098,240.00
55	601238	广汽集团	2024年01月02日	-	2024年01月08日	8.75	125,000	1,093,750.00
56	000408	藏格矿业	2024年01月02日	-	2024年01月10日	25.34	43,000	1,089,620.00
57	000768	中航西飞	2024年01月02日	-	2024年01月08日	22.37	48,600	1,087,182.00
58	600155	华创云信	2024年01月02日	-	2024年01月10日	8.34	129,900	1,083,366.00
59	300017	网宿科技	2024年01月02日	-	2024年01月08日	7.85	138,000	1,083,300.00
60	002600	领益智造	2024年01月02日	-	2024年01月03日	6.76	160,000	1,081,600.00

			日	日				
61	600096	云天化	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	15.60	69,200	1,079,520.00
62	002273	水晶光电	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	13.54	78,800	1,066,952.00
63	601995	中金公司	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	38.05	28,000	1,065,400.00
64	600839	四川长虹	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	5.29	198,500	1,050,065.00
65	002241	歌尔股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	21.01	49,400	1,037,894.00
66	300058	蓝色光标	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	7.18	144,100	1,034,638.00
67	002607	中公教育	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	4.08	251,000	1,024,080.00
68	600732	爱旭股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	17.64	57,600	1,016,064.00
69	002195	岩山科技	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	3.07	329,600	1,011,872.00
70	000831	中国稀土	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	27.67	36,000	996,120.00
71	603606	东方电缆	2024 年 01 月 08	-	2024 年 01 月 08	42.75	23,000	983,250.00



			日	日			
72	603816	顾家家居	2024年01月05日	2024年01月10日	35.00	27,900	976,500.00
73	688223	晶科能源	2024年01月02日	2024年01月10日	8.86	107,200	949,792.00
74	688114	华大智造	2024年01月08日	2024年01月08日	86.02	11,000	946,220.00
75	600875	东方电气	2024年01月02日	2024年01月02日	14.62	64,000	935,680.00
76	601666	平煤股份	2024年01月02日	2024年01月10日	11.56	80,000	924,800.00
77	603260	合盛硅业	2024年01月02日	2024年01月10日	51.00	18,000	918,000.00
78	688303	大全能源	2024年01月02日	2024年01月02日	29.57	31,000	916,670.00
79	002131	利欧股份	2024年01月02日	2024年01月10日	2.28	399,500	910,860.00
80	300763	锦浪科技	2024年01月02日	2024年01月10日	69.90	13,000	908,700.00
81	601998	中信银行	2024年01月02日	2024年01月10日	5.29	171,000	904,590.00
82	600803	新奥股份	2024年01月02日	2024年01月02日	16.82	53,400	898,188.00

			日	日				
83	600499	科达制造	2024年01月02日	-	2024年01月08日	10.55	84,000	886,200.00
84	601865	福莱特	2024年01月02日	-	2024年01月08日	26.70	33,100	883,770.00
85	000021	深科技	2024年01月02日	-	2024年01月10日	16.21	54,500	883,445.00
86	601689	拓普集团	2024年01月02日	-	2024年01月10日	73.50	12,000	882,000.00
87	002422	科伦药业	2024年01月02日	-	2024年01月10日	29.05	30,100	874,405.00
88	603688	石英股份	2024年01月02日	-	2024年01月10日	86.88	10,000	868,800.00
89	601997	贵阳银行	2024年01月02日	-	2024年01月03日	5.14	168,000	863,520.00
90	603077	和邦生物	2024年01月02日	-	2024年01月03日	2.36	363,900	858,804.00
91	000069	华侨城A	2024年01月02日	-	2024年01月02日	3.11	275,900	858,049.00
92	300118	东方日升	2024年01月02日	-	2024年01月10日	17.65	48,600	857,790.00
93	000997	新大陆	2024年01月02日	-	2024年01月02日	19.61	43,500	853,035.00

			日	日				
94	300024	机器人	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	11.87	71,800	852,266.00
95	688008	澜起科技	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	58.76	14,500	852,020.00
96	600516	方大炭素	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	5.24	159,000	833,160.00
97	600118	中国卫星	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	25.82	32,100	828,822.00
98	600895	张江高科	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	19.30	42,900	827,970.00
99	600795	国电电力	2024 年 01 月 10 日	-	2024 年 01 月 10 日	4.16	197,900	823,264.00
100	000683	远兴能源	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	5.87	140,000	821,800.00
101	605358	立昂微	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	27.39	30,000	821,700.00
102	600115	中国东航	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	3.88	211,400	820,232.00
103	601872	招商轮船	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	5.88	138,700	815,556.00
104	002558	巨人网络	2024 年 01 月 10 日	-	2024 年 01 月 10 日	11.14	73,000	813,220.00

			日	日				
105	600143	金发科技	2024年01月02日	-	2024年01月10日	7.99	101,600	811,784.00
106	601966	玲珑轮胎	2024年01月02日	-	2024年01月08日	19.23	42,200	811,506.00
107	603000	人民网	2024年01月02日	-	2024年01月10日	27.98	28,600	800,228.00
108	300212	易华录	2024年01月02日	-	2024年01月10日	31.45	25,100	789,395.00
109	300748	金力永磁	2024年01月02日	-	2024年01月03日	20.22	39,000	788,580.00
110	688390	固德威电源	2024年01月02日	-	2024年01月08日	130.58	6,000	783,480.00
111	688772	珠海冠宇电池	2024年01月02日	-	2024年01月03日	22.01	35,500	781,355.00
112	002916	深南电路	2024年01月02日	-	2024年01月08日	70.99	11,000	780,890.00
113	605117	德业股份	2024年01月02日	-	2024年01月10日	83.90	9,300	780,270.00
114	688220	翱捷科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	70.44	11,000	774,840.00
115	600673	东阳光	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.33	105,000	769,650.00

			日	日				
116	688188	上海柏楚电子科技	2024年01月10日	-	2024年01月10日	253.11	3,000	759,330.00
117	300487	蓝晓科技	2024年01月02日	-	2024年01月08日	53.06	14,300	758,758.00
118	002008	大族激光	2024年01月02日	-	2024年01月10日	20.72	36,500	756,280.00
119	300751	迈为股份	2024年01月02日	-	2024年01月03日	129.51	5,800	751,158.00
120	600398	海澜之家	2024年01月02日	-	2024年01月10日	7.42	100,000	742,000.00
121	002268	电科网安	2024年01月02日	-	2024年01月08日	22.46	33,000	741,180.00
122	600863	内蒙华电	2024年01月02日	-	2024年01月02日	3.90	190,000	741,000.00
123	000629	钒钛股份	2024年01月02日	-	2024年01月08日	3.28	224,900	737,672.00
124	000636	风华高科	2024年01月02日	-	2024年01月02日	13.66	54,000	737,640.00
125	601216	君正集团	2024年01月02日	-	2024年01月08日	3.74	196,000	733,040.00
126	002429	兆驰股份	2024年01月02日	-	2024年01月10日	5.58	131,000	730,980.00

			日	日				
127	603338	浙江鼎力	2024年01月02日	-	2024年01月10日	51.17	14,000	716,380.00
128	688363	华熙生物	2024年01月02日	-	2024年01月10日	66.93	10,700	716,151.00
129	689009	九号公司	2024年01月02日	-	2024年01月08日	29.66	23,900	708,874.00
130	300253	卫宁健康	2024年01月02日	-	2024年01月08日	7.19	98,200	706,058.00
131	300604	长川科技	2024年01月02日	-	2024年01月08日	37.99	18,500	702,815.00
132	002368	太极股份	2024年01月02日	-	2024年01月08日	29.53	23,800	702,814.00
133	002739	万达电影	2024年01月02日	-	2024年01月10日	13.02	53,800	700,476.00
134	688521	芯原微电子	2024年01月02日	-	2024年01月08日	49.96	14,000	699,440.00
135	002506	协鑫集成	2024年01月02日	-	2024年01月10日	2.74	254,100	696,234.00
136	600655	豫园股份	2024年01月02日	-	2024年01月10日	6.21	111,000	689,310.00
137	600859	王府井	2024年01月08日	-	2024年01月08日	15.97	43,000	686,710.00

			日	日				
138	688072	拓荆科技	2024年01月02日	-	2024年01月03日	231.30	2,960	684,648.00
139	002385	大北农	2024年01月02日	-	2024年01月08日	5.96	114,400	681,824.00
140	002236	大华股份	2024年01月02日	-	2024年01月08日	18.45	36,600	675,270.00
141	000960	锡业股份	2024年01月02日	-	2024年01月02日	14.32	47,100	674,472.00
142	601456	国联证券	2024年01月02日	-	2024年01月10日	10.84	61,800	669,912.00
143	600021	上海电力	2024年01月02日	-	2024年01月10日	8.46	79,000	668,340.00
144	600998	九州通	2024年01月02日	-	2024年01月03日	7.01	95,100	666,651.00
145	601016	节能风电	2024年01月02日	-	2024年01月03日	3.00	222,100	666,300.00
146	002192	融捷股份	2024年01月03日	-	2024年01月03日	54.21	12,000	650,520.00
147	000519	中兵红箭	2024年01月02日	-	2024年01月10日	14.04	46,300	650,052.00
148	600282	南钢股份	2024年01月08日	-	2024年01月08日	3.70	174,000	643,800.00

			日	日				
149	300373	扬杰科技	2024年01月02日	-	2024年01月08日	36.70	17,500	642,250.00
150	600438	通威股份	2024年01月03日	-	2024年01月03日	25.03	25,400	635,762.00
151	601880	辽港股份	2024年01月02日	-	2024年01月03日	1.45	438,100	635,245.00
152	601919	中远海控	2024年01月02日	-	2024年01月03日	9.58	65,300	625,574.00
153	300682	朗新科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	16.39	38,000	622,820.00
154	300957	贝泰妮	2024年01月08日	-	2024年01月10日	68.17	9,100	620,347.00
155	300677	英科医疗	2024年01月03日	-	2024年01月03日	23.36	26,500	619,040.00
156	300699	光威复材	2024年01月02日	-	2024年01月08日	26.67	23,200	618,744.00
157	600546	山煤国际	2024年01月02日	-	2024年01月08日	17.51	35,300	618,103.00
158	688005	容百科技	2024年01月02日	-	2024年01月03日	39.80	15,500	616,900.00
159	002409	雅克科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	55.73	11,000	613,030.00



			日	日			
160	000547	航天发展	2024年01月02日	2024年01月10日	8.37	73,200	612,684.00
161	600352	浙江龙盛	2024年01月02日	2024年01月02日	8.40	72,900	612,360.00
162	002407	多氟多	2024年01月02日	2024年01月08日	15.22	39,700	604,234.00
163	002531	天顺风能	2024年01月02日	2024年01月10日	11.60	52,000	603,200.00
164	002432	九安医疗	2024年01月02日	2024年01月10日	37.67	16,000	602,720.00
165	601698	中国卫通	2024年01月02日	2024年01月10日	17.31	34,500	597,195.00
166	300033	同花顺	2024年01月02日	2024年01月10日	156.87	3,800	596,106.00
167	000598	兴蓉环境	2024年01月02日	2024年01月03日	5.69	104,300	593,467.00
168	002850	科达利	2024年01月02日	2024年01月08日	84.46	7,000	591,220.00
169	002493	荣盛石化	2024年01月02日	2024年01月08日	10.35	57,100	590,985.00
170	603659	璞泰来	2024年01月02日	2024年01月03日	20.93	28,200	590,226.00

			日	日			
171	002572	索菲亚	2024年01月02日	- 2024年01月10日	15.95	37,000	590,150.00
172	603225	新凤鸣	2024年01月02日	- 2024年01月08日	14.20	41,500	589,300.00
173	300026	红日药业	2024年01月02日	- 2024年01月08日	4.24	138,900	588,936.00
174	601336	新华保险	2024年01月02日	- 2024年01月03日	31.13	18,900	588,357.00
175	688536	思瑞浦股份	2024年01月02日	- 2024年01月03日	146.30	4,000	585,200.00
176	688396	华润微电子	2024年01月02日	- 2024年01月08日	44.69	13,000	580,970.00
177	601788	光大证券	2024年01月02日	- 2024年01月03日	15.42	37,600	579,792.00
178	688385	复旦微电	2024年01月02日	- 2024年01月08日	38.63	15,000	579,450.00
179	002831	裕同科技	2024年01月02日	- 2024年01月10日	27.51	21,000	577,710.00
180	002756	永兴材料	2024年01月02日	- 2024年01月10日	52.21	11,000	574,310.00
181	002373	千方科技	2024年01月02日	- 2024年01月03日	11.21	51,100	572,831.00

			日	日				
182	688234	天岳先进	2024年01月08日	-	2024年01月08日	66.07	8,600	568,202.00
183	688120	华海清科	2024年01月08日	-	2024年01月08日	187.70	3,000	563,100.00
184	600707	彩虹股份	2024年01月02日	-	2024年01月08日	6.75	83,300	562,275.00
185	002281	光迅科技	2024年01月02日	-	2024年01月10日	28.50	19,700	561,450.00
186	603799	华友钴业	2024年01月02日	-	2024年01月02日	32.93	17,000	559,810.00
187	002459	晶澳科技	2024年01月02日	-	2024年01月03日	20.72	27,000	559,440.00
188	600369	西南证券	2024年01月02日	-	2024年01月10日	4.09	136,500	558,285.00
189	603160	汇顶科技	2024年01月02日	-	2024年01月08日	69.10	8,000	552,800.00
190	000155	川能动力	2024年01月02日	-	2024年01月10日	13.29	41,400	550,206.00
191	002487	大金重工	2024年01月02日	-	2024年01月08日	26.62	20,600	548,372.00
192	601179	中国西电	2024年01月08日	-	2024年01月08日	4.93	111,000	547,230.00

			日	日			
193	600959	江苏有线	2024年01月02日	2024年01月10日	3.14	174,100	546,674.00
194	600995	南网储能	2024年01月02日	2024年01月10日	9.86	55,400	546,244.00
195	603939	益丰药房	2024年01月02日	2024年01月10日	40.04	13,600	544,544.00
196	601866	中远海发	2024年01月02日	2024年01月03日	2.34	232,500	544,050.00
197	688032	禾迈股份	2024年01月02日	2024年01月02日	270.00	2,000	540,000.00
198	000703	恒逸石化	2024年01月02日	2024年01月03日	6.72	80,200	538,944.00
199	300296	利亚德	2024年01月02日	2024年01月03日	6.00	89,800	538,800.00
200	603486	科沃斯	2024年01月02日	2024年01月08日	41.44	13,000	538,720.00
201	000887	中鼎股份	2024年01月02日	2024年01月08日	12.37	42,800	529,436.00
202	601958	金钼股份	2024年01月02日	2024年01月03日	9.45	55,900	528,255.00
203	002152	广电运通	2024年01月02日	2024年01月03日	12.26	43,000	527,180.00

