

汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金(原 汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资 基金)2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

自 2023 年 04 月 25 日起，汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金转型为汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金。本报告中，汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 04 月 24 日止，汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的报告期自 2023 年 04 月 25 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	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	7
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）	8
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）	9
3.2 基金净值表现（转型后）	11
3.2 基金净值表现（转型前）	14
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）	18
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）	18
§ 4 管理人报告	18
4.1 基金管理人及基金经理情况	18
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	33
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	33
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	35
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	36
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	37
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	38
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	38
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	38
§ 5 托管人报告	38
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	38
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	39
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	39
§ 6 审计报告（转型后）	39
6.1 审计报告的基本信息	39
6.2 审计报告的基本内容	39
§ 6 审计报告（转型前）	41
6.1 审计报告的基本信息	41
6.2 审计报告的基本内容	41
§ 7 年度财务报表（转型后）	43

7.1 资产负债表	43
7.2 利润表	44
7.3 净资产变动表	45
7.4 报表附注	46
§ 7 年度财务报表（转型前）	77
7.1 资产负债表	77
7.2 利润表	78
7.3 净资产变动表	79
7.4 报表附注	81
§ 8 投资组合报告（转型后）	124
8.1 期末基金资产组合情况	124
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	125
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	126
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	152
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	154
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	154
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	154
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	154
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	154
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	155
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	155
8.12 投资组合报告附注	155
§ 8 投资组合报告（转型前）	156
8.1 期末基金资产组合情况	156
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	156
8.3 期末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	157
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	173
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	178
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	178
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	179
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	179
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	179
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	179
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	179
8.12 投资组合报告附注	179
§ 9 基金份额持有人信息（转型后）	180
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	180
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	180
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	181
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	181
§ 9 基金份额持有人信息（转型前）	181
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	181

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	182
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	182
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	182
§ 10 开放式基金份额变动（转型后）	182
§ 10 开放式基金份额变动（转型前）	183
§ 11 重大事件揭示	183
11.1 基金份额持有人大会决议.....	183
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	184
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	184
11.4 基金投资策略的改变	184
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	184
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.....	184
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	184
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	188
11.8 其他重大事件（转型后）	193
11.8 其他重大事件（转型前）	194
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	195
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	195
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	196
§ 13 备查文件目录	196
13.1 备查文件目录	196
13.2 存放地点	196
13.3 查阅方式.....	196

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富中证 500 指数增强	
基金主代码	001050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 04 月 25 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	2,217,454,257.62	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	001050	016854
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	1,711,900,483.18	505,553,774.44

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金	
基金简称	添富成长多因子股票	
基金主代码	001050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 02 月 16 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	1,999,698,721.68	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票 C
下属分级基金的交易代码	001050	016854
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	1,515,240,799.06	484,457,922.62

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不得超过 8%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；股票投资策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；可转债及可交换债投资策略；股指期货投资策略；股票期权投资策略；融资及转融通证券出借业务投资策略；国债期货投资策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于成长型行业的股票，采用基金管理人的金融工程团队开发的多因子量化策略进行选股。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与业绩比较基准指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越业绩比较基准收益率的投资目标。本基金在股票投资过程中将坚持量化模型驱动的投资决策流程，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，力争基金资产长期稳定增值。本基金的投资策略主要包括：行业配置策略、多因子量化选股策略、资产配置策略、债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*90%+活期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798

注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	李文	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路 728 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日	
	汇添富中证 500 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-113,067,650.82	-37,176,431.89
本期利润	-84,273,317.42	-23,722,135.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0514	-0.0462
本期加权平均净值利润率	-3.45%	-3.11%
本期基金份额净值增长率	-2.86%	-3.14%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
期末可供分配利润	597,528,859.50	172,433,235.02
期末可供分配基金份额利润	0.3490	0.3411
期末基金资产净值	2,502,603,556.74	735,009,273.04
期末基金份额净值	1.4619	1.4539

3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
基金份额累计净值增长率	-2.86%	-3.14%

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

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

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

4、本基金的《基金合同》生效日为 2023 年 04 月 25 日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2023 年 12 月 31 日数据，特此说明。

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 01 月 01 日-2023 年 04 月 24 日		2022 年		2021 年	
	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票 C	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票 C	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票 C
本期已实现收益	57,234,437.42	8,764,542.60	105,205,645.89	-693.61	114,844,137.20	0.00
本期利润	-22,995,964.59	-17,717,274.33	-141,958,346.66	-1,757.11	121,421,559.18	0.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0268	-0.1084	-0.2997	-0.0710	0.2800	0.0000

本期加权平均净利润率	-1.59%	-6.74%	-16.84%	-4.09%	14.96%	0.00%
本期基金份额净值增长率	3.11%	2.99%	-13.90%	1.55%	17.59%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年 04 月 24 日		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	630,031,222.80	199,412,445.26	278,257,062.24	37,681.05	472,522,521.98	0.00
期末可供分配基金份额利润	0.4158	0.4116	0.5993	0.5975	0.8173	0.0000
期末基金资产净值	2,280,360,124.81	727,080,940.60	793,381,837.00	107,645.52	1,147,727,382.67	0.00
期末基金份额净值	1.505	1.501	1.709	1.707	1.985	0.000
3.1.3 累计期末指标	2023 年 04 月 24 日		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值	76.21%	4.59%	70.90%	1.55%	98.50%	0.00%

增长率						
-----	--	--	--	--	--	--

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。

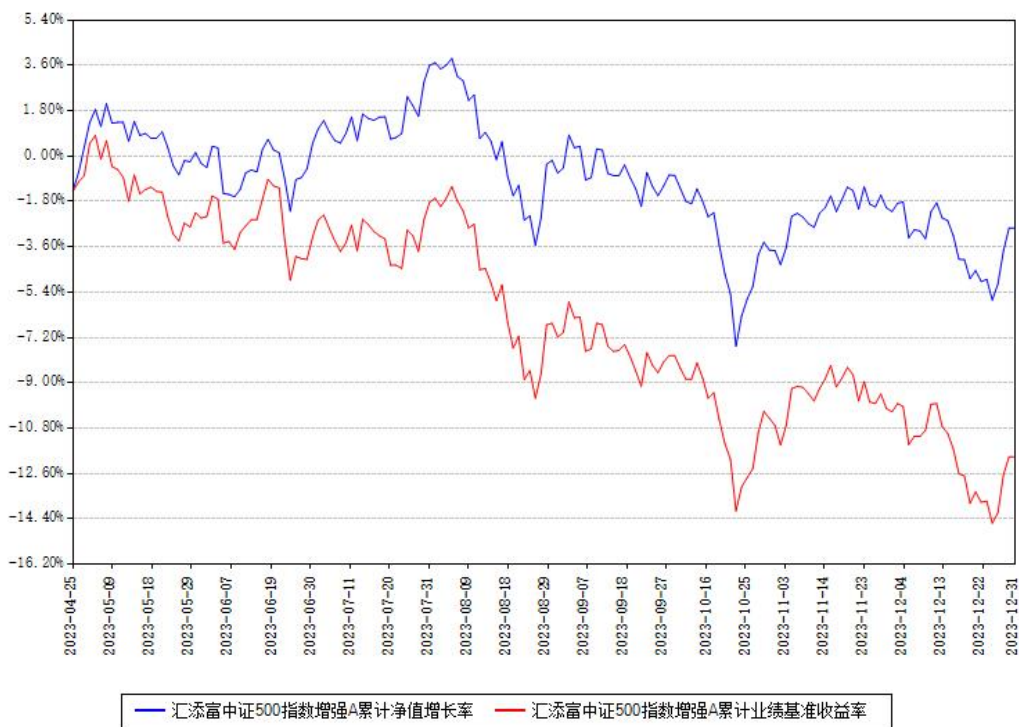
3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

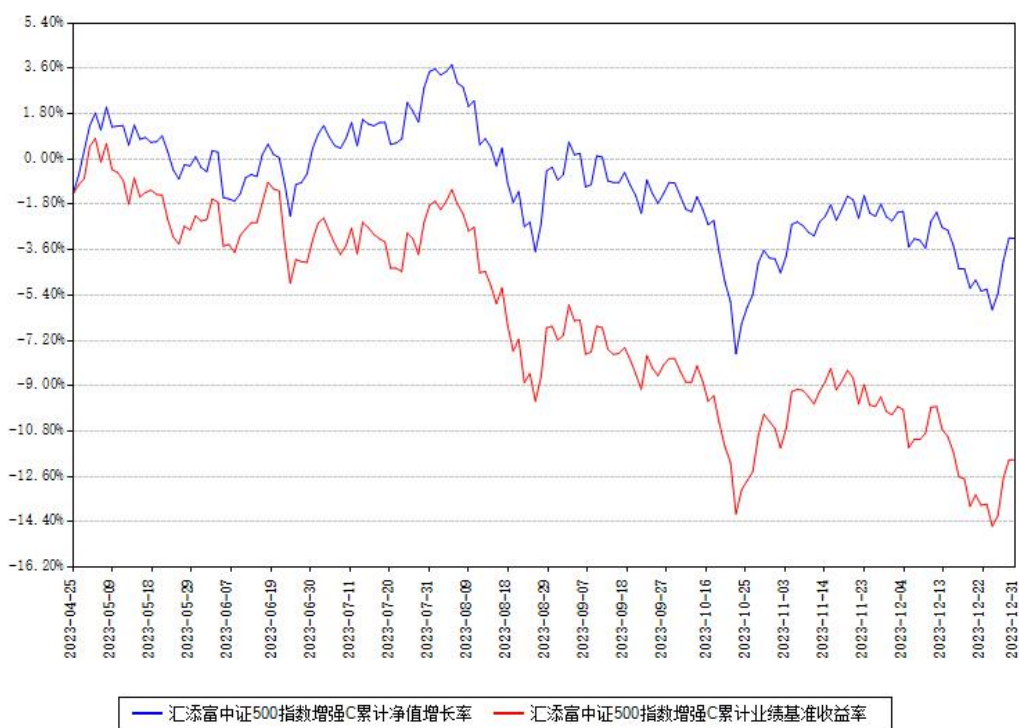
汇添富中证 500 指数增强 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.12%	0.73%	-4.36%	0.82%	2.24%	-0.09%
过去六个月	-3.35%	0.74%	-9.01%	0.81%	5.66%	-0.07%
自基金合同生效日起至今	-2.86%	0.72%	-11.93%	0.80%	9.07%	-0.08%
汇添富中证 500 指数增强 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.22%	0.73%	-4.36%	0.82%	2.14%	-0.09%
过去六个月	-3.54%	0.74%	-9.01%	0.81%	5.47%	-0.07%
自基金合同生效日起至今	-3.14%	0.72%	-11.93%	0.80%	8.79%	-0.08%

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

汇添富中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



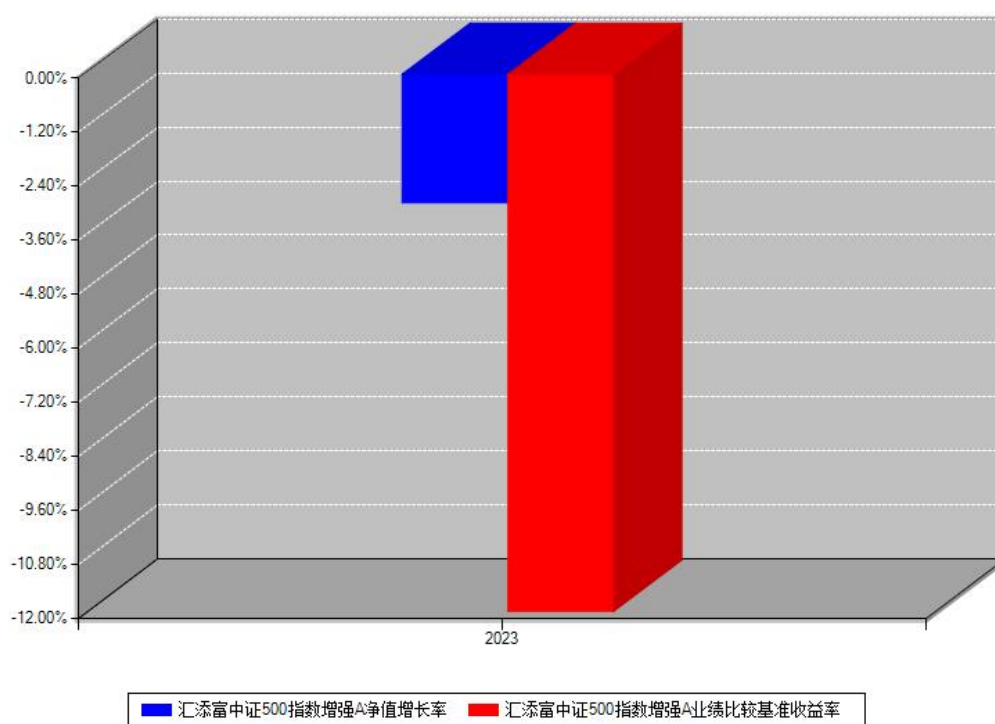
注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 04 月 25 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

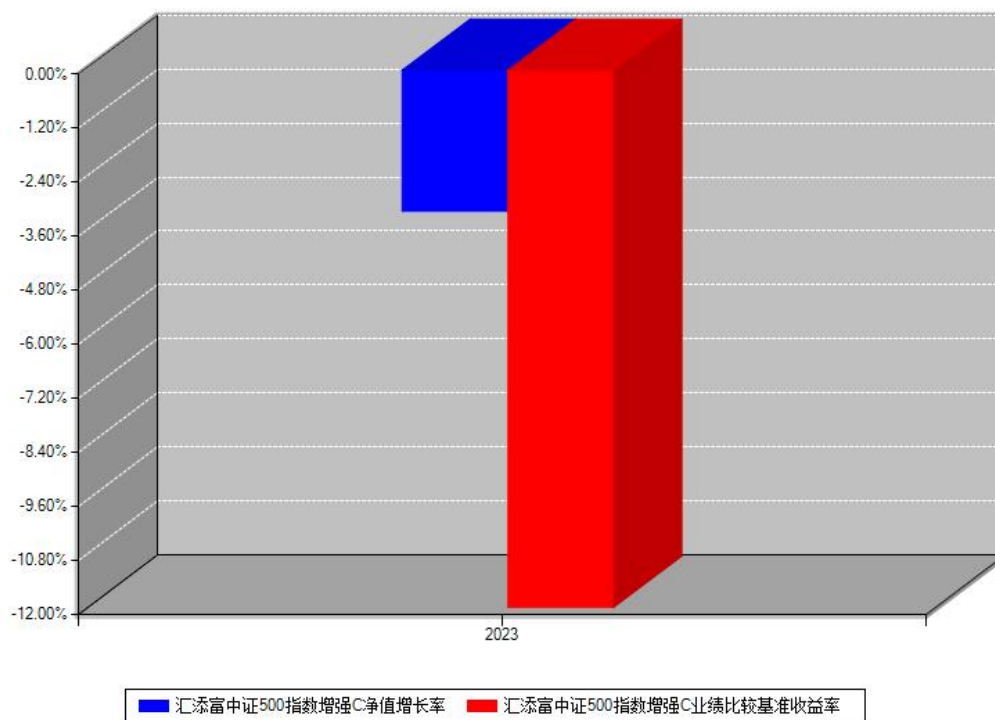
本基金由原汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金于 2023 年 04 月 25 日转型而来。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证500指数增强A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数增强C每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为2023年04月25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。

3.2 基金净值表现（转型前）

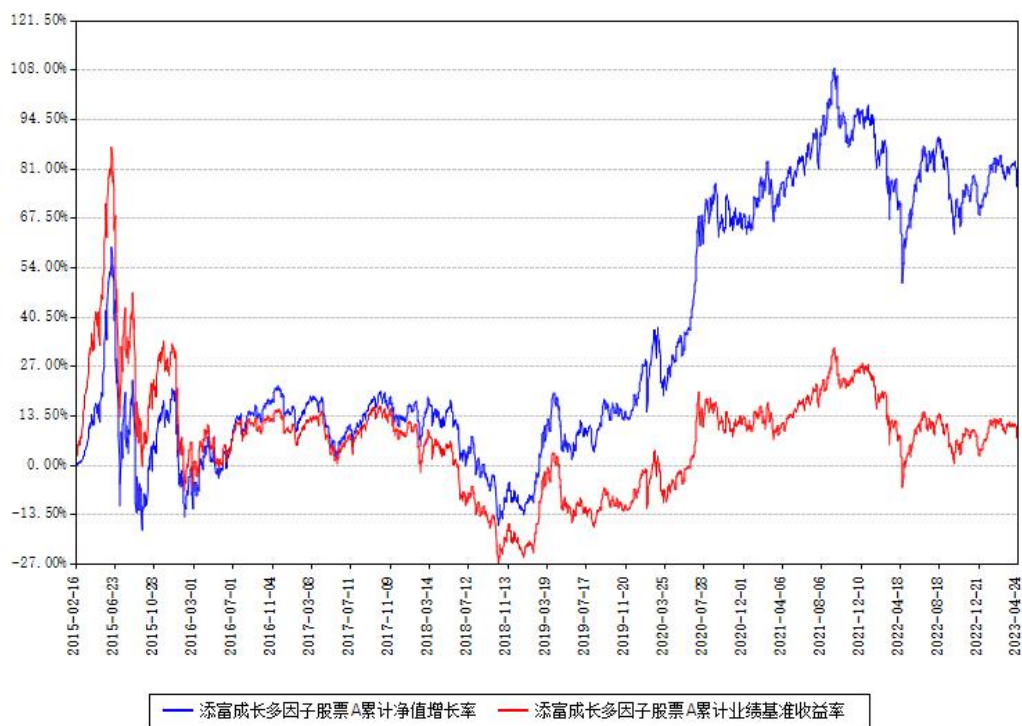
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

添富成长多因子股票 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自 2023-02-01 至 2023-04-24	-2.21%	0.68%	-1.13%	0.72%	-1.08%	-0.04%
自 2022-11-01 至 2023-04-24	5.83%	0.72%	6.26%	0.72%	-0.43%	0.00%
自 2022-05-01 至 2023-04-24	9.93%	0.93%	9.41%	0.93%	0.52%	0.00%
自 2020-05-01 至 2023-04-24	34.82%	1.11%	14.92%	1.08%	19.90%	0.03%
自 2018-05-01 至 2023-04-24	58.47%	1.26%	6.63%	1.24%	51.84%	0.02%
自 2015-02-16 至 2023-04-24	76.21%	1.58%	9.85%	1.48%	66.36%	0.10%

