

汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数  
证券投资基金联接基金（LOF）（原汇添富中  
证全指证券公司指数型发起式证券投资基金  
（LOF））2023年年度报告

2023年12月31日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2024年03月29日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

自 2023 年 05 月 09 日起，汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 转型为汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)。本报告中，汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 05 月 08 日止，汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的报告期自 2023 年 05 月 09 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) .....	7
2.2 基金产品说明 (转型后) .....	7
2.2 基金产品说明 (转型前) .....	8
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	9
2.4 信息披露方式 .....	9
2.5 其他相关资料 .....	9
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	9
3.1 主要会计数据和财务指标 (转型后) .....	9
3.1 主要会计数据和财务指标 (转型前) .....	10
3.2 基金净值表现 (转型后) .....	13
3.2 基金净值表现 (转型前) .....	17
3.3 过去三年基金的利润分配情况 (转型后) .....	21
3.3 过去三年基金的利润分配情况 (转型前) .....	21
§ 4 管理人报告 .....	21
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	21
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 .....	34
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 .....	36
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 .....	45
7.3 净资产变动表 .....	46
7.4 报表附注 .....	47
§ 7 年度财务报表 (转型前) .....	76
7.1 资产负债表 .....	76
7.2 利润表 .....	78
7.3 净资产变动表 .....	79
7.4 报表附注 .....	80
§ 8 投资组合报告 (转型后) .....	115
8.1 期末基金资产组合情况 .....	116
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	116
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 .....	117
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	119
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	121
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 .....	121
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 .....	121
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 .....	121
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 .....	121
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	121
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	121
8.12 本报告期投资基金情况 .....	121
8.13 投资组合报告附注 .....	122
§ 8 投资组合报告 (转型前) .....	123
8.1 期末基金资产组合情况 .....	123
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	123
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 .....	125
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	128
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	129
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 .....	129
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 .....	129
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 .....	130
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 .....	130
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	130
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	130
8.12 投资组合报告附注 .....	130
§ 9 基金份额持有人信息 (转型后) .....	131
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	131
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	132
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	132
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	133
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	133

§ 9 基金份额持有人信息 (转型前)	133
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	133
9.2 期末上市基金前十名持有人	134
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	135
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	135
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	135
9.6 发起式基金发起资金持有份额情况	135
§ 10 开放式基金份额变动 (转型后)	135
§ 10 开放式基金份额变动 (转型前)	136
§ 11 重大事件揭示	136
11.1 基金份额持有人大会决议	137
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	137
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	137
11.4 基金投资策略的改变	137
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	137
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	137
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)	137
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)	139
11.8 其他重大事件 (转型后)	140
11.8 其他重大事件 (转型前)	141
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	142
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	142
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	142
§ 13 备查文件目录	142
13.1 备查文件目录	142
13.2 存放地点	142
13.3 查阅方式	143

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况 (转型后)

基金名称	汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)	
基金简称	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF)	
基金主代码	501047	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 05 月 09 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	1,233,138,341.88	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2018 年 01 月 18 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C
下属分级基金场内简称	全指证券	证券 C
下属分级基金的交易代码	501047	501048
报告期末下属分级基金的份额总额 (份)	485,900,462.27	747,237,879.61

注：汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A 类份额扩位证券简称：证券公司 LOF；汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C 类份额扩位证券简称：证券公司 LOFC。

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	560090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 02 月 27 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 03 月 15 日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中信建投证券股份有限公司

## 2.1 基金基本情况 (转型前)

基金名称	汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF)	
基金简称	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)	
基金主代码	501047	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 04 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	1,485,799,484.90	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2018 年 01 月 18 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C
下属分级基金场内简称	全指证券	证券 C
下属分级基金的交易代码	501047	501048
报告期末下属分级基金的份额总额 (份)	588,481,633.41	897,317,851.49

注：汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A 类份额扩位证券简称：证券公司 LOF；汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C 类份额扩位证券简称：证券公司 LOFC。

## 2.2 基金产品说明 (转型后)

投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。 为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；目标 ETF 的投资策略；成份股、备选成份股投资策略；固定收益类资产投资策略；金融衍生工具投资策略；融资及转融通投资策略；存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%

风险收益特征	本基金为汇添富中证全指证券公司 ETF 的联接基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金通过投资目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--------	--

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益



	的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	----------------------------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	朱志明
	联系电话	021-28932888	4008-888-108
	电子邮箱	service@99fund.com	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95587
传真		021-28932998	010-85130975
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层
邮政编码		200010	100010
法定代表人		李文	王常青

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 05 月 09 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日	
	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C
本期已实现收益	-80,961,978.16	-109,721,142.01
本期利润	-33,970,239.06	-36,447,926.35
加权平均基金份额本	-0.0667	-0.0469

期利润		
本期加权平均净值利润率	-6.81%	-4.81%
本期基金份额净值增长率	-6.84%	-7.00%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
期末可供分配利润	-59,596,842.72	-94,100,870.88
期末可供分配基金份额利润	-0.1227	-0.1259
期末基金资产净值	457,187,892.40	700,341,227.72
期末基金份额净值	0.9409	0.9372
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
基金份额累计净值增长率	-6.84%	-7.00%

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

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

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

4、本基金的《基金合同》生效日为 2023 年 05 月 09 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 05 月 08 日		2022 年		2021 年	
	汇添富中证全指证	汇添富中证全指证	汇添富中证全指证	汇添富中证全指证	汇添富中证全指证券公	汇添富中证全指证券公

	券公司指数 (LOF)A	券公司指数 (LOF)C	券公司指数 (LOF)A	券公司指数 (LOF)C	司指数 (LOF)A	司指数 (LOF)C
本期已实现收益	- 19,513,97 2.94	- 30,507,04 5.65	- 56,810,78 3.71	- 87,014,77 9.39	21,756,099. 75	31,596,352. 42
本期利润	66,475,30 4.43	103,420,0 17.50	- 271,581,4 37.34	- 290,479,7 16.64	- 26,933,095. 24	- 1,244,639.2 6
加权平均基金份额本期利润	0.1070	0.1088	-0.3716	-0.2785	-0.0395	-0.0013
本期加权平均净值利润率	11.11%	11.32%	-37.96%	-28.82%	-3.42%	-0.11%
本期基金份额净值	11.42%	11.32%	-24.84%	-25.04%	-4.63%	-4.86%

增长率						
3.1 .2 期末 数据和 指标	2023年05月08日		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	1,972,725 .45	1,240,676 .43	65,154,01 3.36	99,034,54 7.55	97,307,172. 55	110,403,363 .61
期末可供分配基金份额利润	0.0034	0.0014	-0.0935	-0.0948	0.1142	0.1155
期末基金资产净值	594,351,2 99.15	904,208,1 97.62	631,573,7 89.42	945,817,2 87.84	1,027,355,2 32.40	1,154,417,8 00.56
期末基金	1.0100	1.0077	0.9065	0.9052	1.2061	1.2075