			日	日				
204	688187	时代电气	2024年01月02日	-	2024年01月10日	36.33	14,500	526,785.00
205	600416	湘电股份	2024年01月02日	-	2024年01月10日	15.88	33,000	524,040.00
206	603737	三棵树	2024年01月02日	-	2024年01月08日	47.61	11,000	523,710.00
207	000739	普洛药业	2024年01月02日	-	2024年01月03日	15.39	34,000	523,260.00
208	601881	中国银河	2024年01月02日	-	2024年01月10日	12.05	43,100	519,355.00
209	002936	郑州银行	2024年01月02日	-	2024年01月02日	2.01	258,000	518,580.00
210	603019	中科曙光	2024年01月02日	-	2024年01月02日	39.49	13,000	513,370.00
211	002065	东华软件	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.17	83,100	512,727.00
212	002244	滨江集团	2024年01月02日	-	2024年01月10日	7.27	70,400	511,808.00
213	000709	河钢股份	2024年01月03日	-	2024年01月03日	2.13	240,000	511,200.00
214	002156	通富微电	2024年01月02日	-	2024年01月10日	23.12	22,100	510,952.00

			日	日				
215	002683	广东宏大	2024年01月02日	-	2024年01月08日	20.08	25,400	510,032.00
216	000970	中科三环	2024年01月02日	-	2024年01月02日	10.35	49,000	507,150.00
217	600362	江西铜业	2024年01月02日	-	2024年01月03日	17.86	28,300	505,438.00
218	002465	海格通信	2024年01月02日	-	2024年01月10日	12.85	39,000	501,150.00
219	600160	巨化股份	2024年01月02日	-	2024年01月03日	16.49	29,900	493,051.00
220	688200	华峰测控	2024年01月03日	-	2024年01月08日	122.80	4,000	491,200.00
221	603444	吉比特	2024年01月08日	-	2024年01月08日	245.12	2,000	490,240.00
222	000591	太阳能	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.58	87,200	486,576.00
223	600373	中文传媒	2024年01月04日	-	2024年01月10日	13.18	36,900	486,342.00
224	600801	华新水泥	2024年01月02日	-	2024年01月03日	12.43	39,100	486,013.00
225	688029	南微医学科技	2024年01月02日	-	2024年01月10日	96.80	5,000	484,000.00

			日	日			
226	600528	中铁工业	2024年01月02日	2024年01月03日	7.44	65,000	483,600.00
227	000617	中油资本	2024年01月02日	2024年01月03日	5.40	88,400	477,360.00
228	000733	振华科技	2024年01月02日	2024年01月08日	58.84	8,100	476,604.00
229	300438	鹏辉能源	2024年01月02日	2024年01月10日	28.29	16,800	475,272.00
230	600901	江苏金租	2024年01月02日	2024年01月10日	4.84	98,100	474,804.00
231	601901	方正证券	2024年01月08日	2024年01月10日	8.06	58,900	474,734.00
232	603893	瑞芯微	2024年01月02日	2024年01月08日	63.40	7,400	469,160.00
233	600056	中国医药	2024年01月02日	2024年01月08日	11.17	42,000	469,140.00
234	600141	兴发集团	2024年01月02日	2024年01月03日	18.25	25,700	469,025.00
235	600378	昊华科技	2024年01月02日	2024年01月10日	30.48	15,300	466,344.00
236	603650	彤程新材	2024年01月02日	2024年01月10日	33.30	14,000	466,200.00

			日	日				
237	003035	南网能源	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.26	87,800	461,828.00
238	002032	苏泊尔	2024年01月02日	-	2024年01月08日	53.01	8,700	461,187.00
239	601696	中银证券	2024年01月02日	-	2024年01月02日	10.29	44,800	460,992.00
240	002414	高德红外	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.30	63,000	459,900.00
241	000800	一汽解放	2024年01月02日	-	2024年01月10日	8.50	54,000	459,000.00
242	002326	永太科技	2024年01月02日	-	2024年01月08日	11.62	39,500	458,990.00
243	002049	紫光国微	2024年01月02日	-	2024年01月03日	67.45	6,800	458,660.00
244	002841	视源股份	2024年01月02日	-	2024年01月02日	45.76	10,000	457,600.00
245	002444	巨星科技	2024年01月02日	-	2024年01月08日	22.52	20,200	454,904.00
246	601992	金隅集团	2024年01月02日	-	2024年01月10日	1.91	238,100	454,771.00
247	603267	鸿远电子	2024年01月02日	-	2024年01月10日	50.20	9,000	451,800.00



			日	日				
248	600062	华润双鹤	2024年01月03日	-	2024年01月10日	18.60	24,200	450,120.00
249	601236	红塔证券	2024年01月02日	-	2024年01月03日	7.59	59,100	448,569.00
250	688063	派能科技	2024年01月02日	-	2024年01月08日	106.00	4,200	445,200.00
251	300866	安克创新	2024年01月02日	-	2024年01月02日	88.60	5,000	443,000.00
252	600481	双良节能	2024年01月02日	-	2024年01月02日	8.46	52,000	439,920.00
253	300114	中航电测	2024年01月08日	-	2024年01月08日	43.75	10,000	437,500.00
254	000581	威孚高科	2024年01月02日	-	2024年01月10日	15.07	29,000	437,030.00
255	002064	华峰化学	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.71	65,000	436,150.00
256	000937	冀中能源	2024年01月02日	-	2024年01月08日	7.14	61,000	435,540.00
257	002408	齐翔腾达	2024年01月02日	-	2024年01月10日	5.28	82,200	434,016.00
258	600871	石化油服	2024年01月02日	-	2024年01月10日	1.83	236,600	432,978.00

			日	日				
259	002439	启明星辰	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	27.00	16,000	432,000.00
260	600316	洪都航空	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	21.17	20,400	431,868.00
261	002624	完美世界	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	11.84	36,400	430,976.00
262	603228	景旺电子	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	22.56	19,000	428,640.00
263	600879	航天电子	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	7.71	55,200	425,592.00
264	300776	帝尔激光	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 10 日	60.26	7,000	421,820.00
265	300088	长信科技	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	6.69	63,000	421,470.00
266	300979	华利集团	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	52.64	8,000	421,120.00
267	600022	山东钢铁	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	1.37	307,200	420,864.00
268	002203	海亮股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	11.15	37,500	418,125.00
269	600399	抚顺特钢	2024 年 01 月 02	-	2024 年 01 月 08	9.72	42,700	415,044.00

			日	日				
270	603305	旭升集团	2024年01月02日	-	2024年01月02日	19.73	21,000	414,330.00
271	603826	坤彩科技	2024年01月03日	-	2024年01月08日	59.03	7,000	413,210.00
272	600460	士兰微	2024年01月02日	-	2024年01月08日	22.83	17,900	408,657.00
273	600008	首创环保	2024年01月02日	-	2024年01月02日	2.69	150,500	404,845.00
274	000893	亚钾国际	2024年01月02日	-	2024年01月02日	26.24	15,400	404,096.00
275	601111	中国国航	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.34	55,000	403,700.00
276	003022	联泓新科	2024年01月08日	-	2024年01月08日	18.31	22,000	402,820.00
277	002372	伟星新材	2024年01月02日	-	2024年01月02日	14.47	27,700	400,819.00
278	000401	冀东水泥	2024年01月02日	-	2024年01月03日	6.39	62,600	400,014.00
279	600764	中国海防	2024年01月08日	-	2024年01月08日	24.95	16,000	399,200.00
280	600967	内蒙一机	2024年01月02日	-	2024年01月08日	8.26	48,200	398,132.00

			日	日				
281	603986	兆易创新	2024年01月02日	-	2024年01月02日	92.39	4,300	397,277.00
282	601231	环旭电子	2024年01月02日	-	2024年01月02日	15.11	26,100	394,371.00
283	600755	厦门国贸	2024年01月02日	-	2024年01月03日	6.97	56,500	393,805.00
284	600258	首旅酒店	2024年01月02日	-	2024年01月03日	15.62	25,200	393,624.00
285	601156	东航物流	2024年01月03日	-	2024年01月08日	14.78	26,000	384,280.00
286	600985	淮北矿业	2024年01月02日	-	2024年01月02日	16.63	23,000	382,490.00
287	603927	中科软	2024年01月02日	-	2024年01月02日	29.98	12,700	380,746.00
288	600325	华发股份	2024年01月02日	-	2024年01月03日	7.21	52,000	374,920.00
289	688349	三一重能	2024年01月02日	-	2024年01月02日	28.62	13,000	372,060.00
290	002010	传化智联	2024年01月02日	-	2024年01月02日	4.62	80,000	369,600.00
291	688425	铁建重工	2024年01月02日	-	2024年01月08日	3.97	93,000	369,210.00

			日	日				
292	300888	稳健 医疗	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	37.25	9,900	368,775.00
293	001286	陕西 能源	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	8.55	43,000	367,650.00
294	000877	天山 股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	6.68	54,800	366,064.00
295	603218	日月 股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	12.37	29,400	363,678.00
296	002518	科士 达	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	27.60	13,100	361,560.00
297	000723	美锦 能源	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	6.66	54,000	359,640.00
298	601928	凤凰 传媒	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	8.81	40,800	359,448.00
299	601878	浙商 证券	2024 年 01 月 03 日	-	2024 年 01 月 10 日	10.43	34,200	356,706.00
300	688520	神州 细胞 集团 公司	2024 年 01 月 10 日	-	2024 年 01 月 10 日	53.87	6,600	355,542.00
301	002505	鹏都 农牧	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	1.60	221,000	353,600.00
302	300257	开山 股份	2024 年 01 月 02	-	2024 年 01 月 08	15.76	22,000	346,720.00

			日	日			
303	600126	杭钢股份	2024年01月08日	2024年01月10日	5.33	65,000	346,450.00
304	600663	陆家嘴	2024年01月02日	2024年01月08日	8.75	39,400	344,750.00
305	002508	老板电器	2024年01月02日	2024年01月03日	21.78	15,700	341,946.00
306	600348	华阳股份	2024年01月02日	2024年01月02日	9.76	35,000	341,600.00
307	000559	万向钱潮	2024年01月02日	2024年01月10日	5.19	65,300	338,907.00
308	600025	华能水电	2024年01月02日	2024年01月02日	8.63	39,000	336,570.00
309	000050	深天马A	2024年01月02日	2024年01月02日	10.65	31,000	330,150.00
310	601898	中煤能源	2024年01月02日	2024年01月02日	9.69	34,000	329,460.00
311	000338	潍柴动力	2024年01月02日	2024年01月02日	13.65	24,000	327,600.00
312	603290	斯达半导	2024年01月10日	2024年01月10日	181.00	1,800	325,800.00
313	600517	国网英大	2024年01月02日	2024年01月10日	4.77	68,200	325,314.00

			日	日				
314	601568	北元集团	2024年01月02日	-	2024年01月03日	4.74	68,600	325,164.00
315	002867	周大生	2024年01月02日	-	2024年01月03日	15.18	21,000	318,780.00
316	600208	新湖中宝	2024年01月02日	-	2024年01月08日	2.17	146,500	317,905.00
317	600660	福耀玻璃	2024年01月02日	-	2024年01月08日	37.39	8,500	317,815.00
318	002926	华西证券	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.76	40,900	317,384.00
319	000009	中国宝安	2024年01月02日	-	2024年01月02日	11.74	27,000	316,980.00
320	600435	北方导航	2024年01月02日	-	2024年01月03日	11.74	27,000	316,980.00
321	603712	七一二	2024年01月02日	-	2024年01月02日	31.51	10,000	315,100.00
322	002625	光启技术	2024年01月02日	-	2024年01月03日	14.78	21,300	314,814.00
323	002423	中粮资本	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.68	47,000	313,960.00
324	002223	鱼跃医疗	2024年01月02日	-	2024年01月02日	34.58	9,000	311,220.00

			日	日				
325	000537	中绿电	2024年01月02日	-	2024年01月08日	9.63	32,000	308,160.00
326	000400	许继电气	2024年01月02日	-	2024年01月02日	21.96	14,000	307,440.00
327	300390	天华新能	2024年01月02日	-	2024年01月10日	25.35	12,100	306,735.00
328	601939	建设银行	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.51	47,000	305,970.00
329	300433	蓝思科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	13.20	23,000	303,600.00
330	600129	太极集团	2024年01月03日	-	2024年01月08日	46.46	6,500	301,990.00
331	600598	北大荒	2024年01月02日	-	2024年01月02日	11.97	25,200	301,644.00
332	600109	国金证券	2024年01月02日	-	2024年01月03日	9.08	33,100	300,548.00
333	603899	晨光股份	2024年01月02日	-	2024年01月10日	37.55	8,000	300,400.00
334	600977	中国电影	2024年01月08日	-	2024年01月08日	12.24	24,300	297,432.00
335	600989	宝丰能源	2024年01月02日	-	2024年01月02日	14.77	20,000	295,400.00



			日	日				
336	600150	中国船舶	2024年01月02日	-	2024年01月02日	29.44	10,000	294,400.00
337	002410	广联达	2024年01月02日	-	2024年01月10日	17.14	17,100	293,094.00
338	001914	招商积余	2024年01月02日	-	2024年01月10日	11.96	24,500	293,020.00
339	600845	宝信软件	2024年01月02日	-	2024年01月02日	48.80	6,000	292,800.00
340	601985	中国核电	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.50	39,000	292,500.00
341	600390	五矿资本	2024年01月02日	-	2024年01月08日	4.68	62,500	292,500.00
342	600015	华夏银行	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.62	52,000	292,240.00
343	002078	太阳纸业	2024年01月02日	-	2024年01月02日	12.17	24,000	292,080.00
344	600066	宇通客车	2024年01月02日	-	2024年01月02日	13.25	22,000	291,500.00
345	002384	东山精密	2024年01月02日	-	2024年01月02日	18.18	16,000	290,880.00
346	000963	华东医药	2024年01月02日	-	2024年01月02日	41.46	7,000	290,220.00