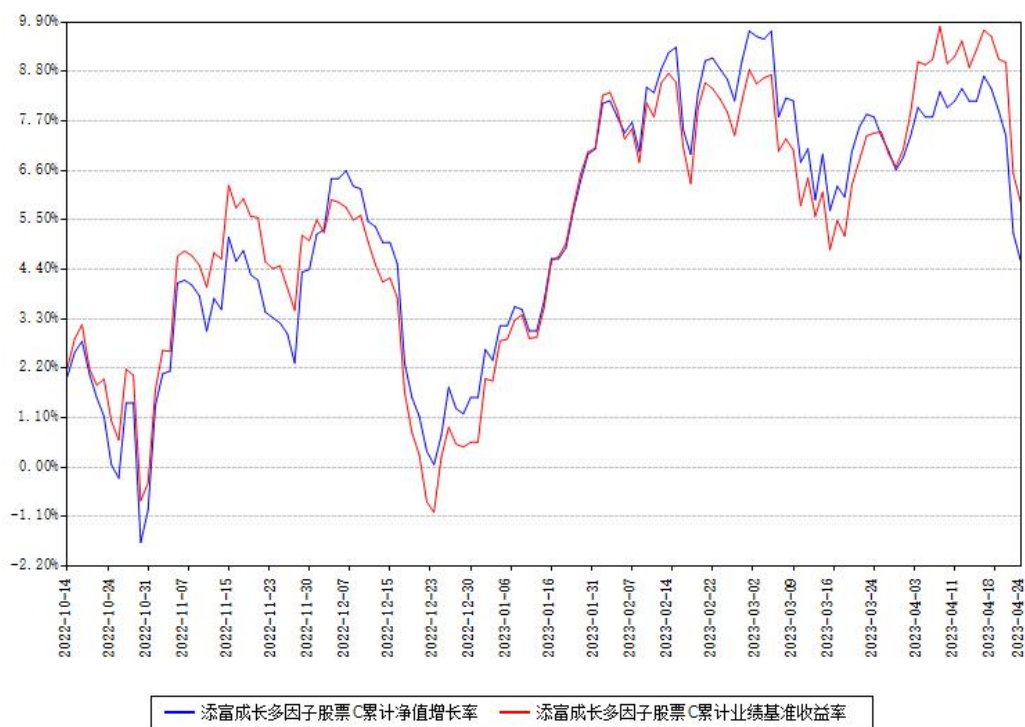
添富成长多因子股票 C						
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
自 2023-02-01 至 2023-04-24	-2.33%	0.68%	-1.13%	0.72%	-1.20%	-0.04%
自 2022-11-01 至 2023-04-24	5.59%	0.72%	6.26%	0.72%	-0.67%	0.00%
自 2022-10-14 至 2023-04-24	4.59%	0.78%	5.89%	0.78%	-1.30%	0.00%

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

添富成长多因子股票A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富成长多因子股票C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



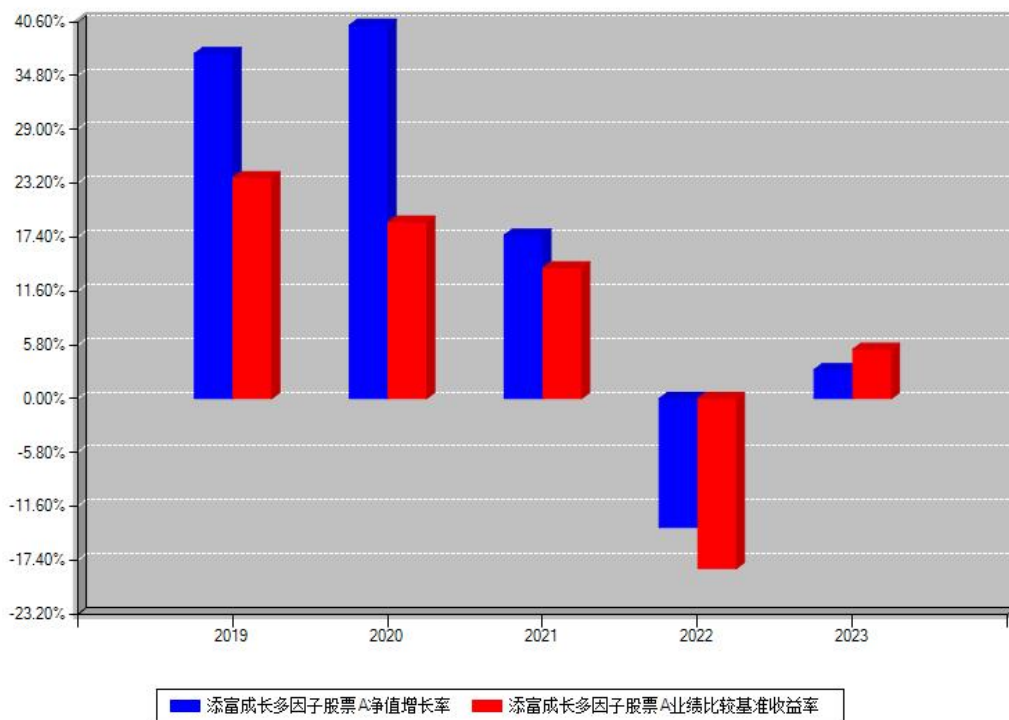
注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2015年02月16日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

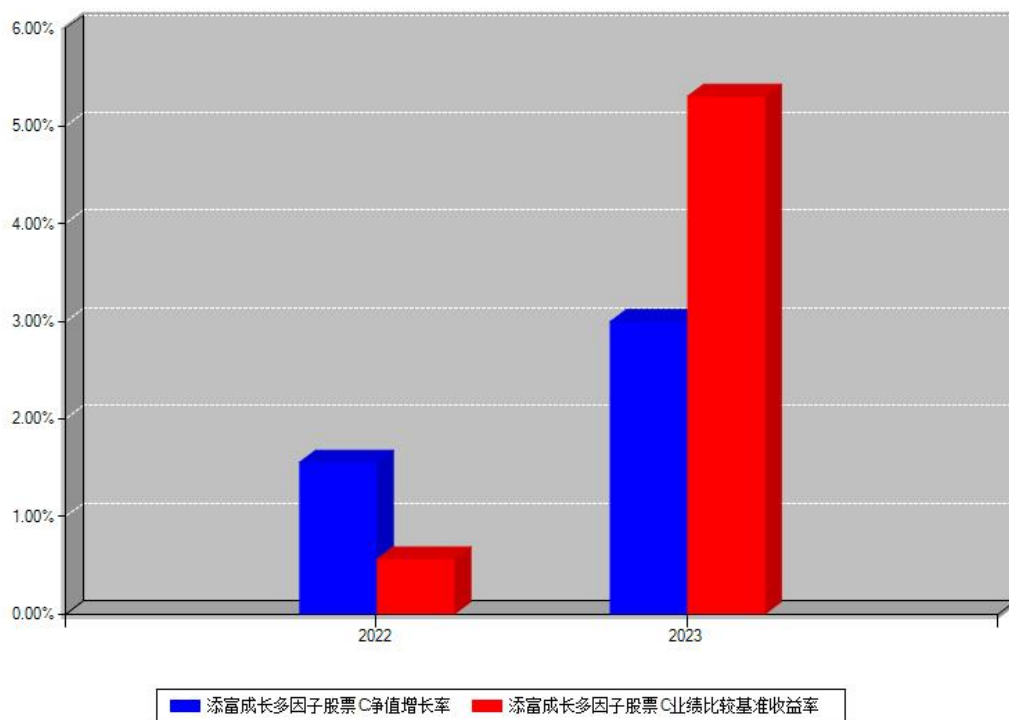
本基金于2022年10月12日新增C类份额。

3.2.3 过去五年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

添富成长多因子股票A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富成长多因子股票C每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2015 年 02 月 16 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（转型后）

注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 04 月 25 日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

单位：人民币元

添富成长多因子股票 A					
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	本期利润分配合计	备注
2023 年	2.650	315,005,418.95	77,016,244.78	392,021,663.73	-
2022 年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2021 年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
合计	2.650	315,005,418.95	77,016,244.78	392,021,663.73	-
添富成长多因子股票 C					
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	本期利润分配合计	备注
2023 年	2.650	119,184,095.27	7,316,649.01	126,500,744.28	-
2022 年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2021 年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
合计	2.650	119,184,095.27	7,316,649.01	126,500,744.28	-

§ 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 场公益活动，约 300 名党员、员工、客户与合作伙伴成为公益志愿者，相继回访了四川美姑、贵州黎平、云南怒江、青海互助、内蒙扎兰屯、宁夏泾源、广西百色、湖北恩施、湖南城步等中西部的添富小学，开展学校调研、梦想课堂、学生走访。在上海成功举办“河流·孩子”十五周年公益音乐会及艺术夏令营，帮助来自大山深处、偏远河畔的孩子们开阔眼界、增长见识、提升素养；举办第十六期“河流·孩子”乡村优秀青年

教师培训，赋能了 80 位乡村优秀青年教师，助力乡村教师掌握先进的教育理念与教学方法。金融慈善方面，积极探索创新公益新模式，在中国基金业协会的指导和支持下，举办第二期、第三期“基业上善”慈善资产管理研修营，三期累计已为 87 家基金会培养了 190 名慈善资产管理专业人才，涵盖的慈善资产规模超过 148 亿元，用专业力量推动我国公益慈善事业的可持续发展。参与中国慈善联合会《慈善组织投资管理指南》团体标准起草，助力慈善资产管理的规范化和高质量发展。爱国拥军方面，携手上海市拥军优属基金会开展“崇敬英雄”公益项目，成为“爱国拥军支持单位”，进一步服务国防建设及拥军优属事业。社区公益方面，携手小东门街道开展南外滩健康直通车项目，参与小东门社区公益发展专项基金，支持本地社区建设，共建更有温度的美好社区。乡村振兴方面，参加云南、青海、内蒙古等地产业、教育和养老助老帮扶等项目，深化东西部协作帮扶，助力乡村振兴。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2023 年 04 月 25 日	-	17	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，

				<p>现任指数与量化投资部副总监。</p> <p>2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资</p>
--	--	--	--	--

				<p>资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金</p>
--	--	--	--	---

				<p>(LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。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。2022 年</p>
--	--	--	--	--

				<p>1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至今任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 22 日至今任汇添富上证综合交易型开放式指数证券</p>
--	--	--	--	---

					投资基金的基金经理。
许一尊	本基金的基金经理	2023 年 04 月 25 日	-	13	<p>国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 2 日至今任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至今任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证</p>

					<p>800 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 7 月 19 日至今任汇添富中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 11 月 14 日至今任汇添富稳荣回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。</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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限 （年）	说明
		任职日期	离任日期		
许一尊	本基金的基金经理	2015 年 11 月 24 日	2023 年 04 月 24 日	13	<p>国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。</p> <p>从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化</p>

					<p>投资部基金经理。2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 2 日至今任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至今任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p>
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2015 年 02 月 16 日	2023 年 04 月 24 日	17	<p>国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：</p>

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

					<p>中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。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。2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至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。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至今任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经</p>
--	--	--	--	--	--

					理。
--	--	--	--	--	----

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况 (转型后)

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。

4.1.3 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 (转型前)

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和流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 45 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2023 年 04 月 25 日变更注册为汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金。转型前，本报告期添富成长多因子股票 A 类份额净值增长率为 3.11%，同期业绩比较基准收益率为 5.30%。本报告期添富成长多因子股票 C 类份额净值增长率为 2.99%，同期业绩比较基准收益率为 5.30%。转型后，本报告期汇添富中证 500 指数增强 A 类份额净值增长率为-2.86%，同期业绩比较基准收益率为-11.93%。本报告期汇添富中证 500 指数增强 C 类份额净值增长率为-3.14%，同期业绩比较基准收益率为-11.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，高质量发展仍是时代主题，整体宏观经济以稳为主。调控效果预计在新的一年里逐步显现，三大工程相关的财政准财政支撑有望缓解地产的下滑困境，居民消费潜力仍有释放空间，这些因素有利于巩固经济回升态势。同时，随着海外通胀逐步得到控制，外部流动性有望边际宽松；海外地区冲突造成的不确定性逐步被市场消化；AI 等科技创新有望推动产业革新和提升生产力。总体来看，投资面临的不确定性可能会降低。然而，我们也需要看到一些中长期的挑战：内需的提振需要长期信心的修复，居民端预期和企业端投资需求仍在低位，可能需要较长时间的恢复过程；地产链的风险在短期内逐步化解，但长期受城镇化程度、人口结构和出生率等因素影响；外需仍受到压制，海外主要经济体受到加息周期的滞后影响仍面临一定下行压力。从政策预期来看，财政准财政政策可能成为托底经济的主导力量，同时货币政策提供适度的流动性支持，降准降息存在一定空间，总体仍然是稳总量重结构，强调政策的精准有效。总体来说，机遇大于挑战，我们有理由对市场前景相对乐观。

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

表现也有望更为均衡，除了去年表现较好的质量、估值、交易类因子外，基本面趋势相关的成长、盈利、预期类因子也可能出现超额修复。

汇添富中证 500 指数增强基金使用量化选股模型挑选个股，保持风格和行业的相对均衡，具有较鲜明的中盘风格。中证 500 行业均衡，基本面稳健，包含众多细分行业的龙头公司，未来机构市值下沉的趋势仍有可能持续，中小市值风格内部获取超额收益的空间可能仍然可观，给中证 500 指数增强带来较好的投资机会。我们将进一步加大量化模型的研究深度，扩展新技术、新数据在量化投资中的应用，提高信息的发掘和利用效率，提升风险管理和组合精细化管理能力。汇添富中证 500 指数增强基金将继续严格遵守基金合同，追求相对业绩比较基准的较为稳定的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规法务管理

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

2、完善投资合规风险控制工作

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

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

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

控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

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

3、持续加强稽核工作

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但最终决策权，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：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类基金份额、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低

于面值；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

本报告期内，本基金于 2023 年 03 月 27 日实施利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 2.6500 元人民币；C 类份额每 10 份基金份额派发红利 2.6500 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告（转型后）

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_B85 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、

	<p>净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当</p>

	<p>的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	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

§ 6 审计报告（转型前）

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_B306 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 4 月 24 日（基金合同失效前日）的资产负债表，2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 24 日（基金合同失效前日）止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资</p>

	<p>基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金 2023 年 4 月 24 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 4 月 24 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串</p>

	<p>通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	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（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	186,446,768.96
结算备付金		20,206,595.57
存出保证金		461,949.49
交易性金融资产	7.4.7.2	3,035,637,221.13
其中：股票投资		3,027,595,358.12
基金投资		-
债券投资		8,041,863.01

资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		26,974,748.56
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		3,269,727,283.71
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		16,040,074.50
应付赎回款		8,571,429.85
应付管理人报酬		2,274,671.89
应付托管费		568,667.98
应付销售服务费		234,813.11
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.7	4,424,796.60
负债合计		32,114,453.93
净资产：		
实收基金	7.4.7.8	2,217,454,257.62
未分配利润	7.4.7.9	1,020,158,572.16
净资产合计		3,237,612,829.78
负债和净资产总计		3,269,727,283.71

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,217,454,257.62 份。本基金下属汇添富中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.4619 元，基金份额总额 1,711,900,483.18 份；本基金下属汇添富中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.4539 元，基金份额总额

505,553,774.44 份。

2、本基金合同于 2023 年 04 月 25 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2023 年 12 月 31 日数据，特此说明。

7.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 04 月 25 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 04 月 25 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-83,682,908.84
1. 利息收入		614,642.15
其中：存款利息收入	7.4.7.10	614,642.15
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-126,871,114.99
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-177,725,009.95
基金投资收益	7.4.7.12	-
债券投资收益	7.4.7.13	592,816.48
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	50,261,078.48
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	42,248,629.46
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	324,934.54
减：二、营业总支出		24,312,544.41
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	17,655,365.25
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,413,841.30
3. 销售服务费		2,108,432.91
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		0.07
8. 其他费用	7.4.7.21	134,904.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-107,995,453.25
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-107,995,453.25
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-107,995,453.25

注：本基金合同于 2023 年 04 月 25 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,999,698,721.68	1,007,742,343.73	3,007,441,065.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	217,755,535.94	12,416,228.43	230,171,764.37
（一）、综合收益总额	-	-107,995,453.25	-107,995,453.25
（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）	217,755,535.94	120,411,681.68	338,167,217.62
其中：1. 基金申购款	1,283,425,201.41	612,462,615.30	1,895,887,816.71
2. 基金赎回款	-1,065,669,665.47	-492,050,933.62	-1,557,720,599.09
（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	2,217,454,257.62	1,020,158,572.16	3,237,612,829.78

注：本基金合同于 2023 年 04 月 25 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），是由汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金变更而来。原汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资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[2015]117 号文《关于准予汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2015 年 2 月 16 日生效。首次设立基金募集规模为 1,903,140,954.30 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（2015）验字第 60466941_B06 号验资报告予以验证。

根据《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会于 2023 年 4 月 17 日表决通过了《关于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金转型的议案》。自 2023 年 4 月 25 日起，本基金名称变更为“汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金”。《汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 25 日起生效，原《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于同一日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的标的指数为中证 500 指数。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交

换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，追求基金资产的长期增值。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个

存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成

本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的

账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类基金份额、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有

人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

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

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	186,446,768.96
等于：本金	186,427,394.98
加：应计利息	19,373.98
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	186,446,768.96

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	3,111,188,673.00	-	3,027,595,358.12	-83,593,314.88	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	7,970,183.00	57,863.01	8,041,863.01	13,817.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	7,970,183.00	57,863.01	8,041,863.01	13,817.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,119,158,856.00	57,863.01	3,035,637,221.13	-83,579,497.88	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

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

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,234,796.60
其中：交易所市场	4,234,796.60
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	70,000.00
应付信息披露费	120,000.00
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
其他	-
合计	4,424,796.60

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数增强 A		
项目	本期 2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,515,240,799.06	1,515,240,799.06
本期申购	871,627,625.73	871,627,625.73
本期赎回（以“-”号填列）	-674,967,941.61	-674,967,941.61
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	1,711,900,483.18	1,711,900,483.18
汇添富中证 500 指数增强 C		
项目	本期 2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	484,457,922.62	484,457,922.62
本期申购	411,797,575.68	411,797,575.68

本期赎回（以“-”号填列）	-390,701,723.86	-390,701,723.86
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	505,553,774.44	505,553,774.44