份 额 净 值						
3.1 .3 累 计 期 末 指 标	2023 年 05 月 08 日		2022 年末		2021 年末	
基 金 份 额 累 计 净 值 增 长 率	1.00%	0.77%	-9.35%	-9.48%	20.61%	20.75%

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

汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) 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	-4.31%	1.02%	-4.14%	1.03%	-0.17%	-0.01%
过去六个月	2.66%	1.40%	2.13%	1.40%	0.53%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-6.84%	1.32%	-7.72%	1.33%	0.88%	-0.01%
汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) 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	-4.37%	1.02%	-4.14%	1.03%	-0.23%	-0.01%
过去六个月	2.54%	1.40%	2.13%	1.40%	0.41%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-7.00%	1.32%	-7.72%	1.33%	0.72%	-0.01%

### 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

汇添富中证全指证券公司ETF联接（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证全指证券公司ETF联接（LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为2023年05月09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，

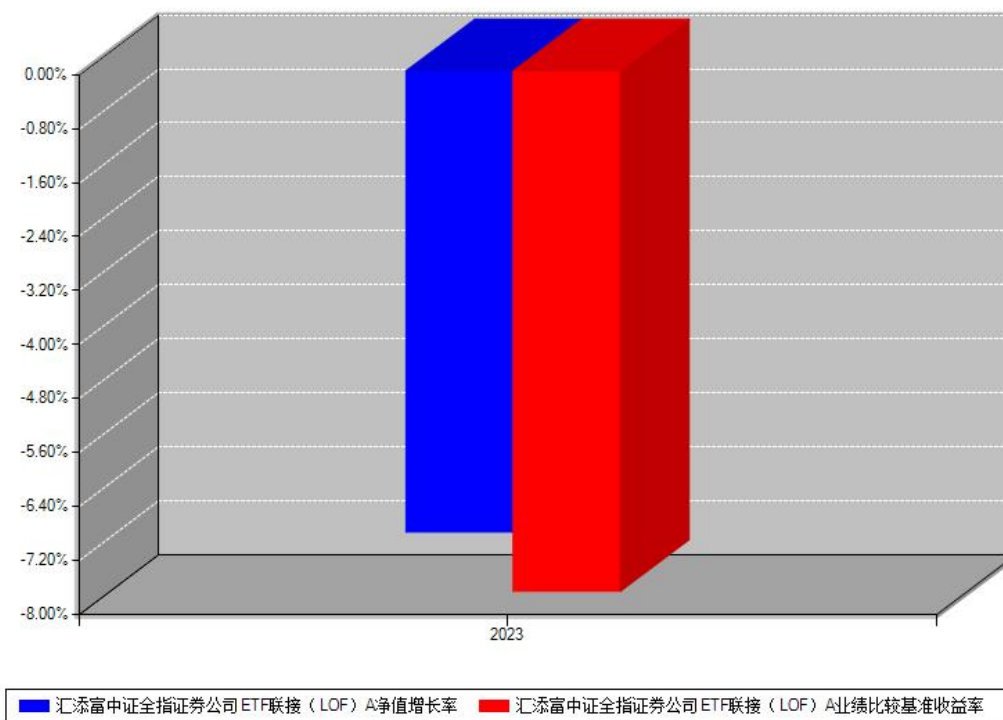
建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金由原汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）于2023年05月09日转型而来。

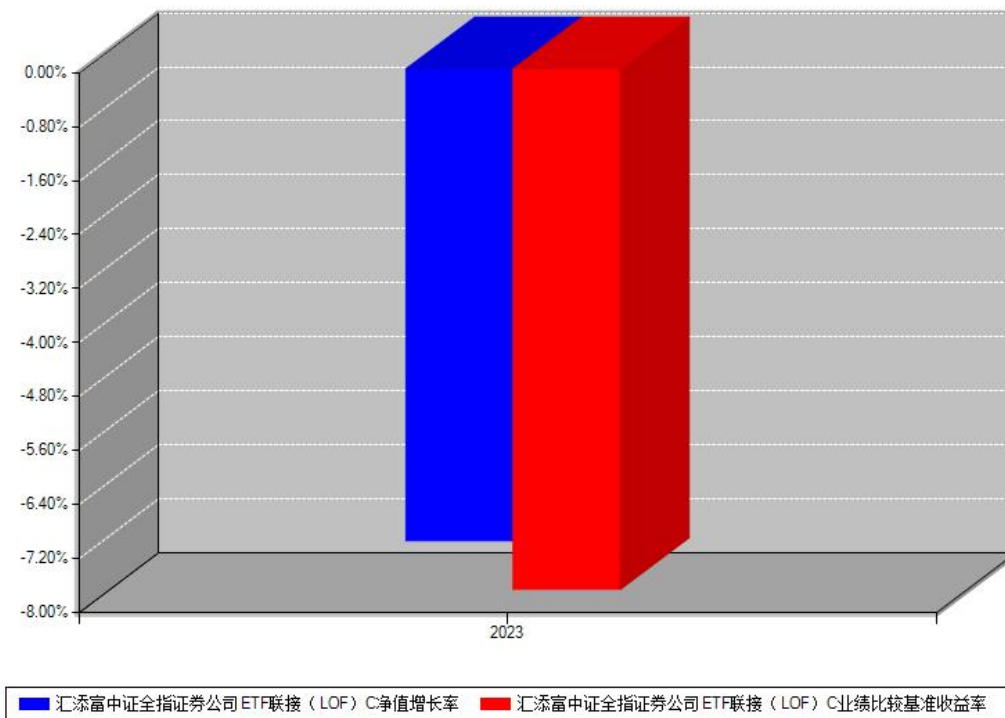
### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证全指证券公司ETF联接（LOF）A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图





汇添富中证全指证券公司ETF联接（LOF）C每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为2023年05月09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