			日	日				
347	002938	鹏鼎 控股	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	22.32	13,000	290,160.00
348	603379	三美 股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	34.00	8,500	289,000.00
349	002240	盛新 锂能	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	22.75	12,700	288,925.00
350	002966	苏州 银行	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	6.46	44,700	288,762.00
351	601615	明阳 智能	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	12.54	23,000	288,420.00
352	688387	中信 科移 动	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	7.21	40,000	288,400.00
353	601233	桐昆 股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	15.13	19,000	287,470.00
354	002761	浙江 建投	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	10.26	28,000	287,280.00
355	600392	盛和 资源	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	10.18	28,200	287,076.00
356	000933	神火 股份	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	16.80	17,000	285,600.00
357	600588	用友 网络	2024 年 01 月 02	-	2024 年 01 月 02	17.79	16,000	284,640.00

			日	日				
358	600039	四川路桥	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.49	38,000	284,620.00
359	002608	江苏国信	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.57	43,000	282,510.00
360	002925	盈趣科技	2024年01月02日	-	2024年01月10日	19.47	14,500	282,315.00
361	300782	卓胜微	2024年01月02日	-	2024年01月02日	141.00	2,000	282,000.00
362	300383	光环新网	2024年01月02日	-	2024年01月02日	9.72	29,000	281,880.00
363	600580	卧龙电驱	2024年01月02日	-	2024年01月02日	11.73	24,000	281,520.00
364	002797	第一创业	2024年01月03日	-	2024年01月03日	5.81	48,300	280,623.00
365	601669	中国电建	2024年01月02日	-	2024年01月02日	4.89	57,000	278,730.00
366	601717	郑煤机	2024年01月02日	-	2024年01月02日	12.65	22,000	278,300.00
367	002138	顺络电子	2024年01月02日	-	2024年01月03日	27.01	10,300	278,203.00
368	002415	海康威视	2024年01月02日	-	2024年01月02日	34.72	8,000	277,760.00

			日	日				
369	603185	弘元 绿能	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	33.28	8,300	276,224.00
370	002738	中矿 资源	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 10 日	37.31	7,400	276,094.00
371	600089	特变 电工	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	13.80	20,000	276,000.00
372	000157	中联 重科	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	6.53	42,000	274,260.00
373	000623	吉林 敖东	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	15.14	18,100	274,034.00
374	000333	美的 集团	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	54.63	5,000	273,150.00
375	002670	国盛 金控	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 03 日	9.32	29,300	273,076.00
376	600060	海信 视像	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	20.90	13,000	271,700.00
377	600482	中国 动力	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	18.01	15,000	270,150.00
378	000089	深圳 机场	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	6.43	42,000	270,060.00
379	601318	中国 平安	2024 年 01 月 02	-	2024 年 01 月 03	40.30	6,700	270,010.00

			日	日				
380	600038	中直股份	2024年01月02日	-	2024年01月02日	38.53	7,000	269,710.00
381	300568	星源材质	2024年01月02日	-	2024年01月10日	15.42	17,400	268,308.00
382	600497	驰宏锌锗	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.05	53,000	267,650.00
383	002155	湖南黄金	2024年01月02日	-	2024年01月02日	11.14	24,000	267,360.00
384	002202	金风科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	8.00	33,400	267,200.00
385	000708	中信特钢	2024年01月02日	-	2024年01月02日	14.04	19,000	266,760.00
386	601009	南京银行	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.38	36,000	265,680.00
387	601012	隆基绿能	2024年01月02日	-	2024年01月03日	22.90	11,600	265,640.00
388	600884	杉杉股份	2024年01月02日	-	2024年01月10日	13.62	19,500	265,590.00
389	002648	卫星化学	2024年01月02日	-	2024年01月02日	14.75	18,000	265,500.00
390	002563	森马服饰	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.77	46,000	265,420.00

			日	日				
391	688981	中芯国际	2024年01月02日	-	2024年01月02日	53.02	5,000	265,100.00
392	601728	中国电信	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.41	49,000	265,090.00
393	300408	三环集团	2024年01月02日	-	2024年01月02日	29.45	9,000	265,050.00
394	601106	中国一重	2024年01月02日	-	2024年01月02日	2.88	92,000	264,960.00
395	600029	南方航空	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.76	46,000	264,960.00
396	002185	华天科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	8.52	31,000	264,120.00
397	601799	星宇股份	2024年01月02日	-	2024年01月02日	131.11	2,000	262,220.00
398	600177	雅戈尔	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.55	40,000	262,000.00
399	600011	华能国际	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.70	34,000	261,800.00
400	600893	航发动力	2024年01月02日	-	2024年01月02日	37.38	7,000	261,660.00
401	600489	中金黄金	2024年01月02日	-	2024年01月02日	9.96	26,000	258,960.00

			日	日			
402	000987	越秀资本	2024年01月02日	2024年01月10日	6.02	43,000	258,860.00
403	002532	天山铝业	2024年01月02日	2024年01月02日	6.01	43,000	258,430.00
404	601877	正泰电器	2024年01月02日	2024年01月02日	21.51	12,000	258,120.00
405	601766	中国中车	2024年01月02日	2024年01月02日	5.26	49,000	257,740.00
406	600131	国网信通	2024年01月02日	2024年01月02日	15.15	17,000	257,550.00
407	000651	格力电器	2024年01月02日	2024年01月02日	32.17	8,000	257,360.00
408	000060	中金岭南	2024年01月02日	2024年01月03日	4.32	59,500	257,040.00
409	688599	天合光能	2024年01月02日	2024年01月02日	28.53	9,000	256,770.00
410	600500	中化国际	2024年01月02日	2024年01月10日	4.42	58,000	256,360.00
411	600095	湘财股份	2024年01月02日	2024年01月03日	7.51	34,000	255,340.00
412	002690	美亚光电	2024年01月02日	2024年01月02日	19.64	13,000	255,320.00

			日	日				
413	000792	盐湖股份	2024年01月02日	-	2024年01月02日	15.95	16,000	255,200.00
414	000539	粤电力A	2024年01月10日	-	2024年01月10日	4.89	52,000	254,280.00
415	600745	闻泰科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	42.31	6,000	253,860.00
416	600760	中航沈飞	2024年01月02日	-	2024年01月02日	42.18	6,000	253,080.00
417	600928	西安银行	2024年01月03日	-	2024年01月08日	3.33	76,000	253,080.00
418	300251	光线传媒	2024年01月02日	-	2024年01月02日	8.15	31,000	252,650.00
419	600486	扬农化工	2024年01月02日	-	2024年01月02日	63.12	4,000	252,480.00
420	300413	芒果超媒	2024年01月02日	-	2024年01月02日	25.20	10,000	252,000.00
421	601059	信达证券	2024年01月08日	-	2024年01月10日	17.99	14,000	251,860.00
422	600547	山东黄金	2024年01月02日	-	2024年01月02日	22.87	11,000	251,570.00
423	601021	春秋航空	2024年01月02日	-	2024年01月02日	50.20	5,000	251,000.00



			日	日				
424	603833	欧派家居	2024年01月02日	-	2024年01月10日	69.61	3,600	250,596.00
425	600372	中航机载	2024年01月02日	-	2024年01月02日	13.18	19,000	250,420.00
426	603529	爱玛科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	25.04	10,000	250,400.00
427	600153	建发股份	2024年01月02日	-	2024年01月02日	9.63	26,000	250,380.00
428	600926	杭州银行	2024年01月02日	-	2024年01月02日	10.01	25,000	250,250.00
429	600346	恒力石化	2024年01月02日	-	2024年01月02日	13.17	19,000	250,230.00
430	002468	申通快递	2024年01月02日	-	2024年01月03日	7.79	32,000	249,280.00
431	601808	中海油服	2024年01月02日	-	2024年01月02日	14.62	17,000	248,540.00
432	300070	碧水源	2024年01月02日	-	2024年01月10日	4.99	49,400	246,506.00
433	000938	紫光股份	2024年01月02日	-	2024年01月02日	19.35	12,700	245,745.00
434	601990	南京证券	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.98	30,700	244,986.00

			日	日				
435	600271	航天信息	2024年01月02日	-	2024年01月02日	10.64	23,000	244,720.00
436	601611	中国核建	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.93	35,300	244,629.00
437	603993	洛阳钼业	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.20	47,000	244,400.00
438	002092	中泰化学	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.10	40,000	244,000.00
439	601828	美凯龙	2024年01月02日	-	2024年01月10日	3.87	63,000	243,810.00
440	600862	中航高科	2024年01月02日	-	2024年01月02日	22.15	11,000	243,650.00
441	688126	上海硅产业集团	2024年01月02日	-	2024年01月02日	17.32	14,000	242,480.00
442	600167	联美控股	2024年01月02日	-	2024年01月03日	5.67	42,700	242,109.00
443	002709	天赐材料	2024年01月10日	-	2024年01月10日	25.08	9,600	240,768.00
444	300496	中科创达	2024年01月02日	-	2024年01月02日	80.06	3,000	240,180.00
445	600584	长电科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	29.86	8,000	238,880.00

			日	日				
446	000738	航发控制	2024年01月02日	-	2024年01月02日	19.90	12,000	238,800.00
447	601390	中国中铁	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.68	42,000	238,560.00
448	002595	豪迈科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	29.77	8,000	238,160.00
449	601319	中国人保	2024年01月02日	-	2024年01月02日	4.84	49,000	237,160.00
450	601838	成都银行	2024年01月02日	-	2024年01月02日	11.26	21,000	236,460.00
451	300628	亿联网络	2024年01月02日	-	2024年01月02日	29.55	8,000	236,400.00
452	000001	平安银行	2024年01月02日	-	2024年01月02日	9.39	25,000	234,750.00
453	600031	三一重工	2024年01月02日	-	2024年01月02日	13.77	17,000	234,090.00
454	002945	华林证券	2024年01月02日	-	2024年01月10日	15.10	15,500	234,050.00
455	002179	中航光电	2024年01月02日	-	2024年01月02日	39.00	6,000	234,000.00
456	600233	圆通速递	2024年01月02日	-	2024年01月02日	12.29	19,000	233,510.00

			日	日				
457	600690	海尔智家	2024年01月02日	-	2024年01月02日	21.00	11,000	231,000.00
458	002056	横店东磁	2024年01月02日	-	2024年01月02日	13.54	17,000	230,180.00
459	002180	纳思达	2024年01月02日	-	2024年01月02日	22.63	10,000	226,300.00
460	601636	旗滨集团	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.84	33,000	225,720.00
461	000830	鲁西化工	2024年01月02日	-	2024年01月02日	10.03	22,500	225,675.00
462	300724	捷佳伟创	2024年01月02日	-	2024年01月02日	74.01	3,000	222,030.00
463	688516	奥特维科技	2024年01月02日	-	2024年01月03日	90.50	2,450	221,725.00
464	600426	华鲁恒升	2024年01月02日	-	2024年01月02日	27.59	8,000	220,720.00
465	601139	深圳燃气	2024年01月02日	-	2024年01月08日	6.89	32,000	220,480.00
466	300316	晶盛机电	2024年01月02日	-	2024年01月02日	44.09	5,000	220,450.00
467	600988	赤峰黄金	2024年01月02日	-	2024年01月03日	14.01	15,700	219,957.00

			日	日			
468	000031	大悦城	2024年01月08日	2024年01月10日	2.97	74,000	219,780.00
469	300395	菲利华	2024年01月02日	2024年01月02日	36.56	6,000	219,360.00
470	601100	恒立液压	2024年01月02日	2024年01月02日	54.68	4,000	218,720.00
471	603806	福斯特	2024年01月02日	2024年01月02日	24.27	9,000	218,430.00
472	000156	华数传媒	2024年01月02日	2024年01月10日	7.37	29,500	217,415.00
473	300144	宋城演艺	2024年01月02日	2024年01月02日	9.87	22,000	217,140.00
474	601598	中国外运	2024年01月02日	2024年01月03日	5.24	41,000	214,840.00
475	002153	石基信息	2024年01月02日	2024年01月02日	9.74	22,000	214,280.00
476	300012	华测检测	2024年01月02日	2024年01月02日	14.20	15,000	213,000.00
477	603156	养元饮品	2024年01月02日	2024年01月08日	21.26	10,000	212,600.00
478	000423	东阿阿胶	2024年01月02日	2024年01月02日	49.32	4,300	212,076.00

			日	日				
479	601061	中信金属	2024年01月08日	-	2024年01月08日	7.71	27,000	208,170.00
480	300285	国瓷材料	2024年01月02日	-	2024年01月02日	23.12	9,000	208,080.00
481	601155	新城控股	2024年01月02日	-	2024年01月02日	11.41	18,200	207,662.00
482	002080	中材科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	15.92	13,000	206,960.00
483	600570	恒生电子	2024年01月02日	-	2024年01月02日	28.76	7,100	204,196.00
484	002030	达安基因	2024年01月02日	-	2024年01月03日	9.68	21,000	203,280.00
485	000402	金融街	2024年01月02日	-	2024年01月10日	3.63	55,700	202,191.00
486	002399	海普瑞	2024年01月02日	-	2024年01月03日	11.73	17,200	201,756.00
487	002120	韵达股份	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.46	27,000	201,420.00
488	688561	奇安信集团	2024年01月02日	-	2024年01月02日	40.09	5,000	200,450.00
489	001872	招商港口	2024年01月02日	-	2024年01月08日	15.96	12,500	199,500.00

			日	日				
490	600941	中国移动	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	99.48	2,000	198,960.00
491	601628	中国人寿	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	28.35	7,000	198,450.00
492	600176	中国巨石	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	9.83	20,000	196,600.00
493	300450	先导智能	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	25.60	7,600	194,560.00
494	000778	新兴铸管	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 08 日	3.82	50,900	194,438.00
495	300223	北京君正	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	64.65	3,000	193,950.00
496	002025	航天电器	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	48.02	4,000	192,080.00
497	603195	公牛集团	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	95.65	2,000	191,300.00
498	600765	中航重机	2024 年 01 月 02 日	-	2024 年 01 月 02 日	19.11	10,000	191,100.00
499	603707	健友股份	2024 年 01 月 10 日	-	2024 年 01 月 10 日	15.00	12,700	190,500.00
500	600521	华海药业	2024 年 01 月 02	-	2024 年 01 月 02	14.67	12,800	187,776.00