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

汇添富中证 500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	630,031,222.80	135,088,102.95	765,119,325.75
本期利润	-113,067,650.82	28,794,333.40	-84,273,317.42
本期基金份额交易产生的变动数	80,565,287.52	29,291,777.71	109,857,065.23
其中：基金申购款	329,454,488.89	89,282,224.98	418,736,713.87
基金赎回款	-248,889,201.37	-59,990,447.27	-308,879,648.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	597,528,859.50	193,174,214.06	790,703,073.56
汇添富中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	199,412,445.26	43,210,572.72	242,623,017.98
本期利润	-37,176,431.89	13,454,296.06	-23,722,135.83
本期基金份额交易产生的变动数	10,197,221.65	357,394.80	10,554,616.45
其中：基金申购款	157,318,739.64	36,407,161.79	193,725,901.43
基金赎回款	-147,121,517.99	-36,049,766.99	-183,171,284.98
本期已分配利润	-	-	-

本期末	172,433,235.02	57,022,263.58	229,455,498.60
-----	----------------	---------------	----------------

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	439,888.13
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	165,522.53
其他	9,231.49
合计	614,642.15

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	11,051,384,097.13
减：卖出股票成本总额	11,204,174,247.84
减：交易费用	24,934,859.24
买卖股票差价收入	-177,725,009.95

7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	128,706.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	464,109.93
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	592,816.48

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 2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	91,865,725.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	90,850,085.00
减：应计利息总额	551,158.27
减：交易费用	372.43
买卖债券差价收入	464,109.93

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	50,261,078.48
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	50,261,078.48

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 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
------	--

1. 交易性金融资产	42,248,629.46
——股票投资	42,539,332.46
——债券投资	-290,703.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	42,248,629.46

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	324,934.54
替代损益	-
其他	-
合计	324,934.54

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	48,137.08
信息披露费	82,520.22
证券出借违约金	-
账户维护费	3,000.00
银行费用	1,247.58
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-

其他	-
合计	134,904.88

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (新加坡) 有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 04 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	1,710,605,697.43	7.62

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 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
东方证券	5,998,740.00	6.82

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	1,242,225.62	8.37	-	-

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 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	17,655,365.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,808,513.63
应支付基金管理人的净管理费	15,846,851.62

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,413,841.30

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	102,427.47	102,427.47
东方证券股份	-	18.42	18.42

有限公司			
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,956,605.79	1,956,605.79
合计	-	2,059,051.68	2,059,051.68

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注： 本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 04 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	186,446,768.96	439,888.13

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

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

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
600325	华发股份	2023 年 11 月 02 日	6 个月	非公开发行流通受限	8.07	6.91	1,239,157	9,999,996.99	8,562,574.87	
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券	证	成	受	流	认	期	数量（单	期末成本总	期末估值总	备

代码	券名称	认购日	限期	通受限类型	购价格	未估值单价	位：张)	额	额	注
					-	-	-	-	-	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金

融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 3 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	186,446,768. 96	-	-	-	-	-	186,446,768.96
结 算 备 付 金	20,206,595.5 7	-	-	-	-	-	20,206,595.57
存 出 保 证 金	461,949.49	-	-	-	-	-	461,949.49
交 易 性 金 融 资 产	-	-	8,041,863.0 1	-	-	3,027,595,358. 12	3,035,637,221. 13
衍	-	-	-	-	-	-	-

生金融资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	26,974,748.56	26,974,748.56
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产	207,115,314.02	-	8,041,863.01	-	-	3,054,570,106.68	3,269,727,283.71

总计							
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	-	-	-	-	-	16,040,074.50	16,040,074.50
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,571,429.85	8,571,429.85
应付管理	-	-	-	-	-	2,274,671.89	2,274,671.89

人 报 酬							
应付 托 管 费	-	-	-	-	-	568,667.98	568,667.98
应付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	234,813.11	234,813.11
应付 投 资 顾 问 费	-	-	-	-	-	-	-
应 交 税 费	-	-	-	-	-	-	-
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
递 延 所 得 税 负 债	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	4,424,796.60	4,424,796.60
负 债 总	-	-	-	-	-	32,114,453.93	32,114,453.93

计							
利率敏感度缺口	207,115,314.02	-	8,041,863.01	-	-	3,022,455,652.75	3,237,612,829.78

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

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。	
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
	基准利率减少 25 个基点	11,155.22
	基准利率增加 25 个基点	-11,124.13

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,027,595,358.12	93.51
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	8,041,863.01	0.25
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	3,035,637,221.13	93.76

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上涨 5%	134,134,850.07
	中证 500 指数下跌 5%	-134,134,850.07

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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	3,019,032,783.25
第二层次	8,041,863.01
第三层次	8,562,574.87
合计	3,035,637,221.13

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 04 月 25 日（基金合同生效日）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	-	820,201.60	820,201.60
当期购买	-	9,999,996.99	9,999,996.99
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	820,201.60	820,201.60
当期利得或损失总额	-	-1,437,422.12	-1,437,422.12
其中：计入损益的利得或损失	-	-1,437,422.12	-1,437,422.12
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	8,562,574.87	8,562,574.87

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	-	-1,437,422.12	- 1,437,422.12
---	---	---------------	-------------------

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
限售股票	8,562,574.87	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.3195	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。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 04 月 24 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 04 月 24 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	153,618,360.76	41,494,122.34
结算备付金		28,070,604.99	7,562,616.98
存出保证金		780,122.17	208,698.55
交易性金融资产	7.4.7.2	2,831,744,755.64	747,446,349.23
其中：股票投资		2,779,230,965.05	746,426,139.64
基金投资		-	-
债券投资		52,513,790.59	1,020,209.59
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	2,330,081.11
应收股利		-	-
应收申购款		165,485.17	238,503.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,014,379,328.73	799,280,371.73
负债和净资产	附注号	本期末 2023年04月24日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	2,239,027.14
应付赎回款		1,534,753.72	110,502.95
应付管理人报酬		3,064,651.62	1,065,913.87
应付托管费		510,775.26	177,652.32
应付销售服务费		196,387.96	24.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7.25	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	1,631,687.51	2,197,768.16
负债合计		6,938,263.32	5,790,889.21
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	1,999,698,721.68	464,353,830.59
未分配利润	7.4.7.9	1,007,742,343.73	329,135,651.93

净资产合计		3,007,441,065.41	793,489,482.52
负债和净资产总计		3,014,379,328.73	799,280,371.73

注：报告截止日 2023 年 04 月 24 日，基金份额总额 1,999,698,721.68 份。本基金下属添富成长多因子股票 A 基金份额净值 1.505 元，基金份额总额 1,515,240,799.06 份；本基金下属添富成长多因子股票 C 基金份额净值 1.501 元，基金份额总额 484,457,922.62 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 04 月 24 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-31,160,284.90	-126,993,623.68
1. 利息收入		173,806.05	309,905.88
其中：存款利息收入	7.4.7.10	173,806.05	309,543.27
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		-	362.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		75,250,915.88	-91,644,332.33
其中：股票投资收益	7.4.7.11	74,250,737.82	-104,821,770.95
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	145,707.47	698,217.72
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	854,470.59	12,479,220.90
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	-106,712,218.94	-36,753,764.27
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	127,212.11	1,094,567.04
减：二、营业总支出		9,552,954.02	14,966,480.09
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,807,139.26	12,649,091.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,301,189.88	2,108,181.96

3. 销售服务费		315,507.00	36.17
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		1.18	1.36
8. 其他费用	7.4.7.21	129,116.70	209,169.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-40,713,238.92	-141,960,103.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-40,713,238.92	-141,960,103.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-40,713,238.92	-141,960,103.77

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	464,353,830.59	329,135,651.93	793,489,482.52
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	464,353,830.59	329,135,651.93	793,489,482.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,535,344,891.09	678,606,691.80	2,213,951,582.89
（一）、综合收益总额	-	-40,713,238.92	-40,713,238.92
（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）	1,535,344,891.09	1,237,842,338.73	2,773,187,229.82
其中：1. 基金申购款	1,649,260,852.81	1,317,296,615.56	2,966,557,468.37
2. 基金赎回款	-113,915,961.72	-79,454,276.83	-193,370,238.55
（三）、本期向	-	-518,522,408.01	-518,522,408.01

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	1,999,698,721.68	1,007,742,343.73	3,007,441,065.41
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	578,184,327.47	569,543,055.20	1,147,727,382.67
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	578,184,327.47	569,543,055.20	1,147,727,382.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-113,830,496.88	-240,407,403.27	-354,237,900.15
（一）、综合收益总额	-	-141,960,103.77	-141,960,103.77
（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）	-113,830,496.88	-98,447,299.50	-212,277,796.38
其中：1. 基金申购款	158,667,505.86	127,142,986.82	285,810,492.68
2. 基金赎回款	-272,498,002.74	-225,590,286.32	-498,088,289.06
（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	464,353,830.59	329,135,651.93	793,489,482.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]117号文《关于准予汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于2015年2月16日生效。首次设立基金募集规模为1,903,140,954.30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（2015）验字第60466941_B06号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自2022年10月12日起，本基金增设C类基金份额，原基金份额变更为A类基金份额，基金注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证不低于基金资产的80%，其中投资于成长型行业的上市公司股票及存托凭证不低于非现金基金资产的80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金对于成长型行业的定义：本基金对行业成长性的划分主要基于行业的估值水平，由于市场对成长型行业的未来发展有较好的预期，因而这些行业的估值相对较高，而价值型行业的估值相对较低。本基金具体通过市净率指标对申万一级行业进行成长性和价值性划分。将市净率排名位于前1/4的行业定义为“典型成长”行业；将市净率排名位于后1/4的行业定义为“典型价值”行业；而市净率排名位于中间1/2的行业，由于兼具成长性与价值性，定义为“兼具成长和价值”的行业。本基金将“典型成长”行业和“兼具成长和价值”的行业统一定义为成长型行业。本基金通过

多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×90%+活期存款利率（税后）×10%。

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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 04 月 24 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日（合同失效前日）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小层次输入值，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后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，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的有关业务规则进行调整，并及时公告。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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%；

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 04 月 24 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	153,618,360.76	41,494,122.34
等于：本金	153,550,849.34	41,489,333.60
加：应计利息	67,511.42	4,788.74
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	153,618,360.76	41,494,122.34

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 04 月 24 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	2,905,363,612.39	-	2,779,230,965.05	126,132,647.34	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,052,700.00	336.98	2,372,806.98	319,770.00
	银行间市场	50,015,250.00	140,983.61	50,140,983.61	-15,250.00
	其他	-	-	-	-
	合计	52,067,950.00	141,320.59	52,513,790.59	304,520.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,957,431,562.39	141,320.59	2,831,744,755.64	125,828,127.3	

项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			4
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		765,541,958.04	-	746,426,139.64	- 19,115,818.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	999,990.00	20,309.59	1,020,209.59	-90.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	999,990.00	20,309.59	1,020,209.59	-90.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		766,541,948.04	20,309.59	747,446,349.23	- 19,115,908.40

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 04 月 24 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	186.18	5.08
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,442,158.63	2,007,763.08
其中：交易所市场	1,441,883.63	2,007,763.08
银行间市场	275.00	-
应付利息	-	-
应付审计费	91,862.92	70,000.00
应付信息披露费	37,479.78	120,000.00
应付指数使用费	-	-
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	10,000.00	-
应付持有人大会费-律师费	50,000.00	-
应付或有管理费	-	-
其他	-	-
合计	1,631,687.51	2,197,768.16

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

添富成长多因子股票 A		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	464,290,765.63	464,290,765.63
本期申购	1,164,634,755.81	1,164,634,755.81
本期赎回（以“-”号填列）	-113,684,722.38	-113,684,722.38
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	1,515,240,799.06	1,515,240,799.06
添富成长多因子股票 C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,064.96	63,064.96
本期申购	484,626,097.00	484,626,097.00

本期赎回（以“-”号填列）	-231,239.34	-231,239.34
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	484,457,922.62	484,457,922.62

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

添富成长多因子股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	278,257,062.24	50,834,009.13	329,091,071.37
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	278,257,062.24	50,834,009.13	329,091,071.37
本期利润	57,234,437.42	-80,230,402.01	-22,995,964.59
本期基金份额交易产生的变动数	686,561,386.87	164,484,495.83	851,045,882.70
其中：基金申购款	747,994,145.84	182,324,687.23	930,318,833.07
基金赎回款	-61,432,758.97	-17,840,191.40	-79,272,950.37
本期已分配利润	-392,021,663.73	-	-392,021,663.73
本期末	630,031,222.80	135,088,102.95	765,119,325.75
添富成长多因子股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	37,681.05	6,899.51	44,580.56
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	37,681.05	6,899.51	44,580.56
本期利润	8,764,542.60	-26,481,816.93	-17,717,274.33
本期基金份额交易产生的变动数	317,110,965.89	69,685,490.14	386,796,456.03
其中：基金	317,253,976.50	69,723,805.99	386,977,782.49

申购款			
基金赎回款	-143,010.61	-38,315.85	-181,326.46
本期已分配利润	-126,500,744.28	-	-126,500,744.28
本期末	199,412,445.26	43,210,572.72	242,623,017.98

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 04 月 24 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	123,318.33	190,165.02
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	48,701.46	115,445.71
其他	1,786.26	3,932.54
合计	173,806.05	309,543.27

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,565,551,928.59	6,507,950,221.39
减：卖出股票成本总额	3,480,732,729.57	6,595,628,182.63
减：交易费用	10,568,461.20	17,143,809.71
买卖股票差价收入	74,250,737.82	-104,821,770.95

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	165,920.47	41,837.24
债券投资收益——	-20,213.00	656,380.48

—买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		
债券投资收益— —赎回差价收入	-	-
债券投资收益— —申购差价收入	-	-
合计	145,707.47	698,217.72

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 04 月 24 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	57,495,431.49	36,121,377.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	57,306,386.00	35,086,048.29
减：应计利息总额	208,433.49	378,845.16
减：交易费用	825.00	103.11
买卖债券差价收入	-20,213.00	656,380.48

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	854,470.59	12,479,220.90

其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	854,470.59	12,479,220.90

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年04月24日	2022年01月01日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-106,712,218.94	-36,753,764.27
——股票投资	-107,016,828.94	-36,659,741.97
——债券投资	304,610.00	-94,022.30
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-106,712,218.94	-36,753,764.27

7.4.7.19 其他收入

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04月24日	2022年01月01日至2022年12月31日
基金赎回费收入	127,212.11	1,094,567.04
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	127,212.11	1,094,567.04

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04月24日	2022年01月01日至2022年12月31日
审计费用	21,862.92	70,000.00

信息披露费	37,479.78	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	9,000.00	18,000.00
银行费用	774.00	1,169.00
指数使用费	-	-
持有人大会- 公证费	10,000.00	-
持有人大会- 律师费	50,000.00	-
开户费	-	-
上市费	-	-
或有管理费	-	-
其他	-	-
合计	129,116.70	209,169.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (新加坡) 有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 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	1,043,058,189.32	11.36	402,129,937.79	3.14

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 04 月 24 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	4,790,064.00	35.27	5,023,525.00	7.25

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 04 月 24 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	752,326.04	11.99	94,107.39	6.53
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	296,502.69	3.12	-	-

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04月24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	7,807,139.26	12,649,091.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	938,963.31	3,054,537.64
应支付基金管理人的净管理费	6,868,175.95	9,594,553.96

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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04月24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	1,301,189.88	2,108,181.96

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 04 月 24 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	314,961.64	314,961.64
合计	-	314,961.64	314,961.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	5.32	5.32
合计	-	5.32	5.32

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

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 04 月 24 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
工商银行	153,618,360.76	123,318.33	41,494,122.34	190,165.02

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

添富成长多因子股票 A

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 03 月 27 日		2023 年 03 月 27 日	2.6500	315,005,418.95	77,016,244.78	392,021,663.73	
合计	-	-		2.6500	315,005,418.95	77,016,244.78	392,021,663.73	
添富成长多因子股票 C								
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
1	2023 年 03 月 27 日		2023 年 03 月 27 日	2.6500	119,184,095.27	7,316,649.01	126,500,744.28	
合计	-	-		2.6500	119,184,095.27	7,316,649.01	126,500,744.28	

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 04 月 24 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
001286	陕西能	2023 年 03	6 个月	新股流	9.60	9.07	3,767	36,163.20	34,166.69	

	源	月 31 日		通 受 限						
001287	中 电 港	2023 年 03 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.88	19.65	1,171	13,911.48	23,010.15	
001328	登 康 口 腔	2023 年 03 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	20.68	24.94	145	2,998.60	3,616.30	
001360	南 矿 集 团	2023 年 03 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	15.38	15.88	177	2,722.26	2,810.76	
001367	海 森 药 业	2023 年 03 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	44.48	43.91	55	2,446.40	2,415.05	
301157	华 塑 科 技	2023 年 03 月 01 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	56.50	50.68	150	8,475.00	7,602.00	
301165	锐 捷 网 络	2022 年 11 月 14 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	32.38	64.95	849	27,490.62	55,142.55	
301203	国 泰 环 保	2023 年 03 月 28	6 个 月	新 股 流 通 受	46.13	34.38	225	10,379.25	7,735.50	

		日		限						
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	30.85	21.87	1,328	40,968.80	29,043.36	
301265	华新环保	2022年12月08日	6个月	新股流通受限	13.28	11.87	819	10,876.32	9,721.53	
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	71.14	441	22,438.08	31,372.74	
301277	新天地	2022年11月09日	6个月	新股流通受限	27.00	29.45	439	11,853.00	12,928.55	
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股流通受限	67.40	47.52	279	18,804.60	13,258.08	
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	44.18	33.37	241	10,647.38	8,042.17	
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.05	330	14,549.70	11,566.50	
301301	川	2022	6	新	5.00	9.13	3,574	17,870.00	32,630.62	

	宁生物	年 12 月 20 日	个 月	股 流 通 受 限						
301307	美利信	2023 年 04 月 14 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	32.34	28.53	687	22,217.58	19,600.11	
301311	昆船智能	2022 年 11 月 23 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	13.88	18.92	832	11,548.16	15,741.44	
301317	鑫磊股份	2023 年 01 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	20.67	23.04	694	14,344.98	15,989.76	
301335	天元宠物	2022 年 11 月 11 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	49.98	35.31	420	20,991.60	14,830.20	
301345	涛涛车业	2023 年 03 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	73.45	45.03	266	19,537.70	11,977.98	
301356	天振股份	2022 年 11 月 03 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	63.00	48.28	540	34,020.00	26,071.20	
301358	湖南裕	2023 年 02	6 个 月	新 股 流	23.77	35.45	764	18,160.28	27,083.80	