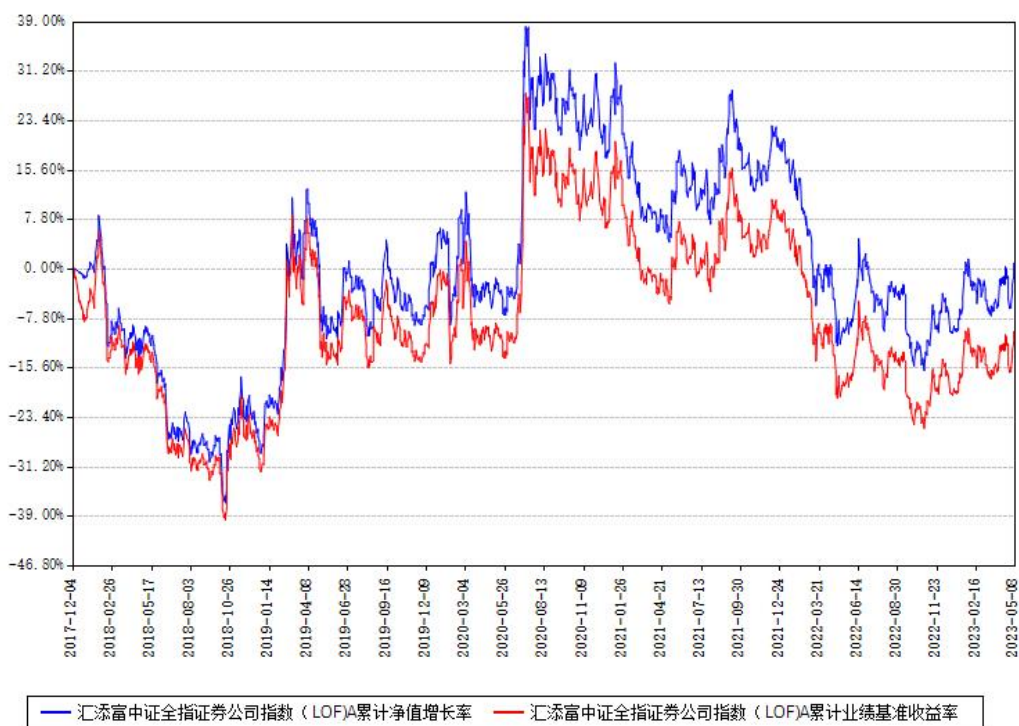
汇添富中证全指证券公司指数（LOF）A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自2023-03-01至2023-05-08	4.49%	1.34%	4.57%	1.35%	-0.08%	-0.01%
自2022-12-01至2023-05-08	8.56%	1.32%	8.67%	1.33%	-0.11%	-0.01%
自2022-06-01至2023-05-08	9.56%	1.44%	7.97%	1.45%	1.59%	-0.01%

自 2020-06-01 至 2023-05-08	8.19%	1.69%	4.28%	1.70%	3.91%	-0.01%
自 2018-06-01 至 2023-05-08	21.16%	1.83%	11.60%	1.86%	9.56%	-0.03%
自 2017-12-04 至 2023-05-08	1.00%	1.80%	-9.77%	1.83%	10.77%	-0.03%
汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)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 2023-03-01 至 2023-05-08	4.45%	1.34%	4.57%	1.35%	-0.12%	-0.01%
自 2022-12-01 至 2023-05-08	8.44%	1.32%	8.67%	1.33%	-0.23%	-0.01%
自 2022-06-01 至 2023-05-08	9.31%	1.44%	7.97%	1.45%	1.34%	-0.01%
自 2020-06-01 至 2023-05-08	7.41%	1.69%	4.28%	1.70%	3.13%	-0.01%
自 2018-06-01 至 2023-05-08	20.93%	1.83%	11.60%	1.86%	9.33%	-0.03%
自 2017-12-04 至 2023-05-08	0.77%	1.80%	-9.77%	1.83%	10.54%	-0.03%

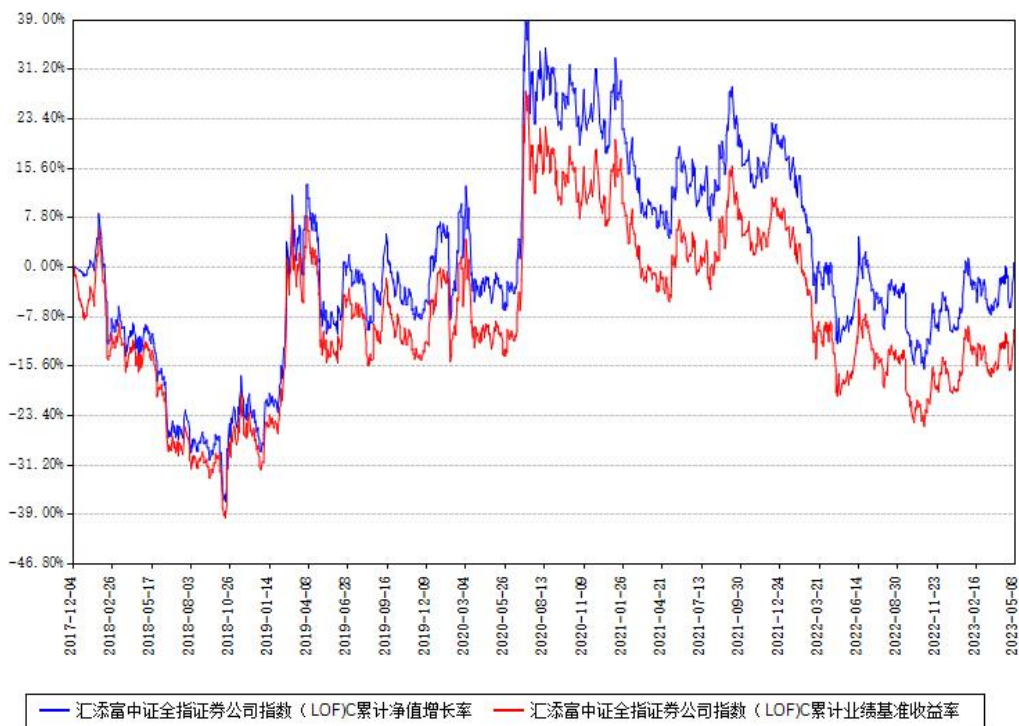
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

## 基准收益率变动的比较

汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A 累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C 累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

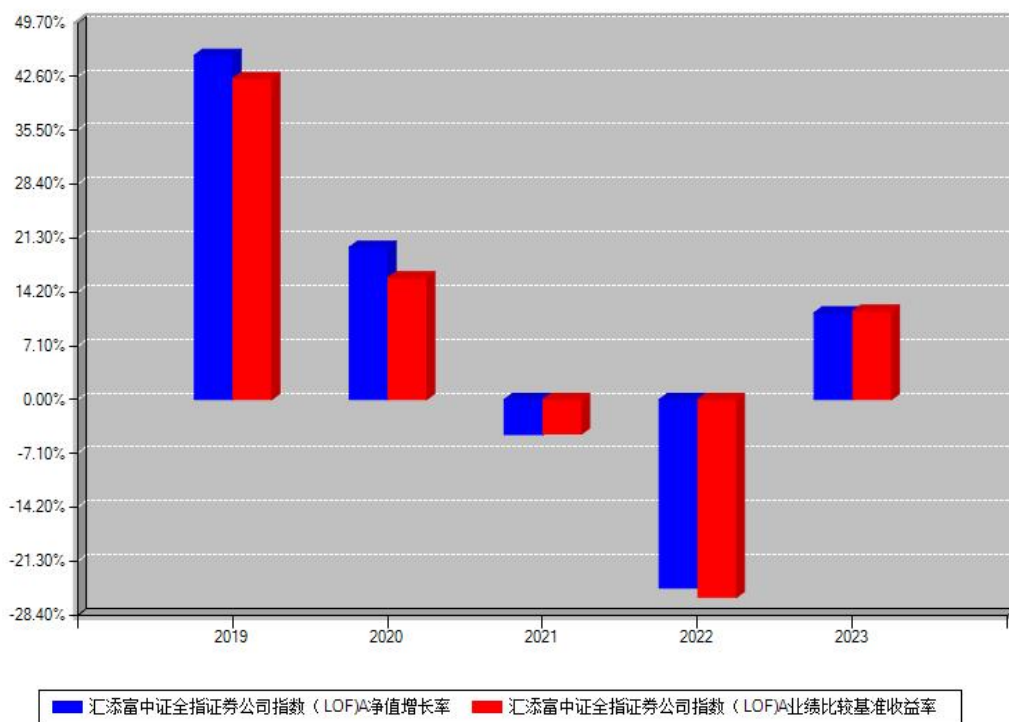


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 12 月 04 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