			日	日				
501	300363	博腾股份	2024年01月03日	-	2024年01月08日	25.15	7,400	186,110.00
502	300676	华大基因	2024年01月02日	-	2024年01月02日	48.00	3,800	182,400.00
503	600377	宁沪高速	2024年01月02日	-	2024年01月03日	10.25	17,300	177,325.00
504	300595	欧普康视	2024年01月08日	-	2024年01月10日	22.58	7,800	176,124.00
505	601162	天风证券	2024年01月02日	-	2024年01月08日	3.09	56,800	175,512.00
506	000883	湖北能源	2024年01月02日	-	2024年01月10日	4.23	41,000	173,430.00
507	002129	TCL中环	2024年01月02日	-	2024年01月02日	15.64	11,000	172,040.00
508	000553	安道麦A	2024年01月02日	-	2024年01月08日	6.94	24,700	171,418.00
509	000728	国元证券	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.83	24,700	168,701.00
510	600906	财达证券	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.50	22,300	167,250.00
511	688276	长春百克生物	2024年01月03日	-	2024年01月03日	54.81	3,000	164,430.00



		科技	日	日				
512	603056	德邦股份	2024年01月02日	-	2024年01月08日	14.47	11,000	159,170.00
513	000750	国海证券	2024年01月02日	-	2024年01月03日	3.54	43,200	152,928.00
514	600699	均胜电子	2024年01月02日	-	2024年01月08日	17.96	8,500	152,660.00
515	002601	龙佰集团	2024年01月02日	-	2024年01月02日	17.13	8,800	150,744.00
516	000027	深圳能源	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.45	23,100	148,995.00
517	600188	兖矿能源	2024年01月02日	-	2024年01月10日	19.81	7,500	148,575.00
518	603885	吉祥航空	2024年01月02日	-	2024年01月02日	12.00	12,300	147,600.00
519	300454	深信服	2024年01月02日	-	2024年01月02日	72.29	2,000	144,580.00
520	002050	三花智控	2024年01月02日	-	2024年01月08日	29.40	4,900	144,060.00
521	600956	新天绿能	2024年01月02日	-	2024年01月10日	8.13	17,700	143,901.00
522	688728	格科微有限公司	2024年01月02日	-	2024年01月02日	20.47	7,000	143,290.00

		司	日	日				
523	600600	青岛啤酒	2024年01月10日	-	2024年01月10日	74.75	1,800	134,550.00
524	002568	百润股份	2024年01月02日	-	2024年01月03日	24.61	5,400	132,894.00
525	002603	以岭药业	2024年01月03日	-	2024年01月03日	23.07	5,700	131,499.00
526	002028	思源电气	2024年01月02日	-	2024年01月10日	52.04	2,500	130,100.00
527	002653	海思科	2024年01月02日	-	2024年01月03日	23.15	5,500	127,325.00
528	601288	农业银行	2024年01月03日	-	2024年01月03日	3.64	34,900	127,036.00
529	601577	长沙银行	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.82	18,300	124,806.00
530	000998	隆平高科	2024年01月08日	-	2024年01月08日	14.10	8,800	124,080.00
531	002497	雅化集团	2024年01月02日	-	2024年01月02日	13.09	9,400	123,046.00
532	600350	山东高速	2024年01月02日	-	2024年01月10日	6.94	17,300	120,062.00
533	002262	恩华药业	2024年01月08日	-	2024年01月08日	27.12	4,400	119,328.00

			日	日			
534	603501	韦尔股份	2024年01月02日	- 2024年01月02日	106.71	1,100	117,381.00
535	601298	青岛港	2024年01月02日	- 2024年01月08日	6.18	18,700	115,566.00
536	600299	安迪苏	2024年01月02日	- 2024年01月10日	8.00	13,800	110,400.00
537	600030	中信证券	2024年01月03日	- 2024年01月03日	20.37	5,300	107,961.00
538	002353	杰瑞股份	2024年01月02日	- 2024年01月02日	28.11	3,800	106,818.00
539	300498	温氏股份	2024年01月02日	- 2024年01月02日	20.06	5,200	104,312.00
540	601118	海南橡胶	2024年01月02日	- 2024年01月10日	4.24	24,300	103,032.00
541	000425	徐工机械	2024年01月02日	- 2024年01月02日	5.46	18,600	101,556.00
542	000898	鞍钢股份	2024年01月03日	- 2024年01月03日	2.49	40,300	100,347.00
543	601158	重庆水务	2024年01月02日	- 2024年01月02日	5.67	16,400	92,988.00
544	300001	特锐德	2024年01月02日	- 2024年01月03日	20.10	4,600	92,460.00

			日	日				
545	600637	东方明珠	2024年01月02日	-	2024年01月08日	7.52	11,800	88,736.00
546	603127	昭衍新药	2024年01月02日	-	2024年01月08日	23.71	3,700	87,727.00
547	688331	荣昌生物	2024年01月02日	-	2024年01月02日	62.06	1,300	80,678.00
548	601128	常熟银行	2024年01月02日	-	2024年01月02日	6.39	12,400	79,236.00
549	601857	中国石油	2024年01月03日	-	2024年01月03日	7.06	10,700	75,542.00
550	688567	孚能科技	2024年01月02日	-	2024年01月10日	16.31	4,600	75,026.00
551	600535	天士力	2024年01月02日	-	2024年01月02日	17.02	4,200	71,484.00
552	002557	洽洽食品	2024年01月03日	-	2024年01月10日	34.82	2,000	69,640.00
553	603858	步长制药	2024年01月02日	-	2024年01月02日	17.01	4,000	68,040.00
554	000876	新希望	2024年01月02日	-	2024年01月03日	9.32	7,300	68,036.00
555	603317	天味食品	2024年01月03日	-	2024年01月03日	13.29	4,900	65,121.00

			日	日			
556	600606	绿地控股	2024年01月02日	2024年01月08日	2.30	28,200	64,860.00
557	601778	晶科科技	2024年01月02日	2024年01月10日	3.50	18,100	63,350.00
558	688099	晶晨半导体	2024年01月02日	2024年01月02日	62.63	1,000	62,630.00
559	002939	长城证券	2024年01月02日	2024年01月02日	8.00	7,700	61,600.00
560	300122	智飞生物	2024年01月02日	2024年01月02日	61.11	1,000	61,110.00
561	002430	杭氧股份	2024年01月02日	2024年01月02日	29.21	2,000	58,420.00
562	000878	云南铜业	2024年01月02日	2024年01月02日	10.89	5,200	56,628.00
563	000983	山西焦煤	2024年01月02日	2024年01月08日	9.88	5,700	56,316.00
564	002466	天齐锂业	2024年01月10日	2024年01月10日	55.79	1,000	55,790.00
565	002472	双环传动	2024年01月02日	2024年01月02日	26.02	2,100	54,642.00
566	688538	和辉光电	2024年01月02日	2024年01月10日	2.43	22,100	53,703.00

			日	日				
567	000930	中粮科技	2024年01月08日	-	2024年01月08日	6.64	8,000	53,120.00
568	300558	贝达药业	2024年01月08日	-	2024年01月08日	51.55	1,000	51,550.00
569	600170	上海建工	2024年01月02日	-	2024年01月02日	2.34	21,200	49,608.00
570	600885	宏发股份	2024年01月08日	-	2024年01月08日	27.64	1,600	44,224.00
571	300009	安科生物	2024年01月02日	-	2024年01月02日	10.22	4,200	42,924.00
572	601211	国泰君安	2024年01月02日	-	2024年01月02日	14.88	2,700	40,176.00
573	600583	海油工程	2024年01月10日	-	2024年01月10日	5.94	6,200	36,828.00
574	600329	达仁堂	2024年01月08日	-	2024年01月08日	33.65	1,000	33,650.00
575	603568	伟明环保	2024年01月02日	-	2024年01月02日	16.00	2,100	33,600.00
576	600582	天地科技	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.44	5,800	31,552.00
577	601991	大唐发电	2024年01月02日	-	2024年01月02日	2.42	11,400	27,588.00

			日	日				
578	601098	中南传媒	2024年01月02日	-	2024年01月02日	10.17	2,500	25,425.00
579	600196	复星医药	2024年01月02日	-	2024年01月02日	25.03	1,000	25,030.00
580	601699	潞安环能	2024年01月02日	-	2024年01月02日	21.91	1,100	24,101.00
581	600873	梅花生物	2024年01月03日	-	2024年01月03日	9.55	2,500	23,875.00
582	600848	上海临港	2024年01月02日	-	2024年01月02日	10.05	1,800	18,090.00
583	600739	辽宁成大	2024年01月02日	-	2024年01月02日	11.78	1,500	17,670.00
584	600549	厦门钨业	2024年01月03日	-	2024年01月03日	17.18	1,000	17,180.00
585	000932	华菱钢铁	2024年01月02日	-	2024年01月02日	5.15	3,100	15,965.00
586	688779	长远锂科	2024年01月02日	-	2024年01月02日	7.30	2,000	14,600.00
587	601899	紫金矿业	2024年01月03日	-	2024年01月03日	12.46	1,000	12,460.00
588	600867	通化东宝	2024年01月10日	-	2024年01月10日	10.83	1,000	10,830.00

			日	日				
589	600004	白云机场	2024年01月02日	2024年01月02日	-	9.78	1,000	9,780.00
590	000039	中集集团	2024年01月02日	2024年01月02日	-	7.65	1,200	9,180.00
591	601665	齐鲁银行	2024年01月08日	2024年01月08日	-	3.91	2,000	7,820.00
592	600642	申能股份	2024年01月02日	2024年01月02日	-	6.42	1,000	6,420.00
593	000967	盈峰环境	2024年01月03日	2024年01月03日	-	4.75	1,000	4,750.00
合计	-	-	-	-	-	-	29,396,610	307,161,599.00

注：出借证券中如有其它流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 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	31,664,606.54	-	-	-	-	-	31,664,606.54
结算备付金	20,496,024.86	-	-	-	-	-	20,496,024.86
存出保证金	2,932,451.90	-	-	-	-	8,286,021.60	11,218,473.50
交易性金融 融资	-	-	123,903.80	-	-	7,092,532,901.40	7,092,656,805.20

产							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-6,390.42	-	-	-	-	-	-6,390.42
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	57,357,928.62	57,357,928.62
应收股利	-	-	-	-	-	19,940.00	19,940.00
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	136,954.82	136,954.82

资产总计	55,086,692.88	-	123,903.80	-	-	7,158,333,746.44	7,213,544,343.12
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	-	-	-	-	-	19,898,301.48	19,898,301.48
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	946,482.10	946,482.10

管理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	315,494.03	315,494.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	14,095.58	14,095.58
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,253,634.63	1,253,634.63
负	-	-	-	-	-	22,428,007.82	22,428,007.82

债总计							
利率敏感度缺口	55,086,692.88	-	123,903.80	-	-	7,135,905,738.62	7,191,116,335.30
上年度末 2022 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	48,997,016.89	-	-	-	-	-	48,997,016.89
结算备付金	12,872,963.06	-	-	-	-	-	12,872,963.06
存出保证金	190,647.01	-	-	-	-	6,715,008.00	6,905,655.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,806,097,361.02	1,806,097,361.02

衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	15,120,161.65	15,120,161.65
应收股利	-	-	-	-	-	10,409.12	10,409.12
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	33,615.61	33,615.61
资	62,060,626.9	-	-	-	-	1,827,976,555.4	1,890,037,182.3

产总计	6					0	6
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	-	-	-	-	-	14,783,502.54	14,783,502.54
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管	-	-	-	-	-	240,190.34	240,190.34



理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	80,063.42	80,063.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	4,092.81	4,092.81
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	435,095.42	435,095.42
负债	-	-	-	-	-	15,542,944.53	15,542,944.53

总计							
利率敏感 度缺口	62,060,626.96	-	-	-	-	1,812,433,610.87	1,874,494,237.83

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

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

#### 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		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	7,092,532,901.40	98.63	1,806,097,361.02	96.35
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	123,903.80	0.00	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,092,656,805.20	98.63	1,806,097,361.02	96.35

#### 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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证 800 指数 上涨 5%	357,728,458.96	93,235,484.43
	中证 800 指数 下跌 5%	-357,728,458.96	-93,235,484.43

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	7,092,529,185.40	1,802,910,651.02
第二层次	123,903.80	2,172,222.40
第三层次	3,716.00	1,014,487.60
合计	7,092,656,805.20	1,806,097,361.02

###### 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

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,014,487.60	1,014,487.60
当期购买	-	38,990.00	38,990.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	518,534.00	518,534.00
转出第三层次	-	1,014,487.60	1,014,487.60
当期利得或损失总额	-	-553,808.00	-553,808.00
其中：计入损益的利得或损失	-	-553,808.00	-553,808.00
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,716.00	3,716.00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-553,808.00	-553,808.00
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	6,831,167.66	6,831,167.66
当期购买	-	1,142,364.53	1,142,364.53
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	6,831,167.66	6,831,167.66
当期利得或损失总额	-	-127,876.93	- 127,876.93
其中：计入损益的利得或损失	-	-127,876.93	- 127,876.93
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,014,487.60	1,014,487.60
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-127,876.93	- 127,876.93

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股权	3,716.00	上市公司比较法	折现率	0.2	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,014,487.60	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.1891-2.4756	负相关

#### 7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均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	7,092,532,901.40	98.32
	其中：股票	7,092,532,901.40	98.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,903.80	0.00
	其中：债券	123,903.80	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-6,390.42	0.00
	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	52,160,631.40	0.72
8	其他各项资产	68,733,296.94	0.95
9	合计	7,213,544,343.12	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 307,161,599.00 元，占期末基金资产净值比例 4.27%。此处股票投资项含可退替代款估值增值，而“报告期末按行业分类的股票投资组合”章节的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

### 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	78,729,891.84	1.09
B	采矿业	322,727,919.00	4.49
C	制造业	4,035,921,901.	56.12

		27	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	235,777,733.77	3.28
E	建筑业	122,745,480.60	1.71
F	批发和零售业	74,011,317.80	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	198,015,732.24	2.75
H	住宿和餐饮业	7,203,834.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	394,709,408.22	5.49
J	金融业	1,298,392,270.64	18.06
K	房地产业	92,164,495.00	1.28
L	租赁和商务服务业	60,520,887.98	0.84
M	科学研究和技术服务业	76,347,847.60	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	10,160,570.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,256,672.00	0.07
Q	卫生和社会工作	36,278,198.18	0.50
R	文化、体育和娱乐业	32,357,611.40	0.45
S	综合	11,203,663.00	0.16
	合计	7,092,525,434.54	98.63