	能	月 01 日		通 受 限						
301360	荣旗科技	2023 年 04 月 17 日	6 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	71.88	71.88	1,206	86,687.28	86,687.28	
301360	荣旗科技	2023 年 04 月 17 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	71.88	71.88	134	9,631.92	9,631.92	
301365	矩阵股份	2022 年 11 月 14 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	34.72	25.54	516	17,915.52	13,178.64	
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	119.88	259.23	223	26,733.24	57,808.29	
301368	丰立智能	2022 年 12 月 07 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	22.33	23.08	337	7,525.21	7,777.96	
301373	凌玮科技	2023 年 01 月 20 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	33.73	30.58	277	9,343.21	8,470.66	
301377	鼎泰高科	2022 年 11 月 11	6 个 月	新 股 流 通 受	22.88	19.39	770	17,617.60	14,930.30	

		日		限						
301379	天山电子	2022年10月19日	6个月	新股流通受限	31.51	25.95	449	14,147.99	11,651.55	
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	25.88	23.13	292	7,556.96	6,753.96	
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股流通受限	22.50	18.65	1,269	28,552.50	23,666.85	
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	89.33	247	23,712.00	22,064.51	
301396	宏景科技	2022年11月04日	6个月	新股流通受限	40.13	40.26	396	15,891.48	15,942.96	
301398	星源卓镁	2022年12月08日	6个月	新股流通受限	34.40	29.33	255	8,772.00	7,479.15	
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	19.99	15.97	949	18,970.51	15,155.53	
601061	中	2023	6	新	6.58	6.99	2,775	18,259.50	19,397.25	

	信金属	年 03 月 30 日	个 月	股 流 通 受 限						
601065	江西省盐业集团	2023 年 03 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	10.36	9.87	88	911.68	868.56	
601133	柏诚系统股份公司	2023 年 03 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.66	12.87	664	7,742.24	8,545.68	
603125	江苏常青树科技	2023 年 03 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	25.98	26.33	160	4,156.80	4,212.80	
603135	中重科技	2023 年 03 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	17.80	16.23	628	11,178.40	10,192.44	
603137	恒尚节能	2023 年 04 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	15.90	16.90	139	2,210.10	2,349.10	
688146	中船派瑞特	2023 年 04 月 13	6 个 月	新 股 流 通 受	36.15	47.03	796	28,775.40	37,435.88	

	气	日		限						
688352	顾中科技	2023年04月11日	6个月	新股流通受限	12.10	13.21	2,361	28,568.10	31,188.81	
688433	华曙高科	2023年04月07日	6个月	新股流通受限	26.66	22.99	418	11,143.88	9,609.82	
688484	南芯科技	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	39.99	37.16	687	27,473.13	25,528.92	
688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	245.56	272.98	145	35,606.20	39,582.10	
688535	华海诚科新材料	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	35.00	62.44	161	5,635.00	10,052.84	

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123190	道氏转02	2023年04月07日	12个交易日	新债流通受限	100.00	100.01	4,027	402,700.00	402,747.66	

		日		限					
--	--	---	--	---	--	--	--	--	--

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:截至本报告期末 2023 年 04 月 24 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 04 月 24 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:截至本报告期末 2023 年 04 月 24 日止,本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任,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 202 3 年 04 月 24 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	153,618,360. 76	-	-	-	-	-	153,618,360.76
结 算 备 付 金	28,070,604.9 9	-	-	-	-	-	28,070,604.99
存 出 保 证 金	780,122.17	-	-	-	-	-	780,122.17
交 易 性 金 融 资 产	-	-	52,513,790. 59	-	-	2,779,230,965. 05	2,831,744,755. 64
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	165,485.17	165,485.17
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	182,469,087.92	-	52,513,790.59	-	-	2,779,396,450.22	3,014,379,328.73
负债	-	-	-	-	-	-	-
短	-	-	-	-	-	-	-

期借款							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,534,753.72	1,534,753.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,064,651.62	3,064,651.62
应付	-	-	-	-	-	510,775.26	510,775.26

托管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	196,387.96	196,387.96
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	7.25	7.25
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,631,687.51	1,631,687.51
负债总计	-	-	-	-	-	6,938,263.32	6,938,263.32
利率敏感	182,469,087.92	-	52,513,790.59	-	-	2,772,458,186.90	3,007,441,065.41

度 缺 口							
上 年 度 末 202 2 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	41,494,122.34	-	-	-	-	-	41,494,122.34
结 算 备 付 金	7,562,616.98	-	-	-	-	-	7,562,616.98
存 出 保 证 金	208,698.55	-	-	-	-	-	208,698.55
交 易 性 金 融 资 产	1,020,209.59	-	-	-	-	746,426,139.64	747,446,349.23
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
买	-	-	-	-	-	-	-

入 返 售 金 融 资 产							
债 权 投 资	-	-	-	-	-	-	-
应 收 清 算 款	-	-	-	-	-	2,330,081.11	2,330,081.11
应 收 股 利	-	-	-	-	-	-	-
应 收 申 购 款	-	-	-	-	-	238,503.52	238,503.52
递 延 所 得 税 资 产	-	-	-	-	-	-	-
其 他 资 产	-	-	-	-	-	-	-
资 产 总 计	50,285,647.46	-	-	-	-	748,994,724.27	799,280,371.73
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	-	-	-	-	-	2,239,027.14	2,239,027.14
应付赎回款	-	-	-	-	-	110,502.95	110,502.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,065,913.87	1,065,913.87
应付托	-	-	-	-	-	177,652.32	177,652.32

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	24.77	24.77
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,197,768.16	2,197,768.16
负债总计	-	-	-	-	-	5,790,889.21	5,790,889.21
利率敏感度	50,285,647.46	-	-	-	-	743,203,835.06	793,489,482.52

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

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

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
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 04 月 24 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	108,547.16	89.00
	基准利率增加 25 个基点	-108,077.84	-88.98

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 04 月 24 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	2,779,230,965.05	92.41	746,426,139.64	94.07
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	52,513,790.59	1.75	1,020,209.59	0.13
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	2,831,744,755.64	94.16	747,446,349.23	94.20

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 04 月 24 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上涨 5%	133,476,742.82	35,412,380.11
	中证 500 指数下跌 5%	-133,476,742.82	-35,412,380.11

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 04 月 24 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,780,284,503.57	744,448,153.16
第二层次	50,640,050.47	1,406,072.99
第三层次	820,201.60	1,592,123.08
合计	2,831,744,755.64	747,446,349.23

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 04 月 24 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,592,123.08	1,592,123.08
当期购买	-	412,947.06	412,947.06
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,263,149.53	1,263,149.53
当期利得或损失总额	-	78,280.99	78,280.99
其中：计入损益的利得或损失	-	78,280.99	78,280.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	820,201.60	820,201.60
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	78,280.99	78,280.99

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	
实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益			
期初余额	-	4,452,927.97	4,452,927.97
当期购买	-	1,253,506.76	1,253,506.76
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	4,452,927.97	4,452,927.97
当期利得或损失总额	-	338,616.32	338,616.32
其中：计入损益的利得或 损失	-	338,616.32	338,616.32
计入其他综合收益 的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,592,123.08	1,592,123.08
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	-	338,616.32	338,616.32

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
限售股票	820,201.60	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.1386-1.7775	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	1,592,123.08	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，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告（转型后）

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	3,027,595,358.12	92.59
	其中：股票	3,027,595,358.12	92.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,041,863.01	0.25
	其中：债券	8,041,863.01	0.25
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	206,653,364.53	6.32
8	其他各项资产	27,436,698.05	0.84
9	合计	3,269,727,283.71	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	19,080,274.50	0.59
B	采矿业	107,346,656.75	3.32
C	制造业	1,625,961,052.01	50.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,608,782.18	2.21
E	建筑业	10,810,910.00	0.33
F	批发和零售业	84,111,465.09	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	64,437,031.10	1.99
H	住宿和餐饮业	5,068,690.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,050,693.88	3.31
J	金融业	225,411,372.90	6.96
K	房地产业	44,350,462.62	1.37
L	租赁和商务服务业	22,136,592.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	21,218,566.00	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	9,286,925.00	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,230,936.00	0.04
Q	卫生和社会工作	10,670,569.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	36,470,605.65	1.13
S	综合	28,226,548.00	0.87
	合计	2,494,478,132.68	77.05

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	3,793,839.00	0.12
C	制造业	451,989,689.08	13.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,363,605.00	0.32
E	建筑业	7,610,926.30	0.24
F	批发和零售业	11,997,077.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	8,182,687.06	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,378,300.20	0.54
J	金融业	4,779,156.00	0.15
K	房地产业	96,743.00	0.00
L	租赁和商务服务业	21,998.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	8,339,353.80	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	2,927,185.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	1,449,395.00	0.04

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,063,840.00	0.09
S	综合	1,123,431.00	0.03
	合计	533,117,225.44	16.47

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	002138	顺络电子	1,024,000	27,658,240.00	0.85
2	000783	长江证券	5,088,984	27,378,733.92	0.85
3	002600	领益智造	3,849,987	26,025,912.12	0.80
4	000009	中国宝安	2,043,300	23,988,342.00	0.74
5	002422	科伦药业	820,000	23,821,000.00	0.74
6	002185	华天科技	2,792,835	23,794,954.20	0.73
7	600879	航天电子	3,080,263	23,748,827.73	0.73
8	300285	国瓷材料	972,993	22,495,598.16	0.69
9	002056	横店东磁	1,639,100	22,193,414.00	0.69
10	300296	利亚德	3,691,100	22,146,600.00	0.68
11	600498	烽火通信	1,247,500	20,758,400.00	0.64
12	601058	赛轮轮胎	1,764,013	20,727,152.75	0.64
13	601577	长沙银行	3,021,700	20,607,994.00	0.64

14	600511	国药股份	699,656	20,024,154.72	0.62
15	600380	健康元	1,596,374	19,842,928.82	0.61
16	300012	华测检测	1,388,700	19,719,540.00	0.61
17	600390	五矿资本	4,192,600	19,621,368.00	0.61
18	600867	通化东宝	1,798,429	19,476,986.07	0.60
19	000830	鲁西化工	1,903,701	19,094,121.03	0.59
20	600161	天坛生物	602,420	18,638,874.80	0.58
21	600885	宏发股份	666,878	18,432,507.92	0.57
22	000559	万向钱潮	3,551,460	18,432,077.40	0.57
23	000932	华菱钢铁	3,572,100	18,396,315.00	0.57
24	601231	环旭电子	1,208,982	18,267,718.02	0.56
25	600497	驰宏锌锗	3,615,295	18,257,239.75	0.56
26	600126	杭钢股份	3,385,300	18,043,649.00	0.56
27	300009	安科生物	1,759,500	17,982,090.00	0.56
28	600737	中粮糖业	2,130,000	17,551,200.00	0.54
29	000623	吉林敖东	1,157,240	17,520,613.60	0.54
30	000423	东阿阿胶	354,700	17,493,804.00	0.54
31	000060	中金岭南	3,974,000	17,167,680.00	0.53
32	002423	中粮资本	2,515,300	16,802,204.00	0.52
33	600801	华新水泥	1,319,300	16,398,899.00	0.51
34	002273	水晶光电	1,209,581	16,377,726.74	0.51
35	002028	思源电气	309,460	16,104,298.40	0.50

36	000729	燕京啤酒	1,864,000	16,086,320.00	0.50
37	601168	西部矿业	1,123,100	16,026,637.00	0.50
38	000738	航发控制	797,418	15,868,618.20	0.49
39	601717	郑煤机	1,238,997	15,673,312.05	0.48
40	000933	神火股份	914,700	15,366,960.00	0.47
41	002152	广电运通	1,252,000	15,349,520.00	0.47
42	600985	淮北矿业	910,200	15,136,626.00	0.47
43	000987	越秀资本	2,512,050	15,122,541.00	0.47
44	601077	渝农商行	3,575,700	14,588,856.00	0.45
45	600839	四川长虹	2,742,700	14,508,883.00	0.45
46	600642	申能股份	2,253,677	14,468,606.34	0.45
47	000636	风华高科	1,056,028	14,425,342.48	0.45
48	002683	广东宏大	712,300	14,302,984.00	0.44
49	300699	光威复材	535,200	14,273,784.00	0.44
50	601233	桐昆股份	935,714	14,157,352.82	0.44
51	600062	华润双鹤	749,200	13,935,120.00	0.43
52	300088	长信科技	2,079,700	13,913,193.00	0.43
53	002299	圣农发展	804,900	13,828,182.00	0.43
54	002563	森马服饰	2,396,274	13,826,500.98	0.43
55	600663	陆家嘴	1,546,457	13,531,498.75	0.42
56	600066	宇通客车	1,016,000	13,462,000.00	0.42
57	000959	首钢股份	3,886,400	13,446,944.00	0.42
58	600398	海澜之	1,787,600	13,263,992.00	0.41

		家			
59	002532	天山铝业	2,165,123	13,012,389.23	0.40
60	603225	新凤鸣	909,400	12,913,480.00	0.40
61	002608	江苏国信	1,959,200	12,871,944.00	0.40
62	600566	济川药业	409,200	12,861,156.00	0.40
63	002673	西部证券	2,016,704	12,846,404.48	0.40
64	600535	天士力	732,520	12,467,490.40	0.39
65	600282	南钢股份	3,357,600	12,423,120.00	0.38
66	300001	特锐德	609,500	12,250,950.00	0.38
67	600637	东方明珠	1,623,691	12,210,156.32	0.38
68	002653	海思科	524,900	12,151,435.00	0.38
69	603927	中科软	398,040	11,933,239.20	0.37
70	000581	威孚高科	789,400	11,896,258.00	0.37
71	600739	辽宁成大	1,001,900	11,802,382.00	0.36
72	300595	欧普康视	516,200	11,655,796.00	0.36
73	002384	东山精密	635,000	11,544,300.00	0.36
74	002966	苏州银行	1,752,880	11,323,604.80	0.35
75	600079	人福医药	455,000	11,311,300.00	0.35
76	002128	电投能源	787,100	11,231,917.00	0.35
77	002507	涪陵榨菜	785,633	11,226,695.57	0.35
78	601098	中南传媒	1,090,586	11,091,259.62	0.34
79	002463	沪电股份	500,401	11,068,870.12	0.34
80	600862	中航高科	498,133	11,033,645.95	0.34
81	000401	冀东水泥	1,690,550	10,802,614.50	0.33
82	600418	江淮汽	662,891	10,705,689.65	0.33

		车			
83	000513	丽珠集团	301,100	10,541,511.00	0.33
84	000630	铜陵有色	3,188,200	10,457,296.00	0.32
85	600352	浙江龙盛	1,244,400	10,452,960.00	0.32
86	000598	兴蓉环境	1,833,700	10,433,753.00	0.32
87	601139	深圳燃气	1,504,256	10,364,323.84	0.32
88	000089	深圳机场	1,602,900	10,306,647.00	0.32
89	002465	海格通信	798,300	10,258,155.00	0.32
90	601997	贵阳银行	1,960,132	10,075,078.48	0.31
91	600160	巨化股份	610,685	10,070,195.65	0.31
92	600399	抚顺特钢	1,018,958	9,904,271.76	0.31
93	600096	云天化	634,602	9,899,791.20	0.31
94	002078	太阳纸业	802,300	9,763,991.00	0.30
95	000975	银泰黄金	647,600	9,714,000.00	0.30
96	600580	卧龙电驱	827,200	9,703,056.00	0.30
97	002439	启明星辰	357,000	9,639,000.00	0.30
98	600765	中航重机	502,238	9,597,768.18	0.30
99	002025	航天电器	197,300	9,474,346.00	0.29
100	001914	招商积余	791,300	9,463,948.00	0.29
101	600848	上海临港	928,260	9,329,013.00	0.29
102	002925	盈趣科技	470,200	9,154,794.00	0.28
103	300017	网宿科技	1,157,700	9,087,945.00	0.28
104	300037	新宙邦	192,000	9,081,600.00	0.28

105	000539	粤电力 A	1,852,800	9,060,192.00	0.28
106	600177	雅戈尔	1,377,792	9,024,537.60	0.28
107	002690	美亚光电	458,800	9,010,832.00	0.28
108	600415	小商品城	1,205,500	8,824,260.00	0.27
109	600873	梅花生物	912,900	8,718,195.00	0.27
110	601966	玲珑轮胎	453,100	8,713,113.00	0.27
111	601128	常熟银行	1,360,200	8,691,678.00	0.27
112	601000	唐山港	2,454,000	8,589,000.00	0.27
113	600325	华发股份	1,239,157	8,562,574.87	0.26
114	000728	国元证券	1,253,386	8,560,626.38	0.26
115	600699	均胜电子	471,800	8,473,528.00	0.26
116	688099	晶晨半导体	135,104	8,461,563.52	0.26
117	601298	青岛港	1,366,806	8,446,861.08	0.26
118	600482	中国动力	466,589	8,403,267.89	0.26
119	603156	养元饮品	394,200	8,380,692.00	0.26
120	300146	汤臣倍健	488,200	8,314,046.00	0.26
121	603939	益丰药房	206,688	8,275,787.52	0.26
122	002065	东华软件	1,340,500	8,270,885.00	0.26
123	600315	上海家化	385,200	8,158,536.00	0.25
124	600348	华阳股份	832,450	8,124,712.00	0.25
125	600988	赤峰黄金	578,100	8,099,181.00	0.25
126	603233	大参林	322,834	8,038,566.60	0.25
127	000887	中鼎股份	648,670	8,024,047.90	0.25
128	600060	海信视	377,300	7,885,570.00	0.24

		像			
129	600369	西南证 券	1,921,500	7,858,935.00	0.24
130	002739	万达电 影	599,900	7,810,698.00	0.24
131	600582	天地科 技	1,427,100	7,763,424.00	0.24
132	601636	旗滨集 团	1,113,200	7,614,288.00	0.24
133	002010	传化智 联	1,625,600	7,510,272.00	0.23
134	002120	韵达股 份	1,003,500	7,486,110.00	0.23
135	000156	华数传 媒	1,013,692	7,470,910.04	0.23
136	600271	航天信 息	701,389	7,462,778.96	0.23
137	000400	许继电 气	339,724	7,460,339.04	0.23
138	600655	豫园股 份	1,201,322	7,460,209.62	0.23
139	002511	中顺洁 柔	743,649	7,436,490.00	0.23
140	000629	钒钛股 份	2,222,300	7,289,144.00	0.23
141	000997	新大陆	370,500	7,265,505.00	0.22
142	601108	财通证 券	918,112	7,124,549.12	0.22
143	600827	百联股 份	744,500	7,065,305.00	0.22
144	000960	锡业股 份	491,575	7,039,354.00	0.22
145	000021	深科技	433,900	7,033,519.00	0.22
146	002294	信立泰	215,200	7,028,432.00	0.22
147	300395	菲利华	191,400	6,997,584.00	0.22
148	000967	盈峰环 境	1,471,100	6,987,725.00	0.22
149	600521	华海药 业	473,301	6,943,325.67	0.21
150	002429	兆驰股 份	1,244,200	6,942,636.00	0.21
151	603712	七一二	220,100	6,935,351.00	0.21
152	600549	厦门钨	403,535	6,932,731.30	0.21