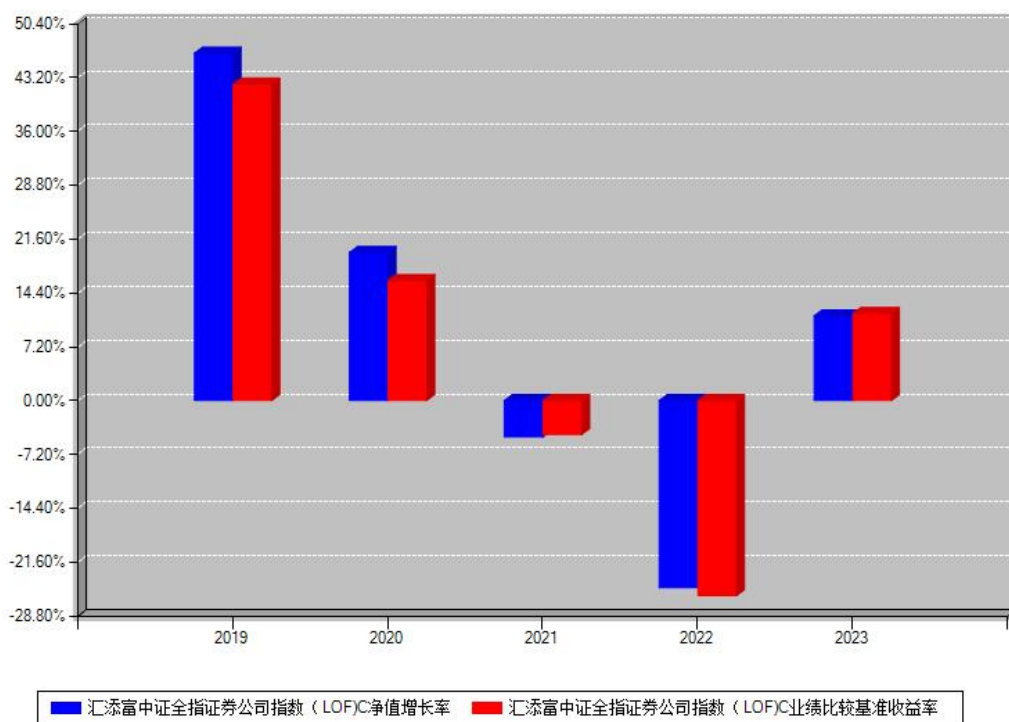
本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

### 3.2.3 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

汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A 每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)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2017年12月04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05月09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）

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人、QFII基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

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

2023年，汇添富基金坚持以“客户体验”为中心，以“创新”为宗旨，以“服务”为生命力，稳扎稳打实现互联网平台全方位发展。全年大力开拓投顾式销售及服务模式，持

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

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

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

平而不懈努力。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（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		
董瑾	本基金的基金经理	2023年05月09日	-	14	<p>国籍：中国。学历：北京大学西方经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年8月至2012年12月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012年12月至2015年9月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015年9月至2016年10月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016年11月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017年12月18日至2019年12月31日任汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017年12月18日至2019年12月31日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金</p>



					<p>经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。</p> <p>2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 5 月 8 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 8 月 29 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2023 年 8 月 29 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 2 月 1 日至今任汇</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 9 日至今任汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 26 日至 2022 年 10 月 11 日任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 3 日至今任汇添富中证电池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全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 23 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至今任</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>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。2022 年 7 月 13 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 29 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 1 月 16 日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月 27 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 6 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金(LOF)的基金经理。2023年5月9日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金经理。2023年8月23日至今任汇添富中证沪港深消费龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2023年9月13日至今任汇添富中证2000交易型开放式指数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		
董瑾	本基金的基金经理	2019年12月31日	2023年05月08日	14	国籍:中国。学历:北京大学西方经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。

				<p>从业经历：                  2010 年 8 月至                  2012 年 12 月任                  国泰基金管理                  有限公司产品                  经理助理，                  2012 年 12 月至                  2015 年 9 月任                  汇添富基金管                  理股份有限公                  司产品经理，                  2015 年 9 月至                  2016 年 10 月任                  万家基金管理                  有限公司量化                  投资部基金经                  理助理。2016                  年 11 月加入汇                  添富基金管理                  股份有限公司。                  2017 年 12 月                  18 日至 2019                  年 12 月 31 日                  任汇添富沪深                  300 指数型发起                  式证券投资基金                  (LOF) 的基                  金经理助理。                  2017 年 12 月                  18 日至 2019                  年 12 月 31 日                  任汇添富中证                  全指证券公司                  指数型发起式                  证券投资基金                  (LOF) 的基                  金经理助理。                  2017 年 12 月                  18 日至 2019                  年 12 月 31 日                  任中证上海国                  企交易型开放                  式指数证券投                  资基金联接基</p>
--	--	--	--	--

				<p>金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 5 月 8 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 9 日至今任</p>
--	--	--	--	---

				<p>汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 1 月 26 日至 2022 年 10 月 11 日任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2022 年 3 月 3 日至今任汇添富中证电池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全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 23 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p> <p>2022 年 6 月 13 日至今任汇添富中证国企一</p>
--	--	--	--	--

				<p>带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 7 月 13 日至今任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2022 年 12 月 29 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p> <p>2023 年 1 月 16 日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月 27 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 6 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2023 年 4 月 13 日至今任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF)</p>
--	--	--	--	---



					的基金经理。 2023 年 4 月 13 日至今任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。 2023 年 5 月 9 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况 (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遵规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度

的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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

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

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年经济运行总体上呈恢复态势。分项来看，工业生产有所恢复，消费逐步改善，投资方面基建和制造业仍是主要驱动因素，房地产对于经济增速仍有一定程度的拖累。

市场全年整体呈调整态势。风格上有所分化，高股息和小微盘相对大盘体现出明显的

超额收益。行业主题方面，受益于人工智能发展的浪潮，科技类股票上半年行情比较突出；全年来看，能源、电力、金融等板块也取得了不错的表现。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2023 年 05 月 09 日变更注册为汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)。转型前，本报告期汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) A 类份额净值增长率为 11.42%，同期业绩比较基准收益率为 11.64%。本报告期汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) C 类份额净值增长率为 11.32%，同期业绩比较基准收益率为 11.64%。转型后，本报告期汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A 类份额净值增长率为-6.84%，同期业绩比较基准收益率为-7.72%。本报告期汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C 类份额净值增长率为-7.00%，同期业绩比较基准收益率为-7.72%。