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

S	综合	-	-
	合计	3,716.00	0.00

### 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	190,415	328,656,290.00	4.57
2	601318	中国平安	3,224,156	129,933,486.80	1.81
3	300750	宁德时代	788,440	128,720,714.40	1.79
4	600036	招商银行	3,707,300	103,137,086.00	1.43
5	000858	五粮液	585,161	82,103,939.91	1.14
6	000333	美的集团	1,470,961	80,358,599.43	1.12
7	601166	兴业银行	4,355,500	70,602,655.00	0.98
8	600900	长江电力	2,934,340	68,487,495.60	0.95
9	601899	紫金矿业	4,935,000	61,490,100.00	0.86
10	600276	恒瑞医药	1,336,642	60,456,317.66	0.84
11	600030	中信证券	2,925,850	59,599,564.50	0.83
12	300059	东方财富	3,803,528	53,401,533.12	0.74
13	002594	比亚迪	269,300	53,321,400.00	0.74
14	300760	迈瑞医疗	182,200	52,947,320.00	0.74
15	002475	立讯精	1,497,284	51,581,433.80	0.72



		密			
16	600887	伊利股份	1,909,200	51,071,100.00	0.71
17	601398	工商银行	10,498,500	50,182,830.00	0.70
18	601328	交通银行	8,235,000	47,268,900.00	0.66
19	603259	药明康德	613,181	44,615,049.56	0.62
20	000725	京东方A	11,229,900	43,796,610.00	0.61
21	600309	万华化学	567,000	43,556,940.00	0.61
22	000651	格力电器	1,349,440	43,411,484.80	0.60
23	601012	隆基绿能	1,797,032	41,152,032.80	0.57
24	300124	汇川技术	637,650	40,261,221.00	0.56
25	000568	泸州老窖	223,002	40,011,018.84	0.56
26	002415	海康威视	1,115,300	38,723,216.00	0.54
27	600919	江苏银行	5,499,350	36,790,651.50	0.51
28	601816	京沪高铁	7,358,300	36,202,836.00	0.50
29	601288	农业银行	9,566,400	34,821,696.00	0.48
30	002714	牧原股份	817,058	33,646,448.44	0.47
31	600809	山西汾酒	145,260	33,515,839.80	0.47
32	300498	温氏股份	1,596,040	32,016,562.40	0.45
33	600028	中国石化	5,701,600	31,814,928.00	0.44
34	688981	中芯国际	595,481	31,572,402.62	0.44
35	601088	中国神华	986,540	30,928,029.00	0.43
36	601668	中国建筑	6,278,800	30,201,028.00	0.42

37	002352	顺丰控股	735,844	29,728,097.60	0.41
38	600016	民生银行	7,434,600	27,805,404.00	0.39
39	000001	平安银行	2,907,867	27,304,871.13	0.38
40	300274	阳光电源	310,800	27,222,972.00	0.38
41	600837	海通证券	2,894,200	27,118,654.00	0.38
42	600406	国电南瑞	1,203,874	26,870,467.68	0.37
43	600941	中国移动	268,400	26,700,432.00	0.37
44	000792	盐湖股份	1,626,400	25,941,080.00	0.36
45	002230	科大讯飞	557,200	25,842,936.00	0.36
46	000063	中兴通讯	952,350	25,218,228.00	0.35
47	601988	中国银行	6,311,800	25,184,082.00	0.35
48	601728	中国电信	4,654,511	25,180,904.51	0.35
49	600050	中国联通	5,713,700	25,026,006.00	0.35
50	000625	长安汽车	1,485,392	24,999,147.36	0.35
51	600031	三一重工	1,783,600	24,560,172.00	0.34
52	601601	中国太保	1,026,200	24,403,036.00	0.34
53	601888	中国中免	290,542	24,315,459.98	0.34
54	601225	陕西煤业	1,160,400	24,240,756.00	0.34
55	000100	TCL 科技	5,625,390	24,189,177.00	0.34
56	601857	中国石油	3,400,300	24,006,118.00	0.33
57	002142	宁波银行	1,186,870	23,867,955.70	0.33
58	600690	海尔智家	1,131,200	23,755,200.00	0.33

59	603501	韦尔股份	221,042	23,587,391.82	0.33
60	600000	浦发银行	3,514,700	23,267,314.00	0.32
61	688111	金山办公	72,206	22,831,537.20	0.32
62	000338	潍柴动力	1,625,400	22,186,710.00	0.31
63	300015	爱尔眼科	1,399,449	22,139,283.18	0.31
64	300122	智飞生物	360,500	22,030,155.00	0.31
65	300308	中际旭创	193,500	21,848,085.00	0.30
66	601688	华泰证券	1,545,200	21,555,540.00	0.30
67	000002	万科A	2,039,200	21,330,032.00	0.30
68	600048	保利发展	2,148,800	21,273,120.00	0.30
69	600436	片仔癀	87,800	21,246,722.00	0.30
70	601985	中国核电	2,828,100	21,210,750.00	0.29
71	688012	中微半导体设备	136,312	20,937,523.20	0.29
72	600089	特变电工	1,512,951	20,878,723.80	0.29
73	600438	通威股份	807,200	20,204,216.00	0.28
74	601169	北京银行	4,434,700	20,089,191.00	0.28
75	601211	国泰君安	1,349,900	20,086,512.00	0.28
76	002304	洋河股份	181,000	19,891,900.00	0.28
77	002050	三花智控	670,480	19,712,112.00	0.27
78	600150	中国船舶	669,468	19,709,137.92	0.27
79	688041	海光信息	276,500	19,625,970.00	0.27
80	601766	中国中车	3,647,900	19,187,954.00	0.27

81	002027	分众传媒	3,027,100	19,131,272.00	0.27
82	600104	上汽集团	1,403,700	18,992,061.00	0.26
83	603288	海天味业	500,155	18,980,882.25	0.26
84	002371	北方华创	76,376	18,766,346.96	0.26
85	600905	三峡能源	4,289,471	18,744,988.27	0.26
86	603986	兆易创新	201,268	18,595,150.52	0.26
87	601919	中远海控	1,913,160	18,328,072.80	0.25
88	601138	工业富联	1,189,700	17,988,264.00	0.25
89	600660	福耀玻璃	479,900	17,943,461.00	0.25
90	601229	上海银行	2,976,600	17,770,302.00	0.25
91	688271	联影医疗	129,293	17,714,433.93	0.25
92	601390	中国中铁	3,080,900	17,499,512.00	0.24
93	002466	天齐锂业	309,000	17,239,110.00	0.24
94	600585	海螺水泥	720,900	16,263,504.00	0.23
95	601818	光大银行	5,570,000	16,153,000.00	0.22
96	688008	澜起科技	270,034	15,867,197.84	0.22
97	600019	宝钢股份	2,647,200	15,697,896.00	0.22
98	300014	亿纬锂能	369,083	15,575,302.60	0.22
99	300782	卓胜微	110,020	15,512,820.00	0.22
100	002129	TCL 中环	968,150	15,141,866.00	0.21
101	600999	招商证券	1,108,210	15,115,984.40	0.21
102	002241	歌尔股份	717,900	15,083,079.00	0.21

103	600893	航发动 力	402,195	15,034,049.10	0.21
104	600111	北方稀 土	762,200	14,740,948.00	0.20
105	002460	赣锋锂 业	338,980	14,508,344.00	0.20
106	601658	邮储银 行	3,322,478	14,452,779.30	0.20
107	601628	中国人 寿	498,913	14,144,183.55	0.20
108	601989	中国重 工	3,416,500	14,110,145.00	0.20
109	688036	传音控 股	101,522	14,050,644.80	0.20
110	600760	中航沈 飞	329,980	13,918,556.40	0.19
111	603019	中科曙 光	351,920	13,897,320.80	0.19
112	002049	紫光国 微	205,280	13,846,136.00	0.19
113	000661	长春高 新	94,647	13,799,532.60	0.19
114	600958	东方证 券	1,571,544	13,672,432.80	0.19
115	603799	华友钴 业	413,270	13,608,981.10	0.19
116	601600	中国铝 业	2,378,400	13,414,176.00	0.19
117	601006	大秦铁 路	1,840,604	13,270,754.84	0.18
118	000938	紫光股 份	685,760	13,269,456.00	0.18
119	000538	云南白 药	267,360	13,140,744.00	0.18
120	601939	建设银 行	2,014,300	13,113,093.00	0.18
121	600938	中国海 油	624,100	13,087,377.00	0.18
122	600570	恒生电 子	453,810	13,051,575.60	0.18
123	002252	上海莱 士	1,598,300	12,786,400.00	0.18
124	000776	广发证 券	888,900	12,702,381.00	0.18

125	600584	长电科技	424,800	12,684,528.00	0.18
126	601669	中国电建	2,584,800	12,639,672.00	0.18
127	600547	山东黄金	543,900	12,438,993.00	0.17
128	002179	中航光电	316,450	12,341,550.00	0.17
129	600009	上海机场	374,700	12,282,666.00	0.17
130	600426	华鲁恒升	442,060	12,196,435.40	0.17
131	601377	兴业证券	2,076,512	12,189,125.44	0.17
132	000166	申万宏源	2,699,600	11,986,224.00	0.17
133	000596	古井贡酒	51,400	11,965,920.00	0.17
134	300408	三环集团	405,000	11,927,250.00	0.17
135	600886	国投电力	895,400	11,801,372.00	0.16
136	000425	徐工机械	2,118,100	11,564,826.00	0.16
137	002271	东方雨虹	599,800	11,516,160.00	0.16
138	601009	南京银行	1,550,300	11,441,214.00	0.16
139	002311	海大集团	253,300	11,375,703.00	0.16
140	601916	浙商银行	4,504,000	11,350,080.00	0.16
141	300142	沃森生物	480,100	11,287,151.00	0.16
142	600085	同仁堂	207,200	11,126,640.00	0.15
143	600795	国电电力	2,667,600	11,097,216.00	0.15
144	603993	洛阳钼业	2,119,700	11,022,440.00	0.15
145	002236	大华股份	596,200	10,999,890.00	0.15
146	600588	用友网络	611,207	10,873,372.53	0.15

147	600745	闻泰科技	256,700	10,860,977.00	0.15
148	000963	华东医药	259,000	10,738,140.00	0.15
149	600015	华夏银行	1,909,100	10,729,142.00	0.15
150	600926	杭州银行	1,068,060	10,691,280.60	0.15
151	600845	宝信软件	217,861	10,631,616.80	0.15
152	300033	同花顺	67,600	10,604,412.00	0.15
153	300502	新易盛	214,600	10,584,072.00	0.15
154	601186	中国铁建	1,379,400	10,497,234.00	0.15
155	001979	招商蛇口	1,089,200	10,380,076.00	0.14
156	002422	科伦药业	354,200	10,289,510.00	0.14
157	002459	晶澳科技	496,036	10,277,865.92	0.14
158	601111	中国国航	1,395,900	10,245,906.00	0.14
159	002920	德赛西威	78,800	10,205,388.00	0.14
160	000977	浪潮信息	307,200	10,199,040.00	0.14
161	600011	华能国际	1,315,800	10,131,660.00	0.14
162	600674	川投能源	667,600	10,094,112.00	0.14
163	300896	爱美客	34,000	10,007,220.00	0.14
164	002812	恩捷股份	176,000	10,000,320.00	0.14
165	601901	方正证券	1,235,200	9,955,712.00	0.14
166	600115	中国东航	2,563,600	9,946,768.00	0.14
167	600010	包钢股份	6,801,400	9,930,044.00	0.14
168	601995	中金公司	258,900	9,851,145.00	0.14
169	600989	宝丰能源	658,000	9,718,660.00	0.14

170	000157	中联重科	1,486,000	9,703,580.00	0.13
171	601360	三六零	1,072,800	9,665,928.00	0.13
172	002028	思源电气	185,300	9,643,012.00	0.13
173	300418	昆仑万维	256,700	9,600,580.00	0.13
174	600196	复星医药	383,200	9,591,496.00	0.13
175	601689	拓普集团	130,200	9,569,700.00	0.13
176	002493	荣盛石化	913,150	9,451,102.50	0.13
177	000768	中航西飞	420,700	9,411,059.00	0.13
178	601633	长城汽车	371,662	9,373,315.64	0.13
179	600029	南方航空	1,611,000	9,279,360.00	0.13
180	688599	天合光能	324,809	9,266,800.77	0.13
181	601066	中信建投	391,600	9,265,256.00	0.13
182	603369	今世缘	188,757	9,201,903.75	0.13
183	600157	永泰能源	6,657,500	9,120,775.00	0.13
184	601788	光大证券	589,100	9,083,922.00	0.13
185	000988	华工科技	299,300	8,907,168.00	0.12
186	002463	沪电股份	402,400	8,901,088.00	0.12
187	688256	寒武纪科技	65,497	8,839,475.12	0.12
188	601058	赛轮轮胎	751,100	8,825,425.00	0.12
189	000975	银泰黄金	585,860	8,787,900.00	0.12
190	601555	东吴证券	1,200,602	8,776,400.62	0.12
191	601100	恒立液压	160,248	8,762,360.64	0.12
192	002555	三七互	462,900	8,707,149.00	0.12



		娱			
193	300316	晶盛机电	197,400	8,703,366.00	0.12
194	600489	中金黄金	872,300	8,688,108.00	0.12
195	002709	天赐材料	346,160	8,681,692.80	0.12
196	300347	泰格医药	156,500	8,602,805.00	0.12
197	300496	中科创达	107,300	8,590,438.00	0.12
198	002601	龙佰集团	499,900	8,563,287.00	0.12
199	688126	上海硅产业集团	492,796	8,535,226.72	0.12
200	600079	人福医药	342,400	8,512,064.00	0.12
201	600418	江淮汽车	524,100	8,464,215.00	0.12
202	300661	圣邦股份	94,495	8,410,999.95	0.12
203	002340	格林美	1,538,900	8,402,394.00	0.12
204	300450	先导智能	327,900	8,394,240.00	0.12
205	603392	万泰生物	111,078	8,345,290.14	0.12
206	600346	恒力石化	630,300	8,301,051.00	0.12
207	000895	双汇发展	310,002	8,280,153.42	0.12
208	600188	兖矿能源	416,200	8,244,922.00	0.11
209	601168	西部矿业	574,100	8,192,407.00	0.11
210	601868	中国能建	3,884,965	8,158,426.50	0.11
211	601800	中国交建	1,066,800	8,107,680.00	0.11
212	301236	软通动力	171,200	7,909,440.00	0.11
213	601336	新华保险	254,065	7,909,043.45	0.11