		业			
153	002444	巨星科技	304,700	6,861,844.00	0.21
154	000723	美锦能源	1,022,100	6,807,186.00	0.21
155	300558	贝达药业	131,700	6,789,135.00	0.21
156	000039	中集集团	879,044	6,724,686.60	0.21
157	601611	中国核建	967,000	6,701,310.00	0.21
158	601216	君正集团	1,784,300	6,673,282.00	0.21
159	603596	伯特利	96,000	6,652,800.00	0.21
160	002092	中泰化学	1,073,000	6,545,300.00	0.20
161	603517	绝味食品	239,900	6,443,714.00	0.20
162	300682	朗新科技	389,427	6,382,708.53	0.20
163	300118	东方日升	359,300	6,341,645.00	0.20
164	002153	石基信息	645,800	6,290,092.00	0.19
165	002373	千方科技	560,970	6,288,473.70	0.19
166	000988	华工科技	211,200	6,285,312.00	0.19
167	603456	九洲药业	259,300	6,277,653.00	0.19
168	000703	恒逸石化	932,300	6,265,056.00	0.19
169	600166	福田汽车	2,291,700	6,256,341.00	0.19
170	603338	浙江鼎力	121,743	6,229,589.31	0.19
171	300244	迪安诊断	259,500	6,178,695.00	0.19
172	688390	固德威电源	47,200	6,163,376.00	0.19
173	002500	山西证券	1,142,304	6,157,018.56	0.19
174	002019	亿帆医药	414,500	6,126,310.00	0.19

		药			
175	300357	我武生物	208,500	6,046,500.00	0.19
176	688208	道通科技	253,044	6,009,795.00	0.19
177	688006	浙江杭可科技	251,857	5,913,602.36	0.18
178	600004	白云机场	603,400	5,901,252.00	0.18
179	002557	洽洽食品	168,800	5,877,616.00	0.18
180	601568	北元集团	1,235,400	5,855,796.00	0.18
181	002064	华峰化学	870,200	5,839,042.00	0.18
182	002926	华西证券	751,800	5,833,968.00	0.18
183	000785	居然之家	1,758,200	5,802,060.00	0.18
184	300253	卫宁健康	799,839	5,750,842.41	0.18
185	601608	中信重工	1,487,991	5,743,645.26	0.18
186	002080	中材科技	358,100	5,700,952.00	0.18
187	300373	扬杰科技	155,224	5,696,720.80	0.18
188	601598	中国外运	1,077,000	5,643,480.00	0.17
189	001872	招商港口	348,600	5,563,656.00	0.17
190	600167	联美控股	980,800	5,561,136.00	0.17
191	600967	内蒙一机	671,200	5,544,112.00	0.17
192	002508	老板电器	254,000	5,532,120.00	0.17
193	002572	索菲亚	346,600	5,528,270.00	0.17
194	002223	鱼跃医疗	159,000	5,498,220.00	0.17
195	600299	安迪苏	661,300	5,290,400.00	0.16
196	600901	江苏金租	1,080,400	5,229,136.00	0.16

197	002568	百润股份	210,300	5,175,483.00	0.16
198	600859	王府井	319,900	5,108,803.00	0.16
199	600258	首旅酒店	324,500	5,068,690.00	0.16
200	688536	思瑞浦股份	34,400	5,032,720.00	0.16
201	603885	吉祥航空	417,900	5,014,800.00	0.15
202	600528	中铁工业	669,800	4,983,312.00	0.15
203	600153	建发股份	513,600	4,945,968.00	0.15
204	600109	国金证券	541,300	4,915,004.00	0.15
205	000739	普洛药业	316,300	4,867,857.00	0.15
206	600481	双良节能	536,602	4,539,652.92	0.14
207	603858	步长制药	264,600	4,500,846.00	0.14
208	002044	美年健康	747,400	4,491,874.00	0.14
209	002595	豪迈科技	148,200	4,411,914.00	0.14
210	603228	景旺电子	195,232	4,404,433.92	0.14
211	601958	金铂股份	463,100	4,376,295.00	0.14
212	002409	雅克科技	77,600	4,324,648.00	0.13
213	600673	东阳光	578,200	4,238,206.00	0.13
214	688772	珠海冠宇电池	191,847	4,222,552.47	0.13
215	002372	伟星新材	289,778	4,193,087.66	0.13
216	600529	山东药玻	163,744	4,191,846.40	0.13
217	002399	海普瑞	357,300	4,191,129.00	0.13
218	603883	老百姓	139,587	4,172,255.43	0.13
219	600970	中材国际	440,000	4,109,600.00	0.13
220	003022	联泓新	222,900	4,081,299.00	0.13

		科			
221	603707	健友股份	268,100	4,021,500.00	0.12
222	600056	中国医药	345,674	3,861,178.58	0.12
223	603650	彤程新材	115,400	3,842,820.00	0.12
224	603816	顾家家居	108,700	3,804,500.00	0.12
225	603866	桃李面包	494,045	3,784,384.70	0.12
226	603000	人民网	133,100	3,724,138.00	0.12
227	603893	瑞芯微	58,700	3,721,580.00	0.11
228	000883	湖北能源	851,800	3,603,114.00	0.11
229	002850	科达利	41,800	3,530,428.00	0.11
230	002939	长城证券	433,900	3,471,200.00	0.11
231	002244	滨江集团	476,400	3,463,428.00	0.11
232	603658	安图生物	59,600	3,397,796.00	0.10
233	002340	格林美	620,700	3,389,022.00	0.10
234	688516	奥特维科技	37,300	3,375,650.00	0.10
235	000878	云南铜业	301,500	3,283,335.00	0.10
236	000930	中粮科技	492,901	3,272,862.64	0.10
237	300888	稳健医疗	85,700	3,192,325.00	0.10
238	002032	苏泊尔	58,100	3,079,881.00	0.10
239	300251	光线传媒	377,600	3,077,440.00	0.10
240	000778	新兴铸管	805,100	3,075,482.00	0.09
241	603218	日月股份	246,400	3,047,968.00	0.09
242	000958	电投产融	745,354	2,936,694.76	0.09
243	000998	隆平高科	207,965	2,932,306.50	0.09
244	688567	孚能科	179,700	2,930,907.00	0.09

		技			
245	300144	宋城演艺	292,477	2,886,747.99	0.09
246	000563	陕国投 A	930,400	2,828,416.00	0.09
247	600597	光明乳业	323,800	2,826,774.00	0.09
248	002468	申通快递	362,200	2,821,538.00	0.09
249	000825	太钢不锈	756,300	2,820,999.00	0.09
250	300383	光环新网	288,100	2,800,332.00	0.09
251	601187	厦门银行	547,600	2,776,332.00	0.09
252	600517	国网英大	581,900	2,775,663.00	0.09
253	601928	凤凰传媒	314,200	2,768,102.00	0.09
254	600131	国网信通	177,900	2,695,185.00	0.08
255	603379	三美股份	78,400	2,665,600.00	0.08
256	600377	宁沪高速	236,800	2,427,200.00	0.07
257	600909	华安证券	490,130	2,391,834.40	0.07
258	603355	莱克电气	106,000	2,363,800.00	0.07
259	603026	胜华新材	51,500	2,361,790.00	0.07
260	002408	齐翔腾达	442,480	2,336,294.40	0.07
261	600598	北大荒	193,800	2,319,786.00	0.07
262	000547	航天发展	275,100	2,302,587.00	0.07
263	603568	伟明环保	143,700	2,299,200.00	0.07
264	002203	海亮股份	192,223	2,143,286.45	0.07
265	601555	东吴证券	278,200	2,033,642.00	0.06
266	688520	神州细	37,700	2,030,899.00	0.06

		胞集团 公司			
267	002353	杰瑞股 份	71,800	2,018,298.00	0.06
268	600329	达仁堂	57,800	1,944,970.00	0.06
269	688819	天能电 池集团 股份	69,392	1,937,424.64	0.06
270	000683	远兴能 源	320,700	1,882,509.00	0.06
271	001203	大中矿 业	183,100	1,862,127.00	0.06
272	002531	天顺风 能	160,300	1,859,480.00	0.06
273	000553	安道麦 A	263,778	1,830,619.32	0.06
274	603317	天味食 品	135,565	1,801,658.85	0.06
275	600021	上海电 力	201,500	1,704,690.00	0.05
276	600516	方大炭 素	313,600	1,643,264.00	0.05
277	600038	中直股 份	42,300	1,629,819.00	0.05
278	002414	高德红 外	216,200	1,578,260.00	0.05
279	300024	机器人	124,400	1,476,628.00	0.05
280	300677	英科医 疗	63,000	1,471,680.00	0.05
281	600956	新天绿 能	179,600	1,460,148.00	0.05
282	600998	九州通	208,262	1,459,916.62	0.05
283	300866	安克创 新	15,800	1,399,880.00	0.04
284	000050	深天马 A	129,400	1,378,110.00	0.04
285	600373	中文传 媒	103,600	1,365,448.00	0.04
286	600350	山东高 速	195,283	1,355,264.02	0.04
287	600141	兴发集 团	72,600	1,324,950.00	0.04
288	600546	山煤国	73,000	1,278,230.00	0.04

		际			
289	600416	湘电股份	78,100	1,240,228.00	0.04
290	002607	中公教育	301,700	1,230,936.00	0.04
291	002867	周大生	81,025	1,229,959.50	0.04
292	000970	中科三环	117,100	1,211,985.00	0.04
293	601665	齐鲁银行	303,200	1,185,512.00	0.04
294	600486	扬农化工	17,600	1,110,912.00	0.03
295	600316	洪都航空	51,800	1,096,606.00	0.03
296	300003	乐普医疗	65,900	1,064,944.00	0.03
297	301029	怡合达	40,300	1,038,934.00	0.03
298	605358	立昂微	36,700	1,005,213.00	0.03
299	688248	南方电网电力科技	40,000	998,800.00	0.03
300	300073	当升科技	25,400	970,280.00	0.03
301	603737	三棵树	19,700	937,917.00	0.03
302	002797	第一创业	161,200	936,572.00	0.03
303	002407	多氟多	58,420	889,152.40	0.03
304	603056	德邦股份	60,900	881,223.00	0.03
305	000027	深圳能源	136,600	881,070.00	0.03
306	002008	大族激光	41,000	849,520.00	0.03
307	000519	中兵红箭	59,400	833,976.00	0.03
308	600927	永安期货	50,500	793,355.00	0.02
309	002517	恺英网络	66,000	737,220.00	0.02
310	601158	重庆水务	129,300	733,131.00	0.02
311	600707	彩虹股份	94,100	635,175.00	0.02

312	601933	永辉超市	219,400	618,708.00	0.02
313	000750	国海证券	153,800	544,452.00	0.02
314	003035	南网能源	95,100	500,226.00	0.02
315	600032	浙江新能	57,900	466,674.00	0.01
316	300601	康泰生物	15,400	418,110.00	0.01
317	600959	江苏有线	129,330	406,096.20	0.01
318	600339	中油工程	44,100	133,623.00	0.00
319	300026	红日药业	27,000	114,480.00	0.00
320	002192	融捷股份	1,500	81,315.00	0.00
321	002624	完美世界	6,300	74,592.00	0.00
322	300724	捷佳伟创	800	59,208.00	0.00
323	002831	裕同科技	713	19,614.63	0.00
324	600500	中化国际	3,629	16,040.18	0.00
325	600435	北方导航	600	7,044.00	0.00
326	300861	美畅股份	106	3,528.74	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	002249	大洋电机	2,015,935	10,019,196.95	0.31
2	600623	华谊集团	1,418,800	9,137,072.00	0.28
3	300632	光莆股	645,900	8,151,258.00	0.25

		份			
4	002110	三钢闽光	1,933,000	7,828,650.00	0.24
5	603390	通达电气	744,700	7,484,235.00	0.23
6	603320	迪贝电气	443,200	7,051,312.00	0.22
7	300701	森霸传感	588,400	6,754,832.00	0.21
8	300743	天地数码	480,522	6,669,645.36	0.21
9	300279	和晶科技	1,030,700	6,668,629.00	0.21
10	300708	聚灿光电	578,700	6,527,736.00	0.20
11	601018	宁波港	1,818,500	6,473,860.00	0.20
12	300306	远方信息	530,300	6,406,024.00	0.20
13	002815	崇达技术	649,800	6,225,084.00	0.19
14	603686	福龙马	606,800	6,207,564.00	0.19
15	002817	黄山胶囊	699,260	6,125,517.60	0.19
16	002367	康力电梯	809,400	6,086,688.00	0.19
17	002381	双箭股份	797,300	6,043,534.00	0.19
18	002073	软控股份	908,600	5,969,502.00	0.18
19	300808	久量股份	382,900	5,965,582.00	0.18
20	002171	楚江新材	768,100	5,745,388.00	0.18
21	300246	宝莱特	527,100	5,429,130.00	0.17
22	300424	航新科技	409,000	5,357,900.00	0.17
23	002909	集泰股份	700,200	5,342,526.00	0.17
24	300439	美康生物	451,300	5,239,593.00	0.16
25	300120	经纬辉开	719,600	5,224,296.00	0.16
26	300016	北陆药	730,000	5,197,600.00	0.16

		业			
27	603339	四方科技	431,400	5,129,346.00	0.16
28	603586	金麒麟	319,900	5,118,400.00	0.16
29	300447	全信股份	339,700	4,925,650.00	0.15
30	002067	景兴纸业	1,446,100	4,902,279.00	0.15
31	002443	金洲管道	697,700	4,779,245.00	0.15
32	000682	东方电子	574,500	4,624,725.00	0.14
33	603937	丽岛新材	359,200	4,551,064.00	0.14
34	002879	长缆科技	275,000	4,405,500.00	0.14
35	002394	联发股份	522,300	4,340,313.00	0.13
36	300349	金卡智能	348,000	4,322,160.00	0.13
37	300562	乐心医疗	367,000	4,187,470.00	0.13
38	300615	欣天科技	263,400	4,164,354.00	0.13
39	603677	奇精机械	280,900	4,084,286.00	0.13
40	000561	烽火电子	484,900	4,073,160.00	0.13
41	600469	风神股份	647,900	3,997,543.00	0.12
42	002863	今飞凯达	641,600	3,984,336.00	0.12
43	002842	翔鹭钨业	454,200	3,960,624.00	0.12
44	300154	瑞凌股份	532,700	3,941,980.00	0.12
45	002788	鹭燕医药	437,800	3,935,822.00	0.12
46	603331	百达精工	300,200	3,932,620.00	0.12
47	000589	贵州轮胎	637,800	3,903,336.00	0.12
48	300407	凯发电	410,400	3,874,176.00	0.12

		气			
49	300177	中海达	536,800	3,859,592.00	0.12
50	002763	汇洁股份	455,800	3,833,278.00	0.12
51	600802	福建水泥	739,200	3,829,056.00	0.12
52	300800	力合科技	279,400	3,819,398.00	0.12
53	002730	电光科技	395,500	3,749,340.00	0.12
54	600101	明星电力	445,700	3,748,337.00	0.12
55	002724	海洋王	453,100	3,724,482.00	0.12
56	603579	荣泰健康	177,700	3,701,491.00	0.11
57	603990	麦迪科技	279,260	3,608,039.20	0.11
58	600774	汉商集团	363,800	3,587,068.00	0.11
59	002365	永安药业	365,200	3,571,656.00	0.11
60	300453	三鑫医疗	466,700	3,560,921.00	0.11
61	603817	海峡环保	550,100	3,509,638.00	0.11
62	601101	昊华能源	553,700	3,499,384.00	0.11
63	600016	民生银行	935,300	3,498,022.00	0.11
64	603926	铁流股份	275,800	3,450,258.00	0.11
65	603683	晶华新材	292,900	3,298,054.00	0.10
66	002811	郑中设计	331,450	3,264,782.50	0.10
67	300621	维业股份	283,900	3,262,011.00	0.10
68	603798	康普顿	332,960	3,219,723.20	0.10
69	000990	诚志股份	376,900	3,094,349.00	0.10
70	300018	中元股份	505,900	3,091,049.00	0.10
71	000665	湖北广	638,300	3,063,840.00	0.09

		电			
72	603680	今创集团	317,200	2,997,540.00	0.09
73	300243	瑞丰高材	306,500	2,994,505.00	0.09
74	300543	朗科智能	272,950	2,980,614.00	0.09
75	603706	东方环宇	179,800	2,972,094.00	0.09
76	603987	康德莱	308,900	2,946,906.00	0.09
77	603500	祥和实业	240,400	2,944,900.00	0.09
78	000823	超声电子	306,149	2,929,845.93	0.09
79	000045	深纺织 A	247,700	2,922,860.00	0.09
80	600507	方大特钢	620,800	2,861,888.00	0.09
81	002533	金杯电工	330,400	2,669,632.00	0.08
82	002090	金智科技	265,500	2,649,690.00	0.08
83	603838	四通股份	366,300	2,637,360.00	0.08
84	603333	尚纬股份	461,500	2,635,165.00	0.08
85	002130	沃尔核材	334,600	2,526,230.00	0.08
86	002593	日上集团	615,400	2,467,754.00	0.08
87	300500	启迪设计	171,000	2,450,430.00	0.08
88	603115	海星股份	167,000	2,444,880.00	0.08
89	002297	博云新材	306,400	2,442,008.00	0.08
90	600829	人民同泰	305,800	2,391,356.00	0.07
91	300485	赛升药业	224,500	2,377,455.00	0.07
92	300519	新光药业	139,900	2,318,143.00	0.07
93	300102	乾照光	311,900	2,292,465.00	0.07

		电			
94	002674	兴业科技	187,300	2,279,441.00	0.07
95	300265	通光线缆	241,500	2,236,290.00	0.07
96	600835	上海机电	185,700	2,204,259.00	0.07
97	300611	美力科技	191,300	2,198,037.00	0.07
98	601126	四方股份	154,200	2,183,472.00	0.07
99	603278	大业股份	172,000	2,167,200.00	0.07
100	300358	楚天科技	201,500	2,156,050.00	0.07
101	002057	中钢天源	265,700	2,136,228.00	0.07
102	600480	凌云股份	234,200	2,133,562.00	0.07
103	603520	司太立	150,200	2,114,816.00	0.07
104	300673	佩蒂股份	156,000	2,074,800.00	0.06
105	002452	长高电新	289,800	2,057,580.00	0.06
106	002774	快意电梯	246,250	2,043,875.00	0.06
107	300227	光韵达	259,000	2,030,560.00	0.06
108	600577	精达股份	488,800	2,023,632.00	0.06
109	603515	欧普照明	115,700	2,010,866.00	0.06
110	300802	矩子科技	104,000	1,988,480.00	0.06
111	002801	微光股份	91,200	1,983,600.00	0.06
112	603790	雅运股份	138,400	1,938,984.00	0.06
113	600351	亚宝药业	274,300	1,892,670.00	0.06
114	000404	长虹华意	319,400	1,881,266.00	0.06
115	300452	山河药辅	129,900	1,849,776.00	0.06