#### 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，国民经济有望持续回升向好。政策方面，中央经济工作会议提出“明年要坚持稳中求进、以进促稳、先立后破，多出有利于稳预期、稳增长、稳就业的政策”。财政政策方面，要求“积极的财政政策要适度加力、提质增效”；货币政策层面，要求“灵活适度、精准有效”。而随着美联储降息预期的提升，外部流动性方面也有望得到改善。

权益市场已具备较高的性价比，随着经济环境的持续改善，有望迎来修复行情。风格上，前期仍可能延续高股息、小微盘风格，而随着经济和市场风险偏好的逐步恢复，后续有望重回大中盘、成长风格。行业主题方面，当前市场主线仍不明朗，需持续关注产业的发展和相关政策的推出等情况。

中期来看，券商板块受益于活跃资本市场政策及复苏带动下市场活跃度和风险偏好的提升，有望迎来业绩和估值的修复。长期来看，券商板块维持资本市场深化改革和券商创新业务及财富管理转型的投资主线不变。随着创新业务的开展，券商业务向多元化发展，盈利空间有望拓展、业绩波动有望降低，支撑行业估值中枢上移。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

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

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

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

## 3、持续加强稽核工作

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

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。

本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

# § 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_B86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	汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年5月9日（基金合同生效日）至2023年12月31日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）2023年12月31日的财务状况以及2023年5月9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。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“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全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF），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。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，</p>



	<p>根据获取的审计证据，就可能对汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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_B307 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	汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报表，包括 2023 年 5 月 8 日 (基金合同失效前日) 的资产负债表，2023 年 1 月 1 日至 2023 年 5 月 8 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，后附的汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2023 年 5 月 8 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 5 月 8 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	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

	<p>守则，我们独立于汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF)，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>汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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。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：汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

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
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	63,802,302.70
结算备付金		122,706.55
存出保证金		180,943.13
交易性金融资产	7.4.7.2	1,092,005,931.58
其中：股票投资		21,883,689.39
基金投资		1,070,122,242.19
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-

其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		4,496,944.13
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,160,608,828.09
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		2,696,687.27
应付管理人报酬		36,843.63
应付托管费		7,368.73
应付销售服务费		148,054.24
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	190,754.10
负债合计		3,079,707.97
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.8	1,233,138,341.88
未分配利润	7.4.7.9	-75,609,221.76
净资产合计		1,157,529,120.12
负债和净资产总计		1,160,608,828.09

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,233,138,341.88 份。本基金下属汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A 基金份额净值 0.9409 元，基金份额总额 485,900,462.27 份；本基金下属汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C 基金份额净值 0.9372 元，基金份额总额 747,237,879.61 份。

2、本基金合同于 2023 年 05 月 09 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：汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)

本报告期：2023年05月09日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年05月09日（基金合 同生效日）至2023年12月 31日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-68,429,809.30</b>
1. 利息收入		186,500.37
其中：存款利息收入	7.4.7.10	186,500.37
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）		-189,193,228.50
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-214,450,301.05
基金投资收益	7.4.7.12	25,077,165.59
债券投资收益	7.4.7.13	13,273.04
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	166,633.92
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	120,264,954.76
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	311,964.07
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,988,356.11</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	470,092.14
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	94,018.47
3. 销售服务费		1,227,628.02
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		73,247.88
8. 其他费用	7.4.7.21	123,369.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）</b>		<b>-70,418,165.41</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-70,418,165.41</b>

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-70,418,165.41

注：本基金合同于2023年05月09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：汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

本报告期：2023年05月09日（基金合同生效日）至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年05月09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	1,485,799,484.90	12,760,011.87	1,498,559,496.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-252,661,143.02	-88,369,233.63	-341,030,376.65
（一）、综合收益总额	-	-70,418,165.41	-70,418,165.41
（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）	-252,661,143.02	-17,951,068.22	-270,612,211.24
其中：1. 基金申购款	606,131,486.63	-8,546,313.90	597,585,172.73
2. 基金赎回款	-858,792,629.65	-9,404,754.32	-868,197,383.97
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,233,138,341.88	-75,609,221.76	1,157,529,120.12

注：本基金合同于2023年05月09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

汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 是由汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 变更而来。原汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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[2017]1758 号文《关于准予汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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 2017 年 12 月 4 日生效。首次设立基金募集规模为 255,339,481.80 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 (2017) 验字第 60466941\_B44 号验资报告予以验证。

根据《关于汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 转型为汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 并相应修订法律文件的公告》, 为更好地满足投资者理财需求, 根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同》的相关约定, 经与基金托管人中信建投证券股份有限公司协商一致, 并报中国证监会备案, 自 2023 年 5 月 9 日起, 汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 转型为汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)。根据转型安排, 修订后的《汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》自 2023 年 5 月 9 日起生效, 《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同》同日起失效。本基金为上市契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

本基金标的指数为中证全指证券公司指数及其未来可能发生的变更。本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现投资目标, 基金还可投资于包括国内依法发行上市的股票 (包括中小板、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 (包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、

可交换债券、可转换债券（分离交易可转债）、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款）、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）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的相关规定）。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：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。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。本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：中证全指证券公司指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计



#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2023年05月09日（基金合同生效日）至2023年12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### （1）金融资产分类

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

##### （2）金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，

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

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

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

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

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

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任

已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可

根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

动收益；

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

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

##### 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	63,802,302.70
等于：本金	63,795,464.18
加：应计利息	6,838.52
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	63,802,302.70

##### 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	25,067,604.19	-	21,883,689.39	-3,183,914.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	1,111,855,965.38	-	1,070,122,242.19	41,733,723.19
其他	-	-	-	-
合计	1,136,923,569.57	-	1,092,005,931.58	44,917,637.99

#### 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	25.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	728.55
其中：交易所市场	728.55
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	190,754.10

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A		
项目	本期 2023 年 05 月 09 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	588,481,633.41	588,481,633.41
本期申购	202,303,708.91	202,303,708.91
本期赎回 (以“-”号填列)	-304,884,880.05	-304,884,880.05
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	485,900,462.27	485,900,462.27
汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C		
项目	本期 2023 年 05 月 09 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	897,317,851.49	897,317,851.49
本期申购	403,827,777.72	403,827,777.72
本期赎回 (以“-”号填列)	-553,907,749.60	-553,907,749.60
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	747,237,879.61	747,237,879.61

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

汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) 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	1,972,725.45	3,896,940.29	5,869,665.74
本期利润	-80,961,978.16	46,991,739.10	-33,970,239.06
本期基金份额交易产生的变动数	19,392,409.99	-20,004,406.54	-611,996.55
其中：基金申购款	-17,718,524.07	16,831,380.53	-887,143.54
基金赎回款	37,110,934.06	-36,835,787.07	275,146.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-59,596,842.72	30,884,272.85	-28,712,569.87
汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) 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	1,240,676.43	5,649,669.70	6,890,346.13
本期利润	-109,721,142.01	73,273,215.66	-36,447,926.35
本期基金份额交易产生的变动数	14,379,594.70	-31,718,666.37	-17,339,071.67
其中：基金申购款	-50,617,551.16	42,958,380.80	-7,659,170.36
基金赎回款	64,997,145.86	-74,677,047.17	-9,679,901.31