214	000933	神火股份	470,200	7,899,360.00	0.11
215	601699	潞安环能	359,400	7,874,454.00	0.11
216	300433	蓝思科技	593,100	7,828,920.00	0.11
217	002001	新和成	460,688	7,813,268.48	0.11
218	002821	凯莱英	66,896	7,766,625.60	0.11
219	600161	天坛生物	250,772	7,758,885.68	0.11
220	600600	青岛啤酒	103,025	7,701,118.75	0.11
221	600372	中航机载	583,537	7,691,017.66	0.11
222	600741	华域汽车	470,400	7,658,112.00	0.11
223	601233	桐昆股份	505,400	7,646,702.00	0.11
224	300759	康龙化成	263,400	7,633,332.00	0.11
225	600515	海南机场	2,050,733	7,587,712.10	0.11
226	000301	东方盛虹	789,400	7,578,240.00	0.11
227	601077	渝农商行	1,853,800	7,563,504.00	0.11
228	601108	财通证券	971,580	7,539,460.80	0.10
229	002384	东山精密	413,200	7,511,976.00	0.10
230	000630	铜陵有色	2,280,400	7,479,712.00	0.10
231	002648	卫星化学	504,340	7,439,015.00	0.10
232	300037	新宙邦	156,600	7,407,180.00	0.10
233	601881	中国银河	613,500	7,392,675.00	0.10
234	002736	国信证券	864,600	7,383,684.00	0.10
235	003816	中国广核	2,355,600	7,325,916.00	0.10
236	002156	通富微	316,200	7,310,544.00	0.10

		电			
237	601021	春秋航空	145,400	7,299,080.00	0.10
238	002007	华兰生物	328,120	7,261,295.60	0.10
239	301269	华大九天	68,300	7,229,555.00	0.10
240	000009	中国宝安	615,100	7,221,274.00	0.10
241	002517	恺英网络	641,900	7,170,023.00	0.10
242	300394	天孚通信	78,300	7,166,016.00	0.10
243	300012	华测检测	503,900	7,155,380.00	0.10
244	002966	苏州银行	1,102,570	7,122,602.20	0.10
245	600176	中国巨石	721,523	7,092,571.09	0.10
246	600109	国金证券	777,600	7,060,608.00	0.10
247	000786	北新建材	301,900	7,052,384.00	0.10
248	600885	宏发股份	254,034	7,021,499.76	0.10
249	688169	石头科技	24,809	7,019,706.55	0.10
250	601117	中国化学	1,102,200	7,009,992.00	0.10
251	600988	赤峰黄金	497,900	6,975,579.00	0.10
252	601877	正泰电器	320,951	6,903,656.01	0.10
253	002410	广联达	401,930	6,889,080.20	0.10
254	002074	国轩高科	318,700	6,852,050.00	0.10
255	601615	明阳智能	546,200	6,849,348.00	0.10
256	300136	信维通信	287,400	6,782,640.00	0.09
257	000983	山西焦煤	680,300	6,721,364.00	0.09
258	600160	巨化股	407,600	6,721,324.00	0.09

		份			
259	688072	拓荆科技	28,985	6,704,230.50	0.09
260	688122	西部超导	125,796	6,696,121.08	0.09
261	002465	海格通信	521,000	6,694,850.00	0.09
262	002180	纳思达	294,900	6,673,587.00	0.09
263	688396	华润微电子	149,207	6,668,060.83	0.09
264	000733	振华科技	113,100	6,654,804.00	0.09
265	002625	光启技术	449,000	6,636,220.00	0.09
266	002138	顺络电子	245,100	6,620,151.00	0.09
267	002202	金风科技	826,100	6,608,800.00	0.09
268	000423	东阿阿胶	133,300	6,574,356.00	0.09
269	688099	晶晨半导体	104,757	6,560,930.91	0.09
270	600536	中国软件	180,425	6,542,210.50	0.09
271	300207	欣旺达	443,200	6,541,632.00	0.09
272	601618	中国中冶	2,135,800	6,535,548.00	0.09
273	002185	华天科技	766,500	6,530,580.00	0.09
274	600352	浙江龙盛	776,200	6,520,080.00	0.09
275	002738	中矿资源	173,740	6,482,239.40	0.09
276	601838	成都银行	574,500	6,468,870.00	0.09
277	600183	生益科技	352,820	6,460,134.20	0.09
278	600298	安琪酵母	182,800	6,430,904.00	0.09
279	601162	天风证券	2,078,860	6,423,677.40	0.09
280	300003	乐普医疗	397,088	6,416,942.08	0.09

281	000932	华菱钢铁	1,244,600	6,409,690.00	0.09
282	000876	新希望	681,000	6,346,920.00	0.09
283	600233	圆通速递	515,900	6,340,411.00	0.09
284	002223	鱼跃医疗	180,700	6,248,606.00	0.09
285	000783	长江证券	1,158,200	6,231,116.00	0.09
286	600219	南山铝业	2,108,000	6,197,520.00	0.09
287	002439	启明星辰	228,900	6,180,300.00	0.09
288	300144	宋城演艺	625,120	6,169,934.40	0.09
289	002078	太阳纸业	502,000	6,109,340.00	0.08
290	601878	浙商证券	584,600	6,097,378.00	0.08
291	000408	藏格矿业	240,000	6,081,600.00	0.08
292	600332	白云山	212,600	6,080,360.00	0.08
293	000723	美锦能源	910,100	6,061,266.00	0.08
294	600096	云天化	386,900	6,035,640.00	0.08
295	603596	伯特利	87,000	6,029,100.00	0.08
296	603939	益丰药房	150,464	6,024,578.56	0.08
297	600415	小商品城	820,100	6,003,132.00	0.08
298	300999	金龙鱼	179,100	5,978,358.00	0.08
299	300568	星源材质	386,100	5,953,662.00	0.08
300	000066	中国长城	583,500	5,905,020.00	0.08
301	002385	大北农	989,800	5,899,208.00	0.08
302	600482	中国动力	326,900	5,887,469.00	0.08
303	601799	星宇股份	44,900	5,886,839.00	0.08
304	600765	中航重机	307,160	5,869,827.60	0.08

305	600873	梅花生物	614,200	5,865,610.00	0.08
306	300724	捷佳伟创	79,200	5,861,592.00	0.08
307	002603	以岭药业	254,000	5,859,780.00	0.08
308	600839	四川长虹	1,107,500	5,858,675.00	0.08
309	002532	天山铝业	973,100	5,848,331.00	0.08
310	002797	第一创业	1,006,500	5,847,765.00	0.08
311	601238	广汽集团	663,400	5,804,750.00	0.08
312	600460	士兰微	253,400	5,785,122.00	0.08
313	002756	永兴材料	110,210	5,754,064.10	0.08
314	000999	华润三九	115,700	5,753,761.00	0.08
315	300017	网宿科技	732,600	5,750,910.00	0.08
316	601872	招商轮船	973,660	5,725,120.80	0.08
317	600918	中泰证券	834,300	5,723,298.00	0.08
318	600732	爱旭股份	324,080	5,716,771.20	0.08
319	300413	芒果超媒	226,800	5,715,360.00	0.08
320	002273	水晶光电	420,600	5,694,924.00	0.08
321	002600	领益智造	839,300	5,673,668.00	0.08
322	300751	迈为股份	43,796	5,672,019.96	0.08
323	002841	视源股份	123,900	5,669,664.00	0.08
324	300395	菲利华	155,000	5,666,800.00	0.08
325	300866	安克创新	63,920	5,663,312.00	0.08
326	600155	华创云信	676,900	5,645,346.00	0.08
327	300285	国瓷材	244,100	5,643,592.00	0.08

		料			
328	600862	中航高科	254,600	5,639,390.00	0.08
329	688114	华大智造	65,188	5,607,471.76	0.08
330	002044	美年健康	928,200	5,578,482.00	0.08
331	601607	上海医药	333,300	5,576,109.00	0.08
332	688120	华海清科	29,583	5,552,729.10	0.08
333	600023	浙能电力	1,204,400	5,552,284.00	0.08
334	600362	江西铜业	309,400	5,525,884.00	0.08
335	300601	康泰生物	202,320	5,492,988.00	0.08
336	688303	大全能源	185,513	5,485,619.41	0.08
337	300474	景嘉微	77,500	5,480,025.00	0.08
338	603806	福斯特	224,483	5,448,202.41	0.08
339	002294	信立泰	166,800	5,447,688.00	0.08
340	600177	雅戈尔	831,100	5,443,705.00	0.08
341	600497	驰宏锌锗	1,070,000	5,403,500.00	0.08
342	603160	汇顶科技	78,000	5,389,800.00	0.07
343	300058	蓝色光标	748,600	5,374,948.00	0.07
344	002472	双环传动	205,300	5,341,906.00	0.07
345	000728	国元证券	781,130	5,335,117.90	0.07
346	601898	中煤能源	550,200	5,331,438.00	0.07
347	688180	君实生物	127,400	5,329,142.00	0.07
348	300223	北京君正	82,400	5,327,160.00	0.07
349	002008	大族激光	256,400	5,312,608.00	0.07
350	600066	宇通客车	400,859	5,311,381.75	0.07

351	000831	中国稀 土	191,800	5,307,106.00	0.07
352	600129	太极集 团	114,000	5,296,440.00	0.07
353	600348	华阳股 份	541,900	5,288,944.00	0.07
354	601990	南京证 券	661,800	5,281,164.00	0.07
355	603659	璞泰来	252,050	5,275,406.50	0.07
356	688223	晶科能 源	595,116	5,272,727.76	0.07
357	002195	岩山科 技	1,715,800	5,267,506.00	0.07
358	600699	均胜电 子	293,200	5,265,872.00	0.07
359	603260	合盛硅 业	103,100	5,258,100.00	0.07
360	002607	中公教 育	1,288,400	5,256,672.00	0.07
361	601128	常熟银 行	819,700	5,237,883.00	0.07
362	688301	奕瑞科 技股份	16,030	5,213,917.80	0.07
363	002353	杰瑞股 份	184,700	5,191,917.00	0.07
364	002739	万达电 影	398,200	5,184,564.00	0.07
365	300146	汤臣倍 健	304,000	5,177,120.00	0.07
366	603606	东方电 缆	121,100	5,177,025.00	0.07
367	600061	国投资 本	765,996	5,162,813.04	0.07
368	600546	山煤国 际	294,800	5,161,948.00	0.07
369	000893	亚钾国 际	196,100	5,145,664.00	0.07
370	601696	中银证 券	498,800	5,132,652.00	0.07
371	603816	顾家家 居	146,600	5,131,000.00	0.07
372	600529	山东药 玻	200,200	5,125,120.00	0.07



373	002673	西部证 券	801,104	5,103,032.48	0.07
374	300454	深信服	70,200	5,074,758.00	0.07
375	603882	金域医 学	80,000	5,005,600.00	0.07
376	600060	海信视 像	238,300	4,980,470.00	0.07
377	688390	固德威 电源	38,078	4,972,225.24	0.07
378	688002	睿创微 纳	112,435	4,971,875.70	0.07
379	601577	长沙银 行	725,000	4,944,500.00	0.07
380	300088	长信科 技	738,200	4,938,558.00	0.07
381	603688	石英股 份	56,800	4,934,784.00	0.07
382	000997	新大 陆	251,400	4,929,954.00	0.07
383	002262	恩华药 业	181,500	4,922,280.00	0.07
384	002444	巨星科 技	218,400	4,918,368.00	0.07
385	600985	淮北矿 业	295,200	4,909,176.00	0.07
386	600499	科达制 造	464,600	4,901,530.00	0.07
387	300604	长川科 技	128,800	4,893,112.00	0.07
388	601998	中信银 行	922,600	4,880,554.00	0.07
389	600369	西南证 券	1,193,200	4,880,188.00	0.07
390	603290	斯达半 导	26,900	4,868,900.00	0.07
391	600875	东方电 气	332,600	4,862,612.00	0.07
392	002624	完美世 界	410,150	4,856,176.00	0.07
393	601666	平煤股 份	419,900	4,854,044.00	0.07
394	601198	东兴证 券	584,700	4,812,081.00	0.07

395	300919	中伟股份	96,900	4,760,697.00	0.07
396	300118	东方日升	269,700	4,760,205.00	0.07
397	603589	口子窖	104,800	4,747,440.00	0.07
398	000400	许继电气	215,900	4,741,164.00	0.07
399	600642	申能股份	735,700	4,723,194.00	0.07
400	688521	芯原微电子	94,305	4,711,477.80	0.07
401	002938	鹏鼎控股	210,500	4,698,360.00	0.07
402	300763	锦浪科技	67,000	4,683,300.00	0.07
403	688728	格科微有限公司	228,100	4,669,207.00	0.06
404	600025	华能水电	540,700	4,666,241.00	0.06
405	688188	上海柏楚电子科技	18,422	4,662,792.42	0.06
406	300699	光威复材	174,580	4,656,048.60	0.06
407	002558	巨人网络	417,100	4,646,494.00	0.06
408	600803	新奥股份	275,400	4,632,228.00	0.06
409	688220	翱捷科技	65,715	4,628,964.60	0.06
410	603000	人民网	165,400	4,627,892.00	0.06
411	000878	云南铜业	424,100	4,618,449.00	0.06
412	601319	中国人保	953,378	4,614,349.52	0.06
413	002131	利欧股份	2,022,800	4,611,984.00	0.06
414	600884	杉杉股份	338,300	4,607,646.00	0.06
415	605499	东鹏饮料	25,200	4,599,252.00	0.06
416	600637	东方明珠	610,430	4,590,433.60	0.06

417	600879	航天电子	595,000	4,587,450.00	0.06
418	000683	远兴能源	781,100	4,585,057.00	0.06
419	600118	中国卫星	177,500	4,583,050.00	0.06
420	002152	广电运通	373,600	4,580,336.00	0.06
421	002916	深南电路	64,500	4,578,855.00	0.06
422	600399	抚顺特钢	470,800	4,576,176.00	0.06
423	000069	华侨城 A	1,471,100	4,575,121.00	0.06
424	000629	钒钛股份	1,393,900	4,571,992.00	0.06
425	600867	通化东宝	422,104	4,571,386.32	0.06
426	000591	太阳能	818,300	4,566,114.00	0.06
427	601865	福莱特	170,606	4,555,180.20	0.06
428	300073	当升科技	119,000	4,545,800.00	0.06
429	002409	雅克科技	81,400	4,536,422.00	0.06
430	600895	张江高科	235,023	4,535,943.90	0.06
431	605117	德业股份	54,060	4,535,634.00	0.06
432	600535	天士力	266,100	4,529,022.00	0.06
433	002497	雅化集团	345,500	4,522,595.00	0.06
434	601997	贵阳银行	877,538	4,510,545.32	0.06
435	300001	特锐德	224,000	4,502,400.00	0.06
436	000021	深科技	277,536	4,498,858.56	0.06
437	600132	重庆啤酒	67,700	4,498,665.00	0.06
438	600143	金发科技	562,800	4,496,772.00	0.06
439	300390	天华新能	175,880	4,458,558.00	0.06
440	688052	纳芯微电子	26,719	4,458,065.15	0.06