116	603017	中衡设计	183,500	1,836,835.00	0.06
117	300753	爱朋医疗	106,800	1,833,756.00	0.06
118	002860	星帅尔	139,200	1,802,640.00	0.06
119	603685	晨丰科技	117,600	1,798,104.00	0.06
120	002093	国脉科技	236,700	1,779,984.00	0.05
121	002949	华阳国际	126,600	1,768,602.00	0.05
122	300564	筑博设计	130,500	1,756,530.00	0.05
123	300272	开能健康	282,100	1,749,020.00	0.05
124	603303	得邦照明	131,100	1,684,635.00	0.05
125	600054	黄山旅游	151,500	1,648,320.00	0.05
126	300193	佳士科技	209,500	1,627,815.00	0.05
127	300566	激智科技	86,700	1,619,556.00	0.05
128	002357	富临运业	213,000	1,608,150.00	0.05
129	603159	上海亚虹	96,900	1,589,160.00	0.05
130	603933	睿能科技	101,500	1,578,325.00	0.05
131	002206	海利得	304,200	1,527,084.00	0.05
132	300810	中科海讯	74,000	1,509,600.00	0.05
133	300717	华信新材	88,900	1,492,631.00	0.05
134	300736	百邦科技	113,500	1,449,395.00	0.04
135	603089	正裕工业	125,200	1,437,296.00	0.04
136	601339	百隆东方	291,600	1,420,092.00	0.04
137	603192	汇得科技	71,000	1,395,150.00	0.04
138	601218	吉鑫科	344,200	1,376,800.00	0.04

		技			
139	603917	合力科技	75,300	1,337,328.00	0.04
140	603886	元祖股份	71,700	1,307,091.00	0.04
141	300577	开润股份	87,500	1,283,625.00	0.04
142	300422	博世科	213,500	1,278,865.00	0.04
143	002231	奥维通信	177,000	1,155,810.00	0.04
144	300414	中光防雷	118,800	1,144,044.00	0.04
145	000788	北大医药	169,800	1,139,358.00	0.04
146	300430	诚益通	79,600	1,137,484.00	0.04
147	000551	创元科技	107,300	1,123,431.00	0.03
148	300641	正丹股份	194,900	1,099,236.00	0.03
149	300787	海能实业	63,900	1,074,798.00	0.03
150	300119	瑞普生物	64,900	1,063,711.00	0.03
151	000952	广济药业	132,400	1,057,876.00	0.03
152	002736	国信证券	122,100	1,042,734.00	0.03
153	600493	凤竹纺织	154,200	1,036,224.00	0.03
154	300245	天玑科技	111,800	986,076.00	0.03
155	600746	江苏索普	133,800	979,416.00	0.03
156	603829	洛凯股份	57,200	934,076.00	0.03
157	603758	秦安股份	78,800	901,472.00	0.03
158	603676	卫信康	82,600	861,518.00	0.03
159	002224	三力士	167,200	851,048.00	0.03
160	600628	新世界	120,500	844,705.00	0.03
161	000597	东北制药	149,700	800,895.00	0.02
162	300412	迦南科	133,900	761,891.00	0.02

		技			
163	600894	广日股份	103,000	757,050.00	0.02
164	603955	大千生态	46,500	683,085.00	0.02
165	002706	良信股份	76,700	677,261.00	0.02
166	002441	众业达	65,800	623,126.00	0.02
167	603700	宁水集团	42,300	603,621.00	0.02
168	002196	方正电机	82,400	591,632.00	0.02
169	603041	美思德	42,600	573,396.00	0.02
170	603166	福达股份	78,700	543,817.00	0.02
171	000019	深粮控股	70,600	532,324.00	0.02
172	002448	中原内配	76,800	509,952.00	0.02
173	002216	三全食品	37,500	502,500.00	0.02
174	002276	万马股份	47,600	486,472.00	0.02
175	002857	三晖电气	28,900	476,850.00	0.01
176	002798	帝欧家居	68,600	449,330.00	0.01
177	002398	垒知集团	93,000	443,610.00	0.01
178	002393	力生制药	16,800	438,480.00	0.01
179	000576	甘化科工	44,500	413,850.00	0.01
180	002017	东信和平	38,400	399,744.00	0.01
181	300532	今天国际	23,400	384,228.00	0.01
182	002390	信邦制药	86,400	383,616.00	0.01
183	600379	宝光股份	37,400	375,870.00	0.01
184	603328	依顿电子	45,900	374,085.00	0.01

185	600059	古越龙山	38,800	360,840.00	0.01
186	002787	华源控股	36,900	338,373.00	0.01
187	300233	金城医药	19,700	328,202.00	0.01
188	002826	易明医药	27,200	322,864.00	0.01
189	300095	华伍股份	38,200	314,386.00	0.01
190	002923	润都股份	24,500	302,330.00	0.01
191	300667	必创科技	17,500	300,300.00	0.01
192	603727	博迈科	23,500	294,455.00	0.01
193	002626	金达威	17,800	290,674.00	0.01
194	600965	福成股份	43,400	273,854.00	0.01
195	601869	长飞光纤	9,900	271,854.00	0.01
196	002963	豪尔赛	17,400	269,700.00	0.01
197	000973	佛塑科技	52,200	255,258.00	0.01
198	002753	永东股份	30,775	253,893.75	0.01
199	603360	百傲化学	23,800	251,566.00	0.01
200	002961	瑞达期货	16,000	238,400.00	0.01
201	002695	煌上煌	22,250	232,957.50	0.01
202	603387	基蛋生物	21,100	232,100.00	0.01
203	601952	苏垦农发	21,200	217,088.00	0.01
204	603909	建发合诚	17,830	202,548.80	0.01
205	603165	荣晟环保	16,600	198,868.00	0.01
206	002165	红宝丽	46,000	194,580.00	0.01
207	300642	透景生命	11,000	194,150.00	0.01
208	300711	广哈通信	14,500	193,575.00	0.01

209	002227	奥特迅	14,000	187,180.00	0.01
210	300626	华瑞股份	16,100	174,685.00	0.01
211	300230	永利股份	39,500	159,185.00	0.00
212	300789	唐源电气	6,600	148,764.00	0.00
213	603811	诚意药业	13,700	142,069.00	0.00
214	000601	韶能股份	31,200	133,536.00	0.00
215	605287	德才股份	7,740	131,347.80	0.00
216	300889	爱克股份	7,800	131,040.00	0.00
217	603976	正川股份	6,500	128,115.00	0.00
218	300501	海顺新材	8,000	115,440.00	0.00
219	300746	汉嘉设计	11,000	110,550.00	0.00
220	603217	元利科技	5,800	105,792.00	0.00
221	603183	建研院	22,200	103,674.00	0.00
222	000920	沃顿科技	10,000	99,300.00	0.00
223	603506	南都物业	8,900	96,743.00	0.00
224	300771	智莱科技	8,400	91,308.00	0.00
225	300732	设研院	10,200	90,066.00	0.00
226	603580	艾艾精工	6,000	89,340.00	0.00
227	300706	阿石创	3,300	85,404.00	0.00
228	002492	恒基达鑫	14,100	84,459.00	0.00
229	600235	民丰特纸	13,700	84,118.00	0.00
230	300107	建新股份	15,500	82,615.00	0.00
231	688011	新光光电科技股份	2,900	68,585.00	0.00

232	600735	新华锦	7,700	49,665.00	0.00
233	603900	莱绅通灵	6,900	46,092.00	0.00
234	603679	华体科技	2,500	37,325.00	0.00
235	603221	爱丽家居	3,500	34,790.00	0.00
236	002846	英联股份	2,900	31,755.00	0.00
237	603577	汇金通	3,000	31,200.00	0.00
238	002480	新筑股份	6,000	30,360.00	0.00
239	300385	雪浪环境	4,500	30,240.00	0.00
240	300030	阳普医疗	3,500	27,125.00	0.00
241	000877	天山股份	3,800	25,384.00	0.00
242	600210	紫江企业	5,400	25,380.00	0.00
243	600195	中牧股份	2,100	24,906.00	0.00
244	603823	百合花	2,500	24,600.00	0.00
245	300239	东宝生物	3,900	24,297.00	0.00
246	300910	瑞丰新材	501	23,015.94	0.00
247	000061	农产品	3,400	21,998.00	0.00
248	600201	生物股份	2,000	21,540.00	0.00
249	600785	新华百货	1,400	20,720.00	0.00
250	603698	航天工程	1,400	20,118.00	0.00
251	300086	康芝药业	2,800	16,436.00	0.00
252	600717	天津港	3,946	16,218.06	0.00
253	300622	博士眼镜	800	15,864.00	0.00
254	300137	先河环保	2,800	15,568.00	0.00
255	603067	振华股份	1,500	15,285.00	0.00

256	002802	洪汇新材	1,178	15,090.18	0.00
257	002649	博彦科技	1,200	14,724.00	0.00
258	300911	亿田智能	309	11,627.67	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600879	航天电子	59,615,290.00	1.84
2	600489	中金黄金	55,241,024.10	1.71
3	300308	中际旭创	53,164,947.36	1.64
4	600498	烽火通信	52,482,402.00	1.62
5	601058	赛轮轮胎	51,425,233.00	1.59
6	600528	中铁工业	49,908,594.08	1.54
7	600642	申能股份	48,953,471.00	1.51
8	600487	亨通光电	48,424,857.44	1.50
9	002138	顺络电子	48,237,043.00	1.49
10	002439	启明星辰	48,158,474.98	1.49
11	600497	驰宏锌锗	47,438,257.80	1.47
12	002028	思源电气	46,385,597.00	1.43
13	601231	环旭电子	44,586,444.05	1.38
14	300699	光威复材	44,174,302.80	1.36
15	600390	五矿资本	43,503,851.00	1.34
16	002422	科伦药业	43,072,472.05	1.33
17	600801	华新水泥	42,272,012.72	1.31
18	300296	利亚德	40,986,073.00	1.27
19	000830	鲁西化工	40,637,501.99	1.26
20	600271	航天信息	40,285,479.21	1.24

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002340	格林美	61,844,099.47	1.91

2	002439	启明星辰	59,404,321.05	1.83
3	600489	中金黄金	55,345,982.34	1.71
4	000027	深圳能源	54,533,779.00	1.68
5	300308	中际旭创	52,988,847.38	1.64
6	002384	东山精密	51,844,827.00	1.60
7	600487	亨通光电	47,716,706.00	1.47
8	002465	海格通信	46,502,892.98	1.44
9	002625	光启技术	46,219,671.00	1.43
10	600637	东方明珠	46,015,877.19	1.42
11	002028	思源电气	45,578,053.63	1.41
12	600820	隧道股份	44,677,590.00	1.38
13	000728	国元证券	43,415,082.00	1.34
14	600390	五矿资本	42,545,197.00	1.31
15	000156	华数传媒	42,227,799.02	1.30
16	600528	中铁工业	41,486,073.00	1.28
17	601607	上海医药	41,231,565.00	1.27
18	002025	航天电器	40,861,235.82	1.26
19	600879	航天电子	40,728,018.00	1.26
20	600959	江苏有线	39,093,647.95	1.21

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	11,409,999,308.45
卖出股票收入（成交）总额	11,051,384,097.13

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	8,041,863.01	0.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-

10	其他	-	-
11	合计	8,041,863.01	0.25

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	019709	23 国债 16	80,000	8,041,863.01	0.25

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

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	461,949.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,974,748.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,436,698.05

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 投资组合报告（转型前）

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	2,779,230,965.05	92.20
	其中：股票	2,779,230,965.05	92.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,513,790.59	1.74
	其中：债券	52,513,790.59	1.74
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	181,688,965.75	6.03
8	其他各项资产	945,607.34	0.03
9	合计	3,014,379,328.73	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	16,470,924.00	0.55
B	采矿业	45,018,863.33	1.50
C	制造业	1,939,547,301.40	64.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,000,563.41	2.63
E	建筑业	34,109,283.52	1.13
F	批发和零售业	104,046,447.52	3.46
G	交通运输、仓储和邮政业	62,692,515.20	2.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	132,148,761.29	4.39
J	金融业	191,219,063.14	6.36
K	房地产业	32,199,724.35	1.07
L	租赁和商务服务业	21,411,522.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	16,562,744.92	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	15,300,640.03	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	32,040.42	0.00
R	文化、体育和娱乐业	57,685,750.52	1.92
S	综合	31,784,820.00	1.06
	合计	2,779,230,965.05	92.41

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末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	002340	格林美	4,017,217	28,281,207.68	0.94
2	300003	乐普医疗	1,130,400	26,507,880.00	0.88
3	002384	东山精密	1,048,900	26,201,522.00	0.87
4	601607	上海医药	1,150,740	25,189,698.60	0.84
5	002439	启明星	680,300	22,790,050.00	0.76

		辰			
6	688009	中国通号	3,491,300	22,588,711.00	0.75
7	000009	中国宝安	2,090,500	22,326,540.00	0.74
8	002078	太阳纸业	1,903,200	21,886,800.00	0.73
9	600482	中国动力	1,314,093	21,445,997.76	0.71
10	600820	隧道股份	3,307,400	21,266,582.00	0.71
11	000728	国元证券	3,133,886	21,185,069.36	0.70
12	000729	燕京啤酒	1,654,400	21,176,320.00	0.70
13	002212	天融信	1,736,045	21,023,504.95	0.70
14	002273	水晶光电	1,648,681	20,872,301.46	0.69
15	002444	巨星科技	1,061,200	20,778,296.00	0.69
16	002025	航天电器	340,414	20,656,321.52	0.69
17	002625	光启技术	1,257,900	20,616,981.00	0.69
18	600637	东方明珠	2,516,220	20,607,841.80	0.69
19	600959	江苏有线	5,519,100	20,586,243.00	0.68
20	600867	通化东宝	1,747,341	20,583,676.98	0.68
21	000783	长江证券	3,782,584	20,577,256.96	0.68
22	600143	金发科技	2,336,300	20,395,899.00	0.68
23	300285	国瓷材料	757,100	20,358,419.00	0.68
24	600885	宏发股份	661,338	20,303,076.60	0.68
25	000878	云南铜业	1,562,700	20,236,965.00	0.67
26	600380	健康元	1,546,099	20,114,747.99	0.67
27	300088	长信科技	3,084,700	19,958,009.00	0.66

28	603456	九洲药业	618,900	19,922,391.00	0.66
29	601098	中南传媒	1,545,700	19,568,562.00	0.65
30	000738	航发控制	861,818	19,563,268.60	0.65
31	002532	天山铝业	2,538,100	19,467,227.00	0.65
32	002557	洽洽食品	460,427	19,420,810.86	0.65
33	000027	深圳能源	3,073,000	19,390,630.00	0.64
34	002739	万达电影	1,428,400	19,354,820.00	0.64
35	603858	步长制药	953,700	19,255,203.00	0.64
36	000636	风华高科	1,153,227	19,108,971.39	0.64
37	600352	浙江龙盛	1,832,200	19,073,202.00	0.63
38	600079	人福医药	704,700	19,012,806.00	0.63
39	000997	新大陆	1,190,800	18,969,444.00	0.63
40	600549	厦门钨业	961,100	18,895,226.00	0.63
41	002926	华西证券	2,416,900	18,875,989.00	0.63
42	601168	西部矿业	1,442,400	18,808,896.00	0.63
43	600390	五矿资本	3,588,400	18,767,332.00	0.62
44	000156	华数传媒	2,015,292	18,762,368.52	0.62
45	300296	利亚德	2,884,500	18,720,405.00	0.62
46	600699	均胜电子	1,305,600	18,591,744.00	0.62
47	601717	郑煤机	1,353,200	18,525,308.00	0.62
48	000970	中科三环	1,489,175	18,435,986.50	0.61
49	600765	中航重机	760,200	18,389,238.00	0.61
50	000830	鲁西化工	1,551,501	18,323,226.81	0.61

51	600580	卧龙电驱	1,525,800	18,218,052.00	0.61
52	603218	日月股份	890,400	18,164,160.00	0.60
53	000598	兴蓉环境	3,495,000	17,964,300.00	0.60
54	002831	裕同科技	711,093	17,955,098.25	0.60
55	000401	冀东水泥	2,050,400	17,797,472.00	0.59
56	600521	华海药业	917,900	17,614,501.00	0.59
57	000785	居然之家	4,221,900	17,520,885.00	0.58
58	002511	中顺洁柔	1,524,500	17,379,300.00	0.58
59	600500	中化国际	2,720,929	17,359,527.02	0.58
60	002249	大洋电机	3,544,935	17,192,934.75	0.57
61	000089	深圳机场	2,361,800	17,123,050.00	0.57
62	002250	联化科技	1,335,600	17,095,680.00	0.57
63	600967	内蒙一机	1,801,700	17,044,082.00	0.57
64	600655	豫园股份	2,161,379	16,945,211.36	0.56
65	603228	景旺电子	697,223	16,872,796.60	0.56
66	600195	中牧股份	1,263,600	16,742,700.00	0.56
67	601997	贵阳银行	3,010,712	16,679,344.48	0.55
68	600377	宁沪高速	1,890,302	16,672,463.64	0.55
69	688208	道通科技	615,500	16,649,275.00	0.55
70	600409	三友化工	2,765,600	16,648,912.00	0.55
71	300463	迈克生物	959,300	16,451,995.00	0.55
72	601118	海南橡胶	3,628,400	16,436,652.00	0.55