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-94,100,870.88	47,204,218.99	-46,896,651.89

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年05月09日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
活期存款利息收入	171,849.89	
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	6,759.95	
其他	7,890.53	
合计	186,500.37	

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——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年05月09日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-76,481,089.14	
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	-137,969,211.91	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	-214,450,301.05	

##### 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年05月09日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
卖出股票成交总额	548,180,113.48	
减：卖出股票成本总额	623,633,803.89	
减：交易费用	1,027,398.73	
买卖股票差价收入	-76,481,089.14	

##### 7.4.7.11.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年05月09日（基金合同生效日）至2023年12月	

	31日
申购基金份额总额	1,300,496,600.00
减：现金支付申购款总额	410,411,931.34
减：申购股票成本总额	1,028,053,880.57
减：交易费用	-
申购差价收入	-137,969,211.91

#### 7.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年05月09日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	315,910,567.36
减：卖出/赎回基金成本总额	290,185,665.75
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	610,398.95
减：交易费用	37,337.07
基金投资收益	25,077,165.59

#### 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05月09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	10,083.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,190.00
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	13,273.04

##### 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05月09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	7,387,218.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,309,906.00
减：应计利息总额	74,122.19
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	3,190.00

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年05月09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	166,633.92
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	166,633.92

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年05月09日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1. 交易性金融资产	120,264,954.76
——股票投资	161,998,677.95
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-41,733,723.19
——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	120,264,954.76

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年05月09日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	311,964.07
替代损益	-
其他	-
合计	311,964.07

#### 7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年05月09日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	45,452.16
信息披露费	77,917.44
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	-
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	-
合计	123,369.60

### 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
中信建投证券股份有限公司 (“中信建投证券”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (新加坡) 有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司
汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 05 月 09 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
中信建投证券	599,306,595.81	100.00

###### 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 05 月 09 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 (%)
中信建投证券	14,623,002.00	100.00

###### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
中信建投证券	352,034,019.20	100.00

#### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 05 月 09 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
中信建投证券	432,297.35	100.00	728.55	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 05 月 09 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	470,092.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,426,519.99
应支付基金管理人的净管理费	-956,427.85

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 05 月 09 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	94,018.47

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 05 月 09 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		
	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C	合计
中信建投证券股份有限公司	-	583.31	583.31
东方证券股份有限公司	-	1,048.81	1,048.81
汇添富基金管理股份有限公司	-	145,260.97	145,260.97
合计	-	146,893.09	146,893.09

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 0.25%。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 0.25% 年费率计提，计算方法如下：

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

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，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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： 本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注： 本基金本报告期末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

于本报告期末，本基金持有 1,091,627,300.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 87.90%。

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券，和基金托管人中信建投证券发行的股票中信建投。

于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 76,581.00 股，持有中信建投 19,035.00 股。

#### 7.4.11 利润分配情况

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

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注： 本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注： 本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023	1 个月以内	1-3 个月	3 个月	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-------------	--------	--------	------	-------	-------	-----	----

年 12 月 31 日		月	-1 年		上		
资产							
货币 资金	63,802,302.70	-	-	-	-	-	63,802,302.70
结算 备付 金	122,706.55	-	-	-	-	-	122,706.55
存出 保证 金	180,943.13	-	-	-	-	-	180,943.13
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	1,092,005,931.58	1,092,005,931.58
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	2,363,032.85	-	-	-	-	2,133,911.28	4,496,944.13
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	66,468,985.23	-	-	-	-	1,094,139,842.86	1,160,608,828.09
负债							
短期 借款	-	-	-	-	-	-	-

交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,696,687.27	2,696,687.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,843.63	36,843.63
应付托管费	-	-	-	-	-	7,368.73	7,368.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	148,054.24	148,054.24
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	-	-	-	-	-	190,754.10	190,754.10
负债	-	-	-	-	-	3,079,707.97	3,079,707.97



总计							
利率敏感程度缺口	66,468,985.23	-	-	-	-	1,091,060,134.89	1,157,529,120.12

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	21,883,689.39	1.89
交易性金融资产—基金投资	1,070,122,242.19	92.45
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,092,005,931.58	94.34

##### 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
	中证全指证券公司指数 上涨 5%	54,621,105.34
	中证全指证券公司指数 下跌 5%	-54,621,105.34

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	1,092,005,931.58
第二层次	-
第三层次	-
合计	1,092,005,931.58

###### 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 05 月 09 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	-	55,791.67	55,791.67
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	55,791.67	55,791.67
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

#### 7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

#### 7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 年度财务报表（转型前）

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023年05月08日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年05月08日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	81,217,721.17	86,387,403.04
结算备付金		68,705.31	200,965.10
存出保证金		264,652.52	320,471.95
交易性金融资产	7.4.7.2	1,417,444,485.57	1,491,652,815.88
其中：股票投资		1,417,444,485.57	1,491,652,815.88
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		20,036,143.96	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,136,349.52	1,978,016.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	7,184.73
资产总计		1,520,168,058.05	1,580,546,857.60
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年05月08日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		21,044,381.88	1,584,598.69
应付管理人报酬		161,331.65	673,193.83

应付托管费		32,266.33	134,638.77
应付销售服务费		48,928.73	203,960.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		636.65	904.70
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	321,016.04	558,483.82
负债合计		21,608,561.28	3,155,780.34
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.8	1,485,799,484.90	1,741,579,638.17
未分配利润	7.4.7.9	12,760,011.87	-164,188,560.91
净资产合计		1,498,559,496.77	1,577,391,077.26
负债和净资产总计		1,520,168,058.05	1,580,546,857.60

注：报告截止日 2023 年 05 月 08 日，基金份额总额 1,485,799,484.90 份。本基金下属汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A 基金份额净值 1.0100 元，基金份额总额 588,481,633.41 份；本基金下属汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C 基金份额净值 1.0077 元，基金份额总额 897,317,851.49 份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 05 月 08 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 05 月 08 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>174,065,454.95</b>	<b>-548,596,000.30</b>
1. 利息收入		537,653.90	1,138,926.34
其中：存款利息收入	7.4.7.10	109,777.18	379,301.69
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		427,876.72	759,624.65
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-46,515,067.94	-132,165,387.13
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-47,175,650.40	-166,277,702.05
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	899,372.17
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	660,582.46	33,212,942.75

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	219,916,340.52	-418,235,590.88
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	126,528.47	666,051.37
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>4,170,133.02</b>	<b>13,465,153.68</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,659,337.40	8,652,839.54
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	531,867.47	1,730,567.87
3. 销售服务费		803,562.76	2,522,898.06
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		1,540.34	2,734.66
8. 其他费用	7.4.7.21	173,825.05	556,113.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>169,895,321.93</b>	<b>-562,061,153.98</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>169,895,321.93</b>	<b>-562,061,153.98</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>169,895,321.93</b>	<b>-562,061,153.98</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2023年01月01日至2023年05月08日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年05月08日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,741,579,638.17	-164,188,560.91	1,577,391,077.26
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,741,579,638.17	-164,188,560.91	1,577,391,077.26
三、本期增减变动额（减少以	-255,780,153.27	176,948,572.78	-78,831,580.49