441	300628	亿联网络	150,500	4,447,275.00	0.06
442	000998	隆平高科	314,400	4,433,040.00	0.06
443	605358	立昂微	161,800	4,431,702.00	0.06
444	300024	机器人	373,100	4,428,697.00	0.06
445	002240	盛新锂能	194,500	4,424,875.00	0.06
446	600516	方大炭素	844,020	4,422,664.80	0.06
447	000703	恒逸石化	658,010	4,421,827.20	0.06
448	603077	和邦生物	1,851,100	4,368,596.00	0.06
449	600416	湘电股份	274,700	4,362,236.00	0.06
450	600170	上海建工	1,862,000	4,357,080.00	0.06
451	603712	七一二	137,200	4,323,172.00	0.06
452	600549	厦门钨业	251,400	4,319,052.00	0.06
453	600392	盛和资源	424,200	4,318,356.00	0.06
454	002407	多氟多	283,380	4,313,043.60	0.06
455	600141	兴发集团	236,200	4,310,650.00	0.06
456	600486	扬农化工	68,210	4,305,415.20	0.06
457	600153	建发股份	447,000	4,304,610.00	0.06
458	601966	玲珑轮胎	223,200	4,292,136.00	0.06
459	688772	珠海冠宇电池	194,775	4,286,997.75	0.06
460	002432	九安医疗	113,500	4,275,545.00	0.06
461	002430	杭氧股份	146,300	4,273,423.00	0.06
462	000039	中集集团	553,900	4,237,335.00	0.06
463	000708	中信特钢	300,500	4,219,020.00	0.06
464	000960	锡业股	293,600	4,204,352.00	0.06

		份			
465	300748	金力永磁	206,960	4,184,731.20	0.06
466	000623	吉林敖东	275,700	4,174,098.00	0.06
467	300383	光环新网	426,900	4,149,468.00	0.06
468	002065	东华软件	671,800	4,145,006.00	0.06
469	600704	物产中大	935,500	4,144,265.00	0.06
470	600998	九州通	589,441	4,131,981.41	0.06
471	600909	华安证券	843,570	4,116,621.60	0.06
472	000617	中油资本	761,500	4,112,100.00	0.06
473	600018	上港集团	836,400	4,098,360.00	0.06
474	601717	郑煤机	321,500	4,066,975.00	0.06
475	603899	晨光股份	108,100	4,059,155.00	0.06
476	000750	国海证券	1,145,790	4,056,096.60	0.06
477	688363	华熙生物	60,579	4,054,552.47	0.06
478	600754	锦江酒店	135,300	4,045,470.00	0.06
479	688065	凯赛生物	73,400	4,035,532.00	0.06
480	689009	九号公司	135,900	4,030,794.00	0.06
481	300212	易华录	128,020	4,026,229.00	0.06
482	603195	公牛集团	42,020	4,019,213.00	0.06
483	002203	海亮股份	359,000	4,002,850.00	0.06
484	603833	欧派家居	57,420	3,997,006.20	0.06
485	002064	华峰化学	595,600	3,996,476.00	0.06
486	002268	电科网安	177,700	3,991,142.00	0.06
487	600673	东阳光	543,300	3,982,389.00	0.06

488	000738	航发控制	198,300	3,946,170.00	0.05
489	600166	福田汽车	1,442,100	3,936,933.00	0.05
490	000050	深天马 A	369,500	3,935,175.00	0.05
491	600563	法拉电子	42,400	3,926,240.00	0.05
492	600583	海油工程	660,600	3,923,964.00	0.05
493	600039	四川路桥	523,240	3,919,067.60	0.05
494	603456	九洲药业	161,300	3,905,073.00	0.05
495	601456	国联证券	358,700	3,888,308.00	0.05
496	002299	圣农发展	226,100	3,884,398.00	0.05
497	002939	长城证券	482,100	3,856,800.00	0.05
498	600521	华海药业	262,800	3,855,276.00	0.05
499	600859	王府井	241,400	3,855,158.00	0.05
500	002568	百润股份	156,600	3,853,926.00	0.05
501	002506	协鑫集成	1,404,400	3,848,056.00	0.05
502	600398	海澜之家	518,000	3,843,560.00	0.05
503	600863	内蒙华电	975,600	3,804,840.00	0.05
504	002368	太极股份	128,799	3,803,434.47	0.05
505	600820	隧道股份	658,300	3,791,808.00	0.05
506	002429	兆驰股份	678,000	3,783,240.00	0.05
507	002128	电投能源	265,100	3,782,977.00	0.05
508	601216	君正集团	1,010,100	3,777,774.00	0.05
509	002092	中泰化学	617,800	3,768,580.00	0.05

510	300487	蓝晓科技	71,000	3,767,260.00	0.05
511	600739	辽宁成大	319,800	3,767,244.00	0.05
512	000513	丽珠集团	107,400	3,760,074.00	0.05
513	000636	风华高科	274,196	3,745,517.36	0.05
514	002414	高德红外	511,811	3,736,220.30	0.05
515	002025	航天电器	77,800	3,735,956.00	0.05
516	603658	安图生物	65,350	3,725,603.50	0.05
517	002373	千方科技	330,900	3,709,389.00	0.05
518	300253	卫宁健康	515,000	3,702,850.00	0.05
519	300114	中航电测	84,300	3,688,125.00	0.05
520	000729	燕京啤酒	426,400	3,679,832.00	0.05
521	600435	北方导航	312,900	3,673,446.00	0.05
522	688536	思瑞浦股份	25,002	3,657,792.60	0.05
523	002926	华西证券	470,000	3,647,200.00	0.05
524	600655	豫园股份	587,200	3,646,512.00	0.05
525	603338	浙江鼎力	71,240	3,645,350.80	0.05
526	688005	容百科技	91,338	3,635,252.40	0.05
527	300558	贝达药业	70,500	3,634,275.00	0.05
528	300957	贝泰妮	53,300	3,633,461.00	0.05
529	300595	欧普康视	160,860	3,632,218.80	0.05
530	300296	利亚德	602,600	3,615,600.00	0.05
531	600021	上海电力	426,030	3,604,213.80	0.05
532	300009	安科生	352,240	3,599,892.80	0.05

		物			
533	002850	科达利	42,400	3,581,104.00	0.05
534	600498	烽火通信	215,200	3,580,928.00	0.05
535	000519	中兵红箭	254,500	3,573,180.00	0.05
536	600325	华发股份	493,900	3,561,019.00	0.05
537	688234	天岳先进	53,868	3,559,058.76	0.05
538	300244	迪安诊断	149,300	3,554,833.00	0.05
539	300251	光线传媒	435,700	3,550,955.00	0.05
540	600008	首创环保	1,317,490	3,544,048.10	0.05
541	600271	航天信息	332,700	3,539,928.00	0.05
542	002192	融捷股份	65,300	3,539,913.00	0.05
543	002507	涪陵榨菜	245,520	3,508,480.80	0.05
544	002372	伟星新材	241,900	3,500,293.00	0.05
545	002595	豪迈科技	117,400	3,494,998.00	0.05
546	688032	禾迈股份	12,937	3,492,990.00	0.05
547	688063	派能科技	32,912	3,488,672.00	0.05
548	601016	节能风电	1,162,550	3,487,650.00	0.05
549	688567	孚能科技	213,007	3,474,144.17	0.05
550	000877	天山股份	519,500	3,470,260.00	0.05
551	600004	白云机场	354,800	3,469,944.00	0.05
552	002500	山西证券	643,580	3,468,896.20	0.05
553	000830	鲁西化工	344,700	3,457,341.00	0.05
554	688331	荣昌生	55,675	3,455,190.50	0.05



		物			
555	688561	奇安信集团	86,155	3,453,953.95	0.05
556	300373	扬杰科技	93,700	3,438,790.00	0.05
557	600380	健康元	276,100	3,431,923.00	0.05
558	600282	南钢股份	927,300	3,431,010.00	0.05
559	002936	郑州银行	1,694,597	3,406,139.97	0.05
560	600566	济川药业	107,507	3,378,945.01	0.05
561	000060	中金岭南	780,500	3,371,760.00	0.05
562	603233	大参林	134,820	3,357,018.00	0.05
563	002056	横店东磁	247,300	3,348,442.00	0.05
564	300676	华大基因	69,700	3,345,600.00	0.05
565	603893	瑞芯微	52,600	3,334,840.00	0.05
566	603444	吉比特	13,600	3,333,632.00	0.05
567	002281	光迅科技	116,600	3,323,100.00	0.05
568	002865	钧达股份	42,700	3,308,396.00	0.05
569	601698	中国卫通	190,800	3,302,748.00	0.05
570	002019	亿帆医药	222,900	3,294,462.00	0.05
571	603225	新凤鸣	232,000	3,294,400.00	0.05
572	601636	旗滨集团	481,000	3,290,040.00	0.05
573	601880	辽港股份	2,258,700	3,275,115.00	0.05
574	300682	朗新科技	198,500	3,253,415.00	0.05
575	600038	中直股份	84,300	3,248,079.00	0.05
576	002670	国盛金控	348,200	3,245,224.00	0.05
577	300070	碧水源	650,000	3,243,500.00	0.05
578	601236	红塔证券	427,060	3,241,385.40	0.05

579	688385	复旦微电	83,750	3,235,262.50	0.04
580	002080	中材科技	202,600	3,225,392.00	0.04
581	000547	航天发展	385,200	3,224,124.00	0.04
582	002120	韵达股份	430,570	3,212,052.20	0.04
583	603156	养元饮品	150,732	3,204,562.32	0.04
584	688516	奥特维科技	35,359	3,199,989.50	0.04
585	300529	健帆生物	143,900	3,198,897.00	0.04
586	600580	卧龙电驱	271,800	3,188,214.00	0.04
587	300677	英科医疗	135,940	3,175,558.40	0.04
588	600258	首旅酒店	202,200	3,158,364.00	0.04
589	603737	三棵树	66,280	3,155,590.80	0.04
590	600511	国药股份	110,200	3,153,924.00	0.04
591	600390	五矿资本	673,100	3,150,108.00	0.04
592	603885	吉祥航空	261,600	3,139,200.00	0.04
593	688200	华峰测控	25,537	3,135,943.60	0.04
594	601000	唐山港	889,500	3,113,250.00	0.04
595	603927	中科软	103,600	3,105,928.00	0.04
596	002531	天顺风能	265,700	3,082,120.00	0.04
597	601933	永辉超市	1,089,600	3,072,672.00	0.04
598	002572	索菲亚	192,400	3,068,780.00	0.04
599	002508	老板电器	140,800	3,066,624.00	0.04
600	300026	红日药业	722,000	3,061,280.00	0.04
601	000598	兴蓉环境	538,000	3,061,220.00	0.04
602	601155	新城控	267,500	3,052,175.00	0.04

		股			
603	002958	青农商行	1,163,800	3,049,156.00	0.04
604	002557	洽洽食品	87,200	3,036,304.00	0.04
605	688538	和辉光电	1,248,356	3,033,505.08	0.04
606	601231	环旭电子	200,000	3,022,000.00	0.04
607	601179	中国西电	611,000	3,012,230.00	0.04
608	601778	晶科科技	855,700	2,994,950.00	0.04
609	000970	中科三环	289,010	2,991,253.50	0.04
610	002831	裕同科技	108,600	2,987,586.00	0.04
611	002487	大金重工	111,900	2,978,778.00	0.04
612	688187	时代电气	81,947	2,977,134.51	0.04
613	603517	绝味食品	110,700	2,973,402.00	0.04
614	000155	川能动力	223,600	2,971,644.00	0.04
615	000887	中鼎股份	239,900	2,967,563.00	0.04
616	600970	中材国际	315,500	2,946,770.00	0.04
617	600906	财达证券	391,300	2,934,750.00	0.04
618	600606	绿地控股	1,264,975	2,909,442.50	0.04
619	300438	鹏辉能源	102,400	2,896,896.00	0.04
620	600707	彩虹股份	427,900	2,888,325.00	0.04
621	688082	盛美上海半导体	27,443	2,865,323.63	0.04
622	600848	上海临港	284,200	2,856,210.00	0.04
623	688029	南微医学科技	29,505	2,856,084.00	0.04

624	600481	双良节能	336,100	2,843,406.00	0.04
625	002155	湖南黄金	254,400	2,834,016.00	0.04
626	600959	江苏有线	901,000	2,829,140.00	0.04
627	002030	达安基因	292,032	2,826,869.76	0.04
628	603858	步长制药	165,500	2,815,155.00	0.04
629	600995	南网储能	284,400	2,804,184.00	0.04
630	000563	陕国投A	922,400	2,804,096.00	0.04
631	000027	深圳能源	434,100	2,799,945.00	0.04
632	600755	厦门国贸	399,000	2,781,030.00	0.04
633	601866	中远海发	1,186,100	2,775,474.00	0.04
634	600977	中国电影	226,200	2,768,688.00	0.04
635	600208	新湖中宝	1,273,000	2,762,410.00	0.04
636	000778	新兴铸管	719,000	2,746,580.00	0.04
637	603185	弘元绿能	82,362	2,741,007.36	0.04
638	600131	国网信通	180,600	2,736,090.00	0.04
639	600329	达仁堂	81,200	2,732,380.00	0.04
640	002244	滨江集团	374,500	2,722,615.00	0.04
641	000739	普洛药业	176,900	2,722,491.00	0.04
642	601958	金钼股份	287,500	2,716,875.00	0.04
643	000987	越秀资本	448,005	2,696,990.10	0.04
644	600582	天地科技	495,200	2,693,888.00	0.04
645	600373	中文传媒	204,300	2,692,674.00	0.04