73	600350	山东高速	2,406,100	16,289,297.00	0.54
74	002507	涪陵榨菜	682,700	16,289,222.00	0.54
75	603317	天味食品	978,180	16,247,569.80	0.54
76	002203	海亮股份	1,441,623	16,117,345.14	0.54
77	000959	首钢股份	4,351,900	16,102,030.00	0.54
78	002416	爱施德	1,902,800	16,078,660.00	0.53
79	002048	宁波华翔	1,192,435	15,954,780.30	0.53
80	600517	国网英大	3,223,800	15,861,096.00	0.53
81	601187	厦门银行	2,902,500	15,847,650.00	0.53
82	688567	孚能科技	764,600	15,827,220.00	0.53
83	600398	海澜之家	2,473,900	15,758,743.00	0.52
84	600062	华润双鹤	764,258	15,728,429.64	0.52
85	002110	三钢闽光	3,224,800	15,640,280.00	0.52
86	002745	木林森	1,912,000	15,640,160.00	0.52
87	688819	天能电池集团股份	493,400	15,630,912.00	0.52
88	000559	万向钱潮	3,112,200	15,592,122.00	0.52
89	002925	盈趣科技	860,670	15,578,127.00	0.52
90	600808	马钢股份	5,759,400	15,550,380.00	0.52
91	000967	盈峰环境	2,968,900	15,260,146.00	0.51
92	600316	洪都航空	607,936	15,040,336.64	0.50
93	000869	张裕 A	519,948	15,005,699.28	0.50
94	002056	横店东磁	778,100	14,962,863.00	0.50

95	601699	潞安环能	772,200	14,656,356.00	0.49
96	000623	吉林敖东	883,840	14,486,137.60	0.48
97	600582	天地科技	2,868,400	14,342,000.00	0.48
98	000917	电广传媒	2,297,700	14,199,786.00	0.47
99	002399	海普瑞	1,085,600	14,025,952.00	0.47
100	600376	首开股份	3,146,700	14,002,815.00	0.47
101	000801	四川九洲	2,055,600	13,895,856.00	0.46
102	300439	美康生物	1,149,100	13,800,691.00	0.46
103	601567	三星医疗	1,115,023	13,703,632.67	0.46
104	000823	超声电子	1,393,600	13,601,536.00	0.45
105	000062	深圳华强	1,009,506	13,396,144.62	0.45
106	600623	华谊集团	2,034,100	13,364,037.00	0.44
107	300869	康泰医学	587,000	13,354,250.00	0.44
108	002563	森马服饰	2,228,574	13,349,158.26	0.44
109	002028	思源电气	298,500	13,339,965.00	0.44
110	600114	东睦股份	1,522,440	13,214,779.20	0.44
111	002497	雅化集团	640,100	12,853,208.00	0.43
112	002376	新北洋	1,677,700	12,700,189.00	0.42
113	603712	七一二	371,900	12,588,815.00	0.42
114	002465	海格通信	1,292,319	12,354,569.64	0.41
115	002412	汉森制药	1,888,900	12,126,738.00	0.40
116	300258	精锻科技	1,247,000	11,958,730.00	0.40
117	603667	五洲新春	1,015,172	11,847,057.24	0.39

118	603118	共进股份	1,386,600	11,827,698.00	0.39
119	300026	红日药业	1,980,800	11,686,720.00	0.39
120	300193	佳士科技	1,515,354	11,516,690.40	0.38
121	002385	大北农	1,631,300	11,419,100.00	0.38
122	300146	汤臣倍健	531,100	11,397,406.00	0.38
123	300888	稳健医疗	186,400	11,239,920.00	0.37
124	601298	青岛港	1,669,900	11,188,330.00	0.37
125	601198	东兴证券	1,406,000	11,107,400.00	0.37
126	002531	天顺风能	877,100	11,060,231.00	0.37
127	600909	华安证券	2,270,100	10,896,480.00	0.36
128	600956	新天绿能	1,217,898	10,790,576.28	0.36
129	000898	鞍钢股份	3,571,100	10,641,878.00	0.35
130	002017	东信和平	623,300	10,465,207.00	0.35
131	600299	安迪苏	1,147,800	10,376,112.00	0.35
132	600742	一汽富维	1,307,200	10,235,376.00	0.34
133	603156	养元饮品	407,611	10,235,112.21	0.34
134	002614	奥佳华	1,247,300	10,053,238.00	0.33
135	002661	克明食品	892,200	10,019,406.00	0.33
136	600775	南京熊猫	993,900	9,839,610.00	0.33
137	002422	科伦药业	325,800	9,774,000.00	0.32
138	601139	深圳燃气	1,428,756	9,715,540.80	0.32
139	605222	起帆电缆	468,300	9,703,176.00	0.32
140	600789	鲁抗医药	1,411,200	9,567,936.00	0.32
141	600673	东阳光	1,222,000	9,458,280.00	0.31

142	600170	上海建工	3,352,700	9,454,614.00	0.31
143	601163	三角轮胎	721,500	9,328,995.00	0.31
144	603596	伯特利	145,200	9,305,868.00	0.31
145	600707	彩虹股份	1,986,200	9,116,658.00	0.30
146	300035	中科电气	597,000	9,068,430.00	0.30
147	603367	辰欣药业	610,400	9,009,504.00	0.30
148	002500	山西证券	1,587,564	8,779,228.92	0.29
149	000612	焦作万方	1,677,871	8,724,929.20	0.29
150	600153	建发股份	701,289	8,710,009.38	0.29
151	002675	东诚药业	551,800	8,608,080.00	0.29
152	000402	金融街	1,711,900	8,542,381.00	0.28
153	000887	中鼎股份	722,700	8,412,228.00	0.28
154	603013	亚普股份	588,500	8,327,275.00	0.28
155	600167	联美控股	1,397,400	8,300,556.00	0.28
156	002171	楚江新材	1,187,100	8,238,474.00	0.27
157	600835	上海机电	613,600	8,062,704.00	0.27
158	002540	亚太科技	1,360,100	8,024,590.00	0.27
159	000563	陕国投 A	2,560,835	7,938,588.50	0.26
160	002516	旷达科技	1,555,600	7,575,772.00	0.25
161	603299	苏盐井神	772,900	7,566,691.00	0.25
162	600829	人民同泰	1,132,501	7,542,456.66	0.25
163	603866	桃李面包	515,400	7,107,366.00	0.24
164	002673	西部证	1,115,604	7,039,461.24	0.23

		券			
165	300323	华灿光电	1,007,450	6,921,181.50	0.23
166	300183	东软载波	430,200	6,788,556.00	0.23
167	603060	国检集团	557,627	6,579,998.60	0.22
168	300215	电科院	1,267,300	6,336,500.00	0.21
169	000990	诚志股份	756,800	6,228,464.00	0.21
170	000968	蓝焰控股	797,200	6,226,132.00	0.21
171	600201	生物股份	598,600	6,165,580.00	0.21
172	603002	宏昌电子	1,123,500	6,156,780.00	0.20
173	603707	健友股份	401,414	5,900,785.80	0.20
174	600566	济川药业	184,900	5,848,387.00	0.19
175	603308	应流股份	320,320	5,845,840.00	0.19
176	600067	冠城大通	1,924,900	5,755,451.00	0.19
177	603989	艾华集团	252,600	5,577,408.00	0.19
178	600308	华泰股份	1,075,500	5,528,070.00	0.18
179	600399	抚顺特钢	522,300	5,499,819.00	0.18
180	600879	航天电子	723,763	5,478,885.91	0.18
181	601555	东吴证券	768,234	5,469,826.08	0.18
182	600985	淮北矿业	403,500	5,326,200.00	0.18
183	600597	光明乳业	520,800	5,270,496.00	0.18
184	002966	苏州银行	720,880	5,204,753.60	0.17
185	603901	永创智能	373,000	5,169,780.00	0.17
186	300682	朗新科	225,200	5,107,536.00	0.17

		技			
187	600008	首创环 保	1,713,200	5,053,940.00	0.17
188	002688	金河生 物	946,000	4,701,620.00	0.16
189	600369	西南证 券	1,281,000	4,701,270.00	0.16
190	603020	爱普股 份	511,500	4,654,650.00	0.15
191	000417	合肥百 货	915,900	4,213,140.00	0.14
192	002979	雷赛智 能	209,300	4,190,186.00	0.14
193	603583	捷昌驱 动	187,353	4,104,904.23	0.14
194	600894	广日股 份	585,850	4,059,940.50	0.13
195	600801	华新水 泥	262,400	3,928,128.00	0.13
196	600057	厦门象 屿	387,900	3,890,637.00	0.13
197	603528	多伦科 技	513,700	3,868,161.00	0.13
198	688002	睿创微 纳	79,900	3,660,219.00	0.12
199	603127	昭衍新 药	69,096	3,633,067.68	0.12
200	002788	鹭燕医 药	390,005	3,576,345.85	0.12
201	002768	国恩股 份	137,300	3,451,722.00	0.11
202	603883	老百姓	101,600	3,416,808.00	0.11
203	002440	闰土股 份	461,200	3,412,880.00	0.11
204	300055	万邦达	413,200	3,247,752.00	0.11
205	600998	九州通	200,000	3,218,000.00	0.11
206	600027	华电国 际	528,900	3,210,423.00	0.11
207	601609	金田股 份	434,900	2,879,038.00	0.10
208	300455	康拓红 外	305,000	2,845,650.00	0.09
209	603658	安图生	49,000	2,807,210.00	0.09

		物			
210	603612	索通发展	127,300	2,712,763.00	0.09
211	002454	松芝股份	392,200	2,690,492.00	0.09
212	603515	欧普照明	144,269	2,599,727.38	0.09
213	600488	津药药业	557,800	2,565,880.00	0.09
214	000883	湖北能源	553,100	2,345,144.00	0.08
215	600567	山鹰国际	966,600	2,252,178.00	0.07
216	002993	奥海科技	72,430	2,215,633.70	0.07
217	603355	莱克电气	79,180	2,181,409.00	0.07
218	600643	爱建集团	412,300	2,148,083.00	0.07
219	601158	重庆水务	384,000	2,073,600.00	0.07
220	600590	泰豪科技	323,067	1,967,478.03	0.07
221	600649	城投控股	485,111	1,867,677.35	0.06
222	600419	天润乳业	88,310	1,779,446.50	0.06
223	300102	乾照光电	283,300	1,773,458.00	0.06
224	002019	亿帆医药	118,100	1,762,052.00	0.06
225	002462	嘉事堂	105,900	1,612,857.00	0.05
226	600990	四创电子	49,800	1,568,700.00	0.05
227	600748	上实发展	441,600	1,541,184.00	0.05
228	300072	海新能科	406,000	1,477,840.00	0.05
229	601106	中国一重	434,300	1,446,219.00	0.05
230	600261	阳光照明	444,500	1,440,180.00	0.05
231	002651	利君股	202,500	1,405,350.00	0.05

		份			
232	688031	星环科技	12,047	1,382,031.84	0.05
233	603948	建业股份	60,500	1,300,750.00	0.04
234	300602	飞荣达	58,800	1,178,940.00	0.04
235	300699	光威复材	22,000	1,117,380.00	0.04
236	601006	大秦铁路	108,300	819,831.00	0.03
237	002223	鱼跃医疗	26,500	799,770.00	0.03
238	600862	中航高科	35,444	754,248.32	0.03
239	300373	扬杰科技	14,300	661,947.00	0.02
240	300552	万集科技	26,900	601,215.00	0.02
241	601333	广深铁路	245,600	599,264.00	0.02
242	603638	艾迪精密	34,600	562,596.00	0.02
243	600741	华域汽车	29,300	481,106.00	0.02
244	688146	中船派瑞特气	7,954	402,493.88	0.01
245	001914	招商积余	24,200	375,584.00	0.01
246	002106	莱宝高科	42,000	348,180.00	0.01
247	688352	颀中科技	23,609	341,622.09	0.01
248	688029	南微医学科技	4,200	333,732.00	0.01
249	002867	周大生	20,000	310,000.00	0.01
250	603610	麒盛科技	26,500	298,920.00	0.01
251	600668	尖峰集团	17,600	215,952.00	0.01
252	301307	美利信	6,865	202,160.01	0.01
253	600022	山东钢铁	123,500	190,190.00	0.01
254	300791	仙乐健	3,700	127,835.00	0.00

		康			
255	600370	三房巷	41,300	119,357.00	0.00
256	600510	黑牡丹	17,800	114,632.00	0.00
257	002081	金螳螂	20,000	105,600.00	0.00
258	600056	中国医药	7,300	103,806.00	0.00
259	301360	荣旗科技	1,340	96,319.20	0.00
260	000657	中钨高新	6,500	86,190.00	0.00
261	002252	上海莱士	13,400	84,956.00	0.00
262	600161	天坛生物	3,180	84,874.20	0.00
263	002550	千红制药	13,300	77,140.00	0.00
264	300319	麦捷科技	8,800	75,680.00	0.00
265	000012	南玻 A	10,946	72,353.06	0.00
266	600073	上海梅林	7,600	63,460.00	0.00
267	300219	鸿利智汇	8,800	62,480.00	0.00
268	301367	怡和嘉业	223	57,808.29	0.00
269	603267	鸿远电子	800	57,304.00	0.00
270	601128	常熟银行	7,400	57,128.00	0.00
271	301165	锐捷网络	849	55,142.55	0.00
272	002430	杭氧股份	1,300	48,620.00	0.00
273	002138	顺络电子	2,200	48,136.00	0.00
274	603125	江苏常青树科技	1,596	47,838.48	0.00
275	600875	东方电气	2,640	45,381.60	0.00
276	300910	瑞丰新材	474	44,082.00	0.00

277	000600	建投能源	7,400	43,216.00	0.00
278	600219	南山铝业	12,600	43,092.00	0.00
279	002797	第一创业	7,480	42,486.40	0.00
280	600917	重庆燃气	5,725	41,277.25	0.00
281	600901	江苏金租	6,200	40,052.00	0.00
282	688507	索辰科技	145	39,582.10	0.00
283	002020	京新药业	2,600	39,156.00	0.00
284	601126	四方股份	2,800	38,052.00	0.00
285	600536	中国软件	600	36,504.00	0.00
286	000791	甘肃能源	7,200	36,360.00	0.00
287	600108	亚盛集团	11,200	34,272.00	0.00
288	001286	陕西能源	3,767	34,166.69	0.00
289	002551	尚荣医疗	8,400	34,104.00	0.00
290	301301	川宁生物	3,574	32,630.62	0.00
291	601827	三峰环境	4,400	32,384.00	0.00
292	301267	华夏眼科	441	31,372.74	0.00
293	002669	康达新材	2,400	30,120.00	0.00
294	301260	格力博	1,328	29,043.36	0.00
295	000060	中金岭南	5,950	28,976.50	0.00
296	601005	重庆钢铁	18,600	27,714.00	0.00
297	301358	湖南裕能	764	27,083.80	0.00
298	600877	电科芯片	1,900	26,334.00	0.00

299	603137	恒尚节能	1,382	26,189.84	0.00
300	301356	天振股份	540	26,071.20	0.00
301	688484	南芯科技	687	25,528.92	0.00
302	001287	中电港	1,206	23,912.80	0.00
303	301389	隆扬电子	1,269	23,666.85	0.00
304	301391	卡莱特	247	22,064.51	0.00
305	601061	中信金属	2,775	19,397.25	0.00
306	301317	鑫磊股份	694	15,989.76	0.00
307	301396	宏景科技	396	15,942.96	0.00
308	301311	昆船智能	832	15,741.44	0.00
309	002802	洪汇新材	1,128	15,374.64	0.00
310	301439	泓淋电力	949	15,155.53	0.00
311	301377	鼎泰高科	770	14,930.30	0.00
312	301335	天元宠物	420	14,830.20	0.00
313	301280	珠城科技	279	13,258.08	0.00
314	301365	矩阵股份	516	13,178.64	0.00
315	301277	新天地	439	12,928.55	0.00
316	300911	亿田智能	309	12,338.37	0.00
317	301345	涛涛车业	266	11,977.98	0.00
318	301379	天山电子	449	11,651.55	0.00
319	301290	东星医疗	330	11,566.50	0.00
320	603135	中重科技	628	10,192.44	0.00
321	688535	华海诚科新材	161	10,052.84	0.00

		料			
322	301265	华新环 保	819	9,721.53	0.00
323	688433	华曙高 科	418	9,609.82	0.00
324	601133	柏诚系 统股份 公司	664	8,545.68	0.00
325	301373	凌玮科 技	277	8,470.66	0.00
326	301281	科源制 药	241	8,042.17	0.00
327	301368	丰立智 能	337	7,777.96	0.00
328	301203	国泰环 保	225	7,735.50	0.00
329	301157	华塑科 技	150	7,602.00	0.00
330	301398	星源卓 镁	255	7,479.15	0.00
331	301388	欣灵电 气	292	6,753.96	0.00
332	603589	口子窖	98	5,789.84	0.00
333	001328	登康口 腔	145	3,616.30	0.00
334	001360	南矿集 团	177	2,810.76	0.00
335	001367	海森药 业	55	2,415.05	0.00
336	002240	盛新锂 能	64	2,186.88	0.00
337	300856	科思股 份	34	2,105.96	0.00
338	300861	美畅股 份	37	1,724.20	0.00
339	600271	航天信 息	94	1,416.58	0.00
340	600118	中国卫 星	43	1,161.43	0.00
341	300639	凯普生 物	62	1,023.00	0.00
342	601065	江西省 盐业集 团	88	868.56	0.00

343	000553	安道麦 A	78	691.08	0.00
344	300244	迪安诊断	24	667.68	0.00
345	600177	雅戈尔	92	614.56	0.00
346	600489	中金黄金	51	573.75	0.00
347	600155	华创阳安	88	567.60	0.00
348	600037	歌华有线	53	523.64	0.00
349	002233	塔牌集团	64	499.84	0.00
350	600642	申能股份	77	490.49	0.00
351	600305	恒顺醋业	40	451.60	0.00
352	000937	冀中能源	61	448.96	0.00
353	000888	峨眉山 A	43	374.53	0.00
354	601608	中信重工	91	351.26	0.00
355	601016	节能风电	90	342.90	0.00
356	600497	驰宏锌锗	47	256.62	0.00
357	600717	天津港	46	216.20	0.00
358	600720	祁连山	19	210.71	0.00
359	601058	赛轮轮胎	13	130.78	0.00
360	600103	青山纸业	30	78.60	0.00
361	000088	盐田港	12	63.36	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600885	宏发股份	44,502,928.86	5.61