“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	169,895,321.93	169,895,321.93
(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)	-255,780,153.27	7,053,250.85	-248,726,902.42
其中: 1. 基金申购款	321,710,987.95	-11,301,431.19	310,409,556.76
2. 基金赎回款	-577,491,141.22	18,354,682.04	-559,136,459.18
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	1,485,799,484.90	12,760,011.87	1,498,559,496.77
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,807,849,740.42	373,923,292.54	2,181,773,032.96
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,807,849,740.42	373,923,292.54	2,181,773,032.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-66,270,102.25	-538,111,853.45	-604,381,955.70
(一)、综合收益总额	-	-562,061,153.98	-562,061,153.98
(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)	-66,270,102.25	23,949,300.53	-42,320,801.72
其中: 1. 基金申购款	1,823,663,106.60	-30,830,483.03	1,792,832,623.57
2. 基金赎回款	-1,889,933,208.85	54,779,783.56	-1,835,153,425.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-

净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	1,741,579,638.17	-164,188,560.91	1,577,391,077.26

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) (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[2017]1758 号文《关于准予汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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 2017 年 12 月 4 日生效。首次设立基金募集规模为 255,339,481.80 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 (2017) 验字第 60466941\_B44 号验资报告予以验证。本基金为上市契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标, 基金还可投资于其他依法发行上市的股票 (包括中小板、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 (包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券 (分离交易可转债)、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款 (包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生工具 (包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等) 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的相关规定)。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：本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。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。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为：中证全指证券公司指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（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 05 月 08 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 05 月 08 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 05 月 08 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低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

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

#### 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暂免征收个人所得税的通知》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 05 月 08 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	81,217,721.17	86,387,403.04
等于：本金	81,178,768.89	86,377,896.67
加：应计利息	38,952.28	9,506.37
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	81,217,721.17	86,387,403.04

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 05 月 08 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,582,627,078.32	-	1,417,444,485.57	165,182,592.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,582,627,078.32	-	1,417,444,485.57	165,182,592.75
项目	上年度末				
	2022 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,876,751,749.15	-	1,491,652,815.88	385,098,933.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,876,751,749.15	-	1,491,652,815.88	385,098,933.27

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年05月08日	上年度末 2022年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	-	7,184.73
待摊费用	-	-
合计	-	7,184.73

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05月08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	0.94	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	57,190.05	271,579.33
其中：交易所市场	57,190.05	271,579.33
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	114,547.84	90,000.00
应付信息披露费	42,082.56	120,000.00
应付指数使用费	107,194.65	76,904.49
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	321,016.04	558,483.82

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证全指证券公司指数（LOF）A		
项目	本期2023年01月01日至2023年05月08日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	696,727,802.78	696,727,802.78
本期申购	85,052,157.09	85,052,157.09
本期赎回 (以“-”号填列)	-193,298,326.46	-193,298,326.46
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	588,481,633.41	588,481,633.41
汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 05 月 08 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,044,851,835.39	1,044,851,835.39
本期申购	236,658,830.86	236,658,830.86
本期赎回 (以“-”号填列)	-384,192,814.76	-384,192,814.76
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	897,317,851.49	897,317,851.49

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

汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,745,649.45	-88,899,662.81	-65,154,013.36
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	23,745,649.45	-88,899,662.81	-65,154,013.36
本期利润	-19,513,972.94	85,989,277.37	66,475,304.43
本期基金份额交易产生的变动数	-2,258,951.06	6,807,325.73	4,548,374.67

其中：基金 申购款	1,149,569.61	-3,977,090.35	-2,827,520.74
基金赎回款	-3,408,520.67	10,784,416.08	7,375,895.41
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	1,972,725.45	3,896,940.29	5,869,665.74
汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,378,269.96	-133,412,817.51	-99,034,547.55
加：会计政 策变更	-	-	-
本期期初	34,378,269.96	-133,412,817.51	-99,034,547.55
本期利润	-30,507,045.65	133,927,063.15	103,420,017.50
本期基金份 额交易产生 的变动数	-2,630,547.88	5,135,424.06	2,504,876.18
其中：基金 申购款	2,885,993.08	-11,359,903.53	-8,473,910.45
基金赎回款	-5,516,540.96	16,495,327.59	10,978,786.63
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	1,240,676.43	5,649,669.70	6,890,346.13

#### 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 05 月 08 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	105,593.11	351,259.62
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	1,685.26	7,917.51
其他	2,498.81	20,124.56
合计	109,777.18	379,301.69

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 05 月 08 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

股票投资收益——买卖股票差价收入	-47,175,650.40	-166,277,702.05
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-47,175,650.40	-166,277,702.05

#### 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年05月08日	2022年01月01日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	284,660,918.92	776,201,468.05
减：卖出股票成本总额	331,294,897.71	940,466,601.23
减：交易费用	541,671.61	2,012,568.87
买卖股票差价收入	-47,175,650.40	-166,277,702.05

#### 7.4.7.11.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无证券出借差价收入。

#### 7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年05月08日	2022年01月01日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	-	669.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	898,702.79
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	-	899,372.17
----	---	------------

#### 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05月08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	-	9,594,005.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	8,680,800.00
减：应计利息总额	-	14,488.56
减：交易费用	-	14.59
买卖债券差价收入	-	898,702.79

#### 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05月08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	660,582.46	33,212,942.75
其中：证券出借权益补偿收入	-	704,446.82
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	660,582.46	33,212,942.75

##### 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05月08日	2022年01月01日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	219,916,340.52	-418,235,590.88
——股票投资	219,916,340.52	-418,235,590.88
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	219,916,340.52	-418,235,590.88

#### 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05月08日	2022年01月01日至2022年12月31日
基金赎回费收入	126,528.47	666,051.37
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	126,528.47	666,051.37

#### 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05月08日	2022年01月01日至2022年12月31日
审计费用	24,547.84	90,000.00
信息披露费	42,082.56	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	-	-
指数使用费	107,194.65	346,113.55



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	173,825.05	556,113.55

#### 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, 基金发起人
中信建投证券股份有限公司 (“中信建投证券”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (新加坡) 有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 05 月 08 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 (%)
中信建投证券	321,251,003.07	100.00	1,510,491,948.65	100.00

#### 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 05 月 08 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 (%)
中信建投证券	-	-	14,577,721.00	100.00

#### 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 05 月 08 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
中信建投证券	231,717.84	100.00	57,190.05	100.00
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 (%)
中信建投证券	1,084,045.00	100.00	271,579.33	100.00

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05月08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	2,659,337.40	8,652,839.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	896,886.15	2,595,652.95
应支付基金管理人的净管理费	1,762,451.25	6,057,186.59