646	601991	大唐发电	1,111,500	2,689,830.00	0.04
647	002032	苏泊尔	50,700	2,687,607.00	0.04
648	600316	洪都航空	126,900	2,686,473.00	0.04
649	601665	齐鲁银行	686,500	2,684,215.00	0.04
650	002683	广东宏大	132,800	2,666,624.00	0.04
651	002266	浙富控股	782,300	2,659,820.00	0.04
652	603486	科沃斯	64,100	2,656,304.00	0.04
653	000709	河钢股份	1,241,100	2,643,543.00	0.04
654	600737	中粮糖业	319,400	2,631,856.00	0.04
655	603127	昭衍新药	110,624	2,622,895.04	0.04
656	300357	我武生物	90,400	2,621,600.00	0.04
657	603826	坤彩科技	44,100	2,603,223.00	0.04
658	601808	中海油服	177,700	2,597,974.00	0.04
659	300776	帝尔激光	42,900	2,585,154.00	0.04
660	600598	北大荒	215,100	2,574,747.00	0.04
661	002326	永太科技	221,400	2,572,668.00	0.04
662	603267	鸿远电子	51,100	2,565,220.00	0.04
663	000825	太钢不锈	685,500	2,556,915.00	0.04
664	600056	中国医药	226,767	2,532,987.39	0.04
665	600801	华新水泥	202,900	2,522,047.00	0.04
666	601611	中国核建	362,800	2,514,204.00	0.03
667	300979	华利集团	47,700	2,510,928.00	0.03
668	603883	老百姓	83,596	2,498,684.44	0.03

669	000785	居然之家	757,000	2,498,100.00	0.03
670	000883	湖北能源	590,000	2,495,700.00	0.03
671	600528	中铁工业	332,400	2,473,056.00	0.03
672	300888	稳健医疗	66,380	2,472,655.00	0.03
673	601598	中国外运	470,500	2,465,420.00	0.03
674	600901	江苏金租	508,280	2,460,075.20	0.03
675	600517	国网英大	514,100	2,452,257.00	0.03
676	603568	伟明环保	152,375	2,438,000.00	0.03
677	002511	中顺洁柔	243,300	2,433,000.00	0.03
678	002153	石基信息	249,157	2,426,789.18	0.03
679	601992	金隅集团	1,252,020	2,391,358.20	0.03
680	600500	中化国际	539,044	2,382,574.48	0.03
681	300363	博腾股份	94,600	2,379,190.00	0.03
682	003035	南网能源	451,100	2,372,786.00	0.03
683	600378	昊华科技	77,600	2,365,248.00	0.03
684	601106	中国一重	819,894	2,361,294.72	0.03
685	603026	胜华新材	51,000	2,338,860.00	0.03
686	000800	一汽解放	274,800	2,335,800.00	0.03
687	603379	三美股份	68,400	2,325,600.00	0.03
688	600827	百联股份	243,800	2,313,662.00	0.03
689	600062	华润双鹤	122,400	2,276,640.00	0.03
690	688520	神州细胞集团	42,000	2,262,540.00	0.03

		公司			
691	000937	冀中能源	316,500	2,259,810.00	0.03
692	600871	石化油服	1,221,000	2,234,430.00	0.03
693	002653	海思科	96,500	2,233,975.00	0.03
694	000581	威孚高科	148,200	2,233,374.00	0.03
695	603650	彤程新材	66,800	2,224,440.00	0.03
696	001227	兰州银行	853,300	2,218,580.00	0.03
697	601098	中南传媒	217,500	2,211,975.00	0.03
698	002408	齐翔腾达	416,580	2,199,542.40	0.03
699	603228	景旺电子	97,480	2,199,148.80	0.03
700	600022	山东钢铁	1,598,200	2,189,534.00	0.03
701	601118	海南橡胶	512,900	2,174,696.00	0.03
702	600126	杭钢股份	407,900	2,174,107.00	0.03
703	688349	三一重能	75,604	2,163,786.48	0.03
704	603707	健友股份	144,052	2,160,780.00	0.03
705	003022	联泓新科	117,400	2,149,594.00	0.03
706	603305	旭升集团	108,800	2,146,624.00	0.03
707	688276	长春百克生物科技	38,940	2,134,301.40	0.03
708	688778	厦钨新能源	52,900	2,096,956.00	0.03
709	600967	内蒙一机	253,200	2,091,432.00	0.03
710	688779	长远锂科	286,420	2,090,866.00	0.03
711	601156	东航物流	141,300	2,088,414.00	0.03

712	600315	上海家化	97,900	2,073,522.00	0.03
713	000559	万向钱潮	398,700	2,069,253.00	0.03
714	601928	凤凰传媒	231,600	2,040,396.00	0.03
715	000401	冀东水泥	317,500	2,028,825.00	0.03
716	688208	道通科技	85,200	2,023,500.00	0.03
717	000156	华数传媒	274,500	2,023,065.00	0.03
718	601187	厦门银行	398,000	2,017,860.00	0.03
719	600764	中国海防	80,800	2,015,960.00	0.03
720	002690	美亚光电	102,562	2,014,317.68	0.03
721	601608	中信重工	520,500	2,009,130.00	0.03
722	600663	陆家嘴	225,000	1,968,750.00	0.03
723	600808	马钢股份	722,700	1,965,744.00	0.03
724	000089	深圳机场	305,600	1,965,008.00	0.03
725	002867	周大生	129,400	1,964,292.00	0.03
726	002010	传化智联	420,800	1,944,096.00	0.03
727	001286	陕西能源	227,200	1,942,560.00	0.03
728	600095	湘财股份	254,000	1,907,540.00	0.03
729	603218	日月股份	153,700	1,901,269.00	0.03
730	000958	电投产融	482,500	1,901,050.00	0.03
731	688425	铁建重工	477,200	1,894,484.00	0.03
732	603866	桃李面包	243,088	1,862,054.08	0.03
733	300257	开山股份	116,600	1,837,616.00	0.03
734	000930	中粮科	276,300	1,834,632.00	0.03



		技			
735	002505	鹏都农牧	1,143,600	1,829,760.00	0.03
736	603529	爱玛科技	72,900	1,825,416.00	0.03
737	002423	中粮资本	272,900	1,822,972.00	0.03
738	000967	盈峰环境	383,000	1,819,250.00	0.03
739	600597	光明乳业	208,300	1,818,459.00	0.03
740	002468	申通快递	232,200	1,808,838.00	0.03
741	002518	科士达	65,400	1,805,040.00	0.03
742	000898	鞍钢股份	719,800	1,792,302.00	0.02
743	002925	盈趣科技	89,790	1,748,211.30	0.02
744	600968	海油发展	605,500	1,725,675.00	0.02
745	601568	北元集团	357,840	1,696,161.60	0.02
746	601059	信达证券	93,400	1,680,266.00	0.02
747	002761	浙江建投	161,600	1,658,016.00	0.02
748	000537	中绿电	167,300	1,611,099.00	0.02
749	000959	首钢股份	464,900	1,608,554.00	0.02
750	600167	联美控股	270,900	1,536,003.00	0.02
751	600339	中油工程	501,400	1,519,242.00	0.02
752	600377	宁沪高速	147,500	1,511,875.00	0.02
753	002608	江苏国信	229,200	1,505,844.00	0.02
754	001914	招商积余	124,900	1,493,804.00	0.02
755	688387	中信科移动	197,800	1,426,138.00	0.02
756	600350	山东高速	204,600	1,419,924.00	0.02

757	002563	森马服饰	245,700	1,417,689.00	0.02
758	601228	广州港	448,900	1,405,057.00	0.02
759	001203	大中矿业	133,800	1,360,746.00	0.02
760	600928	西安银行	402,400	1,339,992.00	0.02
761	601298	青岛港	212,000	1,310,160.00	0.02
762	600927	永安期货	83,100	1,305,501.00	0.02
763	000402	金融街	359,100	1,303,533.00	0.02
764	000539	粤电力 A	262,700	1,284,603.00	0.02
765	002399	海普瑞	109,200	1,280,916.00	0.02
766	603056	德邦股份	88,400	1,279,148.00	0.02
767	600925	苏能股份	229,600	1,265,096.00	0.02
768	601828	美凯龙	324,000	1,253,880.00	0.02
769	603317	天味食品	92,100	1,224,009.00	0.02
770	601139	深圳燃气	172,500	1,188,525.00	0.02
771	002945	华林证券	76,500	1,155,150.00	0.02
772	000031	大悦城	387,500	1,150,875.00	0.02
773	601061	中信金属	145,400	1,121,034.00	0.02
774	001872	招商港口	64,500	1,029,420.00	0.01
775	601158	重庆水务	172,700	979,209.00	0.01
776	600299	安迪苏	118,100	944,800.00	0.01
777	000553	安道麦 A	128,500	891,790.00	0.01
778	600956	新天绿能	102,300	831,699.00	0.01
779	600032	浙江新能	12,000	96,720.00	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	400174	中天3	371,600	3,716.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	197,907,238.97	10.56
2	000858	五粮液	122,353,535.44	6.53
3	000333	美的集团	99,871,294.85	5.33
4	002594	比亚迪	99,272,488.12	5.30
5	300059	东方财富	71,925,435.17	3.84
6	300760	迈瑞医疗	65,862,575.46	3.51
7	002415	海康威视	58,947,506.59	3.14
8	000651	格力电器	57,950,506.61	3.09
9	002475	立讯精密	56,420,224.13	3.01
10	000725	京东方A	53,523,704.00	2.86
11	002371	北方华创	53,484,892.81	2.85
12	000568	泸州老窖	51,496,346.63	2.75
13	300124	汇川技术	47,203,405.26	2.52
14	002714	牧原股份	41,405,406.02	2.21
15	000001	平安银行	40,204,752.88	2.14
16	000063	中兴通讯	39,255,202.66	2.09
17	300274	阳光电源	39,134,405.44	2.09
18	002142	宁波银行	38,040,925.00	2.03
19	002352	顺丰控股	36,407,123.64	1.94
20	000792	盐湖股份	35,626,344.50	1.90

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	300750	宁德时代	58,557,455.12	3.12
2	002594	比亚迪	47,683,945.55	2.54
3	000858	五粮液	47,554,848.45	2.54
4	600519	贵州茅台	41,212,230.00	2.20
5	002371	北方华创	37,868,374.00	2.02
6	000333	美的集团	36,513,556.34	1.95
7	002415	海康威视	31,795,530.00	1.70
8	601318	中国平安	30,685,729.42	1.64
9	300059	东方财富	25,882,982.72	1.38
10	600436	片仔癀	25,510,444.00	1.36
11	300760	迈瑞医疗	25,218,211.70	1.35
12	002475	立讯精密	21,433,325.28	1.14
13	000651	格力电器	20,537,991.00	1.10
14	002920	德赛西威	20,189,079.12	1.08
15	000725	京东方 A	19,629,067.00	1.05
16	000661	长春高新	19,275,580.77	1.03
17	002821	凯莱英	19,131,598.40	1.02
18	600036	招商银行	18,660,155.00	1.00
19	688777	中控技术	16,764,097.84	0.89
20	300782	卓胜微	15,556,155.77	0.83

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	4,667,524,644.84
卖出股票收入（成交）总额	2,684,617,432.83

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	123,903.80	0.00

8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	123,903.80	0.00

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127102	浙建转债	1,239	123,903.80	0.00

### 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

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

### 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、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	11,218,473.50
2	应收清算款	57,357,928.62
3	应收股利	19,940.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	136,954.82
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,733,296.94

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	273,150.00	0.00	转融通出借流通受限
2	601318	中国平安	270,010.00	0.00	转融通出借流通受限
3	601899	紫金矿业	12,460.00	0.00	转融通出借流通受限

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	400174	中天3	3,716.00	0.00	重大事项停牌

## § 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

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		平安银行股份有限公司-汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
7,119	1,147,202.87	7,912,323,688.00	96.88	254,613,510.00	3.12	84,814,400.00	1.04

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中央汇金资产管理有限责任公司	1,307,627,911.00	16.01
2	汇添富基金-中国人寿保险股份有限公司-分红险-汇添富基金国寿股份成长股票型组合	653,525,000.00	8.00
3	汇添富基金-中国人寿保险股份有限公司-传统险-汇添富国寿股份成长股票传统可供出	531,680,400.00	6.51
4	汇添富基金-中国人寿保险股份	492,440,200.00	6.03

	有限公司一分红 险—汇添富基金 国寿股份均衡股 票型组合		
5	中国平安人寿保 险股份有限公司 一分红一个险分 红	389,128,600.00	4.76
6	中国人寿保险股 份有限公司	380,684,600.00	4.66
7	大家人寿保险股 份有限公司—传 统产品	369,700,300.00	4.53
8	北京诚通金控投 资有限公司	355,928,300.00	4.36
9	中荷人寿保险有 限公司	337,495,600.00	4.13
10	安邦人寿保险股 份有限公司—保 守型投资组合	296,000,000.00	3.62
11	平安银行股份有 限公司—汇添富 中证 800 交易型 开放式指数证券 投资基金联接基 金	84,814,400.00	1.04

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	200,000.00	0.00

### 9.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0



## 9.5 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

基金合同生效日（2019年10月08日） 基金份额总额	6,601,437,198.00
本报告期期初基金份额总额	1,745,437,198.00
本报告期基金总申购份额	8,639,750,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,218,250,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	8,166,937,198.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，无涉及本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（2019年10月08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 70,000.00 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
中泰证券	1	4,568,120,522.06	62.17	1,515,046.55	44.61	
东方证券	2	2,006,059,466.38	27.30	1,474,877.63	43.43	
海通证券	2	773,572,622.08	10.53	406,404.15	11.97	
广发证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
兴业证券	3	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	

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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
---	------	--------	------	------

商名称	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 (%)
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	866,020.78	78.69	-	-	-	-	-	-
海通 证券	234,505.96	21.31	50,000,000.00	100.00	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 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 1 家证券公司的 1 个交易单元：中信建投证券（北交所单元）。

## 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	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	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 01 月 20 日
2	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	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 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	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 04 月 21 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关	中证报, 上交所, 公	2023 年 06 月 17 日

	于旗下部分基金估值调整情况的公告	司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国金证券为申购赎回代理券商的公告	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 07 月 05 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华福证券为申购赎回代理券商的公告	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 07 月 14 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第二季度报告	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 07 月 21 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 15 日
10	关于汇添富基金管理股份有限公司运用固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
11	关于中证 800 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 25 日
12	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2023 年 8 月 28 日更新)	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 28 日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年中期报告	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 08 月 31 日
14	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
15	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
16	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金收益分配公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 18 日
17	关于中证 800 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 13 日

18	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2023 年 10 月 16 日更新）	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 16 日
19	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 10 月 20 日
20	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
21	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
22	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加浙商证券为申购赎回代理券商的公告	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 11 月 29 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 9 月 13 日	1,307,627,911.00	-	-	1,307,627,911.00	16.01
产品特有风险							

**1、持有人大会投票权集中的风险**

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

**2、基金规模较小导致的风险**

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

**3、提前终止基金合同的风险**

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

**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、中国证监会批准中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内中证 800 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

**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](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 03 月 29 日