2	600498	烽火通信	38,288,878.81	4.83
3	601607	上海医药	36,790,042.60	4.64
4	002340	格林美	35,176,877.11	4.43
5	300146	汤臣倍健	34,531,232.00	4.35
6	002384	东山精密	33,519,838.24	4.22
7	000728	国元证券	31,709,095.64	4.00
8	002025	航天电器	31,418,541.20	3.96
9	601555	东吴证券	31,345,290.50	3.95
10	600435	北方导航	30,754,139.00	3.88
11	002511	中顺洁柔	30,429,610.00	3.83
12	000009	中国宝安	30,402,345.00	3.83
13	000062	深圳华强	30,247,181.99	3.81
14	002212	天融信	29,398,785.73	3.71
15	002422	科伦药业	29,310,816.28	3.69
16	300003	乐普医疗	28,675,435.00	3.61
17	600985	淮北矿业	28,181,462.00	3.55
18	600390	五矿资本	28,137,851.00	3.55
19	600879	航天电子	28,012,334.91	3.53
20	002926	华西证券	27,922,122.00	3.52
21	002439	启明星辰	27,806,715.00	3.50
22	600143	金发科技	27,362,199.00	3.45
23	300285	国瓷材料	27,206,548.00	3.43
24	002557	洽洽食品	27,206,425.11	3.43
25	300296	利亚德	27,192,331.00	3.43
26	002138	顺络电子	27,191,047.00	3.43
27	603456	九洲药业	26,555,875.13	3.35
28	000997	新大陆	26,508,577.00	3.34
29	600655	豫园股份	25,709,812.74	3.24
30	601997	贵阳银行	25,652,198.00	3.23
31	002532	天山铝业	25,307,066.00	3.19
32	600195	中牧股份	25,214,317.55	3.18
33	002203	海亮股份	25,196,828.35	3.18
34	600867	通化东宝	25,110,665.59	3.16
35	000738	航发控制	24,935,333.26	3.14
36	600482	中国动力	24,851,526.50	3.13
37	600580	卧龙电驱	24,625,425.00	3.10
38	000623	吉林敖东	24,616,758.80	3.10
39	603517	绝味食品	24,607,889.02	3.10
40	002625	光启技术	24,593,762.25	3.10
41	002465	海格通信	24,520,428.92	3.09
42	600765	中航重机	24,365,889.40	3.07
43	601168	西部矿业	24,165,259.00	3.05
44	300088	长信科技	24,104,425.00	3.04

45	000636	风华高科	24,049,599.20	3.03
46	002078	太阳纸业	24,034,939.00	3.03
47	600060	海信视像	23,759,204.54	2.99
48	600549	厦门钨业	23,736,266.20	2.99
49	002797	第一创业	23,649,121.40	2.98
50	600153	建发股份	23,537,832.26	2.97
51	601298	青岛港	23,393,315.00	2.95
52	601198	东兴证券	23,332,419.00	2.94
53	603858	步长制药	23,283,259.00	2.93
54	600398	海澜之家	22,945,211.00	2.89
55	600373	中文传媒	22,943,131.00	2.89
56	688208	道通科技	22,878,267.55	2.88
57	002831	裕同科技	22,703,020.68	2.86
58	601118	海南橡胶	22,680,202.00	2.86
59	000513	丽珠集团	22,644,343.00	2.85
60	002250	联化科技	22,556,085.00	2.84
61	000729	燕京啤酒	22,454,829.00	2.83
62	600380	健康元	22,449,895.93	2.83
63	688009	中国通号	22,448,204.98	2.83
64	000783	长江证券	22,319,802.80	2.81
65	002444	巨星科技	22,181,218.00	2.80
66	000878	云南铜业	22,131,657.00	2.79
67	603218	日月股份	22,104,335.00	2.79
68	600271	航天信息	21,940,472.00	2.77
69	600079	人福医药	21,775,708.00	2.74
70	600582	天地科技	21,733,031.00	2.74
71	000970	中科三环	21,592,211.85	2.72
72	601699	潞安环能	21,173,210.85	2.67
73	000898	鞍钢股份	20,977,604.00	2.64
74	002745	木林森	20,929,373.00	2.64
75	600500	中化国际	20,901,820.40	2.63
76	000830	鲁西化工	20,900,824.08	2.63
77	002739	万达电影	20,804,804.80	2.62
78	600637	东方明珠	20,625,822.60	2.60
79	002507	涪陵榨菜	20,601,031.84	2.60
80	002048	宁波华翔	20,565,755.35	2.59
81	603707	健友股份	20,554,340.93	2.59
82	601128	常熟银行	20,443,916.00	2.58
83	600517	国网英大	20,443,745.00	2.58
84	600409	三友化工	20,365,939.00	2.57
85	600521	华海药业	20,344,559.00	2.56
86	300115	长盈精密	20,342,160.00	2.56
87	600667	太极实业	20,211,543.00	2.55

88	300699	光威复材	20,088,284.62	2.53
89	002430	杭氧股份	20,070,712.00	2.53
90	000959	首钢股份	19,971,925.00	2.52
91	000027	深圳能源	19,922,000.00	2.51
92	000785	居然之家	19,914,867.00	2.51
93	601717	郑煤机	19,804,975.00	2.50
94	601098	中南传媒	19,769,170.17	2.49
95	002273	水晶光电	19,749,037.74	2.49
96	300463	迈克生物	19,671,591.00	2.48
97	600959	江苏有线	19,624,700.00	2.47
98	000089	深圳机场	19,486,608.00	2.46
99	688819	天能电池集团股份	19,367,719.14	2.44
100	002153	石基信息	19,312,687.20	2.43
101	600316	洪都航空	19,166,656.52	2.42
102	000401	冀东水泥	19,152,141.36	2.41
103	603317	天味食品	19,141,267.60	2.41
104	601005	重庆钢铁	19,040,348.00	2.40
105	688002	睿创微纳	19,031,862.86	2.40
106	600376	首开股份	18,891,534.00	2.38
107	600820	隧道股份	18,710,680.00	2.36
108	002925	盈趣科技	18,704,206.70	2.36
109	600862	中航高科	18,648,734.44	2.35
110	603228	景旺电子	18,646,242.31	2.35
111	601108	财通证券	18,586,169.00	2.34
112	000917	电广传媒	18,358,638.00	2.31
113	600859	王府井	18,355,985.00	2.31
114	600352	浙江龙盛	18,327,793.00	2.31
115	600399	抚顺特钢	18,119,216.00	2.28
116	002110	三钢闽光	18,108,470.00	2.28
117	002056	横店东磁	18,052,780.00	2.28
118	300258	精锻科技	18,050,532.00	2.27
119	600377	宁沪高速	17,905,403.56	2.26
120	002019	亿帆医药	17,865,610.00	2.25
121	002416	爱施德	17,862,830.80	2.25
122	600062	华润双鹤	17,836,569.92	2.25
123	002412	汉森制药	17,773,150.00	2.24
124	000012	南玻A	17,735,123.04	2.24
125	688567	孚能科技	17,473,390.84	2.20
126	002966	苏州银行	17,385,975.00	2.19
127	300183	东软载波	17,235,302.08	2.17
128	000967	盈峰环境	17,120,611.00	2.16
129	600056	中国医药	16,968,065.40	2.14

130	603127	昭衍新药	16,960,757.51	2.14
131	600967	内蒙一机	16,918,176.00	2.13
132	603118	共进股份	16,826,837.80	2.12
133	000823	超声电子	16,660,054.00	2.10
134	000598	兴蓉环境	16,634,140.00	2.10
135	603667	五洲新春	16,632,589.00	2.10
136	600699	均胜电子	16,611,104.00	2.09
137	603367	辰欣药业	16,432,021.00	2.07
138	601231	环旭电子	16,343,051.00	2.06
139	000156	华数传媒	16,294,596.92	2.05
140	002249	大洋电机	16,279,675.00	2.05
141	600901	江苏金租	16,262,055.00	2.05
142	688029	南微医学科技	16,256,427.55	2.05
143	601869	长飞光纤	16,199,525.00	2.04
144	600497	驰宏锌锗	16,110,588.56	2.03

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600498	烽火通信	43,134,332.16	5.44
2	600271	航天信息	33,019,284.47	4.16
3	601555	东吴证券	31,970,677.31	4.03
4	600373	中文传媒	31,063,099.24	3.91
5	600435	北方导航	30,412,708.71	3.83
6	600985	淮北矿业	27,704,677.00	3.49
7	002153	石基信息	27,552,130.24	3.47
8	002138	顺络电子	27,183,529.00	3.43
9	600060	海信视像	26,472,587.00	3.34
10	601128	常熟银行	26,353,881.00	3.32
11	300115	长盈精密	26,309,198.85	3.32
12	601231	环旭电子	25,517,734.32	3.22
13	600667	太极实业	24,865,769.00	3.13
14	002430	杭氧股份	24,157,379.00	3.04
15	002797	第一创业	24,061,931.00	3.03
16	000513	丽珠集团	23,792,578.75	3.00
17	600879	航天电子	23,201,722.86	2.92
18	601108	财通证券	23,118,204.90	2.91
19	603517	绝味食品	22,868,183.14	2.88

20	300146	汤臣倍健	22,812,692.99	2.87
21	600885	宏发股份	22,212,482.00	2.80
22	600901	江苏金租	20,510,529.00	2.58
23	688002	睿创微纳	20,447,161.59	2.58
24	002422	科伦药业	20,387,994.73	2.57
25	000553	安道麦 A	18,693,814.70	2.36
26	001872	招商港口	18,375,485.59	2.32
27	603127	昭衍新药	18,360,654.90	2.31
28	300699	光威复材	18,313,900.81	2.31
29	601005	重庆钢铁	18,213,890.00	2.30
30	600859	王府井	18,164,842.00	2.29
31	601608	中信重工	18,039,027.00	2.27
32	601869	长飞光纤	17,672,345.42	2.23
33	000623	吉林敖东	17,614,275.60	2.22
34	601928	凤凰传媒	17,537,985.00	2.21
35	600862	中航高科	17,509,192.50	2.21
36	000012	南玻 A	17,424,979.00	2.20
37	002966	苏州银行	17,370,806.30	2.19
38	688029	南微医学科技	17,125,408.68	2.16
39	601298	青岛港	16,887,333.00	2.13
40	300741	华宝股份	16,633,593.02	2.10
41	603339	四方科技	16,571,301.64	2.09
42	600056	中国医药	16,569,198.60	2.09
43	002019	亿帆医药	16,505,987.00	2.08
44	000062	深圳华强	16,476,668.63	2.08
45	600655	豫园股份	15,885,892.00	2.00

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	5,620,554,383.92
卖出股票收入（成交）总额	3,565,551,928.59

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	50,140,983.61	1.67

	其中：政策性金融债	50,140,983.61	1.67
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）	2,372,806.98	0.08
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	52,513,790.59	1.75

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	230301	23 进出 01	500,000	50,140,983.61	1.67
2	113066	平煤转债	16,500	1,970,059.32	0.07
3	123190	道氏转 02	4,027	402,747.66	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，广州海格通信集团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	780,122.17
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	165,485.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	945,607.34

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富中证 500 指数增强	50,121	34,155.35	1,130,370,619.80	66.03	581,529,863.38	33.97

A						
汇添富中证 500 指数增强 C	2,817	179,465.31	431,914,669.33	85.43	73,639,105.11	14.57
合计	52,938	41,887.76	1,562,285,289.13	70.45	655,168,968.49	29.55

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富中证 500 指数增强 A	656,456.76	0.04
	汇添富中证 500 指数增强 C	262,798.57	0.05
	合计	919,255.33	0.04

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数增强 A	0~10
	汇添富中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数增强 A	10~50
	汇添富中证 500 指数增强 C	0
	合计	10~50

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

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。

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

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	户均持有的基	持有人结构
-----	--------	-------

额 级 别	户数 (户)	金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
添 富 成 长 多 因 子 股 票 A	33,675	44,996.01	1,217,816,053.90	80.37	297,424,745.16	19.63
添 富 成 长 多 因 子 股 票 C	172	2,816,615.83	484,153,970.63	99.94	303,951.99	0.06
合 计	33,847	59,080.53	1,701,970,024.53	85.11	297,728,697.15	14.89

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	添富成长多因子 股票 A	459,498.59	0.03
	添富成长多因子 股票 C	297.44	0.00
	合计	459,796.03	0.02

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金	添富成长多因子股票 A	0~10

投资和研究部门负责人持有 本开放式基金	添富成长多因子股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放 式基金	添富成长多因子股票 A	0~10
	添富成长多因子股票 C	0
	合计	0~10

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

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数增强 A	汇添富中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 04 月 25 日) 基金份额总额	1,515,240,799.06	484,457,922.62
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	871,627,625.73	411,797,575.68
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	674,967,941.61	390,701,723.86
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	1,711,900,483.18	505,553,774.44

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	添富成长多因子股票 A	添富成长多因子股票 C
基金合同生效日 (2015 年 02 月 16 日) 基金份额总额	1,903,140,954.30	-
本报告期期初基金份 额总额	464,290,765.63	63,064.96
本报告期基金总申购	1,164,634,755.81	484,626,097.00

份额		
减：本报告期基金总赎回份额	113,684,722.38	231,239.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,515,240,799.06	484,457,922.62

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

汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司以通讯方式组织召开了本基金的基金份额持有人大会，会议投票时间自 2023 年 3 月 11 日起，至 2023 年 4 月 16 日 17:00 止。本次大会于 2023 年 4 月 17 日上午 9:30 进行了计票。参加本次大会投票表决的汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人所持份额共计 625,726,599.73 份，占权益登记日本基金总份额 1,171,523,910.26 份的 53.411%，达到法定开会条件。汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会于 2023 年 4 月 17 日表决通过了《关于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金转型的议案》，本次大会决议自该日起生效。

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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

2023 年 4 月 25 日原“汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金”转型为“汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金”。汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的投资策略请详见 2023 年 4 月 18 日刊登在本公司网站的《汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》。

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（2015 年 02 月 16 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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

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 (%)	
华泰证券	2	7,117,776,666.56	31.71	3,390,548.85	22.85	
招商证券	2	3,404,312,217.96	15.17	2,473,891.46	16.68	
东方证券	4	1,710,605,697.43	7.62	1,242,225.62	8.37	
国泰君安	2	1,419,211,363.40	6.32	1,031,060.27	6.95	
长江证券	1	1,266,710,141.59	5.64	916,356.92	6.18	
兴业证券	2	1,018,963,261.73	4.54	744,732.42	5.02	
广发证券	1	1,003,859,546.92	4.47	730,742.21	4.93	
中金公司	2	880,065,587.67	3.92	822,835.09	5.55	
银河证券	2	834,923,618.26	3.72	606,805.92	4.09	
国投证券	2	742,110,456.20	3.31	542,147.63	3.65	
东吴证券	2	738,089,317.38	3.29	540,755.15	3.65	

方正证券	1	426,779,746.65	1.90	310,330.44	2.09	
海通证券	2	383,674,090.83	1.71	278,273.66	1.88	
中泰证券	2	367,041,245.54	1.64	266,665.00	1.80	
中金财富	1	232,246,518.57	1.03	217,056.85	1.46	
中信建投证券	1	193,346,353.77	0.86	141,335.86	0.95	
华鑫证券	3	182,423,007.96	0.81	145,086.01	0.98	
国新证券	2	163,453,003.53	0.73	152,975.65	1.03	
国信证券	2	136,471,390.08	0.61	98,437.27	0.66	
长城证券	1	98,424,978.20	0.44	71,653.36	0.48	
上海证券	1	89,590,232.72	0.40	83,435.78	0.56	
光大证券	1	37,659,381.80	0.17	27,712.09	0.19	
财信证券	1	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
高盛中国	1	-	-	-	-	
国都证券	1	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
中银国际	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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
华泰证券	38,960,183.00	44.29	-	-	-	-	-	-
招商证券	4,496,085.00	5.11	-	-	-	-	-	-
东方证券	5,998,740.00	6.82	-	-	-	-	-	-
国泰君安	7,456,716.10	8.48	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	17,289,764.00	19.65	-	-	-	-	-	-
广发证券	1,791,414.00	2.04	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	1,499,985.00	1.71	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	3,485,615.00	3.96	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	6,992,440.00	7.95	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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 (%)	
招商证券	2	1,875,815,145.54	20.43	1,353,016.62	21.56	
华泰证券	2	1,641,396,059.49	17.88	808,052.07	12.88	
东方证券	4	1,043,058,189.32	11.36	752,326.04	11.99	
东吴证券	2	821,125,712.09	8.94	592,274.77	9.44	
安信证券	2	773,575,814.65	8.43	557,972.64	8.89	
国泰君安	2	647,690,869.84	7.06	467,186.35	7.44	
光大证券	1	403,852,202.76	4.40	291,292.61	4.64	

长江证券	1	373,844,408.63	4.07	269,639.40	4.30	
海通证券	2	362,094,751.36	3.94	261,176.95	4.16	
银河证券	2	243,812,588.09	2.66	175,866.19	2.80	
方正证券	1	214,368,329.53	2.34	154,624.95	2.46	
西南证券	1	210,813,089.36	2.30	152,062.17	2.42	
广发证券	1	148,172,820.60	1.61	106,874.14	1.70	
兴业证券	2	145,400,437.26	1.58	104,878.04	1.67	
华鑫证券	3	80,606,687.84	0.88	66,832.26	1.06	
中泰证券	2	62,447,152.00	0.68	45,043.74	0.72	
中金财富	1	43,086,463.03	0.47	40,123.10	0.64	
国都证券	1	40,391,691.48	0.44	37,617.18	0.60	
国金证券	2	31,322,759.87	0.34	22,593.52	0.36	
上海证券	1	17,682,498.54	0.19	16,468.35	0.26	
财信证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
高盛中国	1	-	-	-	-	
国新证券	2	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中信	1	-	-	-	-	

建投 证券							
中信 证券	1	-	-	-	-	-	-
中银 国际	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

券商 名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交 金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例 (%)	成交 金额	占当期 权证成 交总额 的比例 (%)	成交 金额	占当期 基金成 交总额 的比例 (%)
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	4,790,064.00	35.27	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	4,790,771.00	35.28	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
广发证券	999,930.00	7.36	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,500,375.00	11.05	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	1,499,604.00	11.04	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金转型为汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的提示性公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 25 日
2	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
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加招商银行开展的费率优惠活动的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 28 日
4	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 08 月 17 日

5	关于汇添富基金管理股份有限公司运用自有资金投资旗下基金的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日
6	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
7	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
8	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
9	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
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 03 日
11	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

11.8 其他重大事件（转型前）

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	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 02 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 09 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 10 日

5	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
6	汇添富基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 13 日
7	关于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 23 日
8	汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金收益分配公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 25 日
9	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
10	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 18 日
11	汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金法律文件	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 18 日
12	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
13	汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 24 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		到或者超过 20%的时间区间)
机构	1	2023 年 3 月 7 日至 2023 年 3 月 15 日, 2023 年 3 月 21 日至 2023 年 7 月 30 日	27, 532, 488. 99	378, 153, 173. 98	164, 033, 053. 22	241, 652, 609. 75	10. 9 0

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、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

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

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

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

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、中国证监会批准汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 5、《汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 8、报告期内汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号

汇添富基金管理股份有限公司

13.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2024 年 03 月 29 日