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对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05月08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	531,867.47	1,730,567.87

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 05 月 08 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C	合计
中信建投证券股份有限公司	-	425.58	425.58
东方证券股份有限公司	-	886.07	886.07
汇添富基金管理股份有限公司	-	137,598.14	137,598.14
合计	-	138,909.79	138,909.79
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		
	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C	合计
中信建投证券股份有限公司	-	2,001.74	2,001.74
东方证券股份有限公司	-	1,913.22	1,913.22
汇添富基金管理股份有限公司	-	489,501.93	489,501.93
合计	-	493,416.89	493,416.89

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 0.25%。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 0.25% 年费率计提, 计算方法如下:

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

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，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 05 月 08 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信建投证券	44,043,817.00	30,401.81	-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	5,425,500.00	3,623.52	-	-
中信建投证券	180,955,971.00	122,108.87	9,873,302.00	4,301.72

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

单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 05 月 08 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日						

关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	2,129,990.00	3.40~3.60	3.54	2,933.03	-	-
中信建投证券	11,406,500.00	3.50	3.50	15,525.51	-	-

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注： 本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

注： 本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额，本报告期及上年度可比期间均未有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 05 月 08 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 股)	总金额
				-	-
上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 股)	总金额
东方证券承销保荐有限公司	600958	东方证券	原股东优先配售	1,320,363.00	11,170,270.98

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

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

人的股东东方证券发行的股票东方证券，和基金托管人中信建投证券发行的股票中信建投。

于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 4,614,044.00 股，持有中信建投 1,146,635.00 股。（于上年度末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 5,449,444.00 股，持有中信建投 1,354,035.00 股。）

#### 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 05 月 08 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
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	11.88	18.65	1,386	16,465.68	25,848.90	
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	15.38	15.91	177	2,722.26	2,816.07	
301265	华新环保	2022年12月08日	6个月	新股流通受限	13.28	11.43	819	10,876.32	9,361.17	
601065	江西省盐	2023年03月	6个月	新股流通	10.36	10.42	88	911.68	916.96	

	业集团	31日		受限						
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	25.57	160	4,156.80	4,091.20	
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	17.80	16.66	628	11,178.40	10,462.48	
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	15.90	16.51	139	2,210.10	2,294.89	
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
					-	-	-	-	-	

#### 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 05 月 08 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 05 月 08 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 05 月 08 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.3 流动性风险

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

###### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于

开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年05月08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	81,217,721.17	-	-	-	-	-	81,217,721.17
结算备付	68,705.31	-	-	-	-	-	68,705.31

金							
存出 保证金	264,652.52	-	-	-	-	-	264,652.52
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	1,417,444,485.57	1,417,444,485.57
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	20,036,143.96	20,036,143.96
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	39,774.03	-	-	-	-	1,096,575.49	1,136,349.52
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	81,590,853.03	-	-	-	-	1,438,577,205.02	1,520,168,058.05
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	-	-	-	-	-	21,044,381.88	21,044,381.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	161,331.65	161,331.65
应付托管费	-	-	-	-	-	32,266.33	32,266.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	48,928.73	48,928.73
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	636.65	636.65
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	321,016.04	321,016.04
负债总计	-	-	-	-	-	21,608,561.28	21,608,561.28
利率敏感度缺口	81,590,853.03	-	-	-	-	1,416,968,643.74	1,498,559,496.77
上年度末2022	1个月以内	1-3个月	3个月	1-5年	5年以上	不计息	合计

年 12 月 31 日		月	-1 年		上		
资产							
货币 资金	86,387,403.04	-	-	-	-	-	86,387,403.04
结算 备付 金	200,965.10	-	-	-	-	-	200,965.10
存出 保证 金	320,471.95	-	-	-	-	-	320,471.95
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	1,491,652,815.88	1,491,652,815.88
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	94,034.55	-	-	-	-	1,883,982.35	1,978,016.90
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	7,184.73	7,184.73
资产 总计	87,002,874.64	-	-	-	-	1,493,543,982.96	1,580,546,857.60
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	-	-	-	-	-	1,584,598.69	1,584,598.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	673,193.83	673,193.83
应付托管费	-	-	-	-	-	134,638.77	134,638.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-	203,960.53	203,960.53
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	904.70	904.70
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	558,483.82	558,483.82
负债	-	-	-	-	-	3,155,780.34	3,155,780.34

总计							
利率敏感程度缺口	87,002,874.64	-	-	-	-	1,490,388,202.62	1,577,391,077.26

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 05 月 08 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	1,417,444,485.57	94.59	1,491,652,815.88	94.56
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,417,444,485.57	94.59	1,491,652,815.88	94.56

##### 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 05 月 08 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证全指证券公司指数上涨 5%	70,785,999.67	74,686,502.11
中证全指证券公司指数下跌 5%	-70,785,999.67	-74,686,502.11	

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 05 月 08 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,417,388,693.90	1,491,643,479.28
第二层次	-	-
第三层次	55,791.67	9,336.60
合计	1,417,444,485.57	1,491,652,815.88

###### 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05月08日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	9,336.60	9,336.60
当期购买	-	37,644.92	37,644.92
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	8,810.15	8,810.15
其中：计入损益的利得或损失	-	8,810.15	8,810.15
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	55,791.67	55,791.67
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	-	8,810.15	8,810.15
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,444,925.46	1,444,925.46
当期购买	-	10,876.32	10,876.32
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,444,925.46	1,444,925.46
当期利得或损失总额	-	-1,539.72	-1,539.72

其中：计入损益的利得或损失	-	-1,539.72	-1,539.72
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	9,336.60	9,336.60
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-1,539.72	-1,539.72

#### 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	55,791.67	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.3730-1.8969	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	9,336.60	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.4326	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	21,883,689.39	1.89
	其中：股票	21,883,689.39	1.89
2	基金投资	1,070,122,242.19	92.20
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	63,925,009.25	5.51
8	其他各项资产	4,677,887.26	0.40
9	合计	1,160,608,828.09	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	21,883,689.39	1.89
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,883,689.39	1.89

### 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	600030	中信证券	143,044	2,913,806.28	0.25
2	300059	东方财富	185,916	2,610,260.64	0.23
3	600837	海通证券	141,434	1,325,236.58	0.11
4	601688	华泰证券	75,448	1,052,499.60	0.09
5	601211	国泰君安	66,058	982,943.04	0.08
6	600999	招商证券	54,431	742,438.84	0.06
7	600958	东方证券	76,581	666,254.70	0.06
8	000776	广发证券	43,402	620,214.58	0.05
9	601377	兴业证券	101,283	594,531.21	0.05
10	000166	申万宏源	132,100	586,524.00	0.05
11	601995	中金公司	12,899	490,806.95	0.04
12	601901	方正证券	60,300	486,018.00	0.04
13	601066	中信建投	19,035	450,368.10	0.04
14	601788	光大证	28,601	441,027.42	0.04

		券			
15	601555	东吴证 券	58,679	428,943.49	0.04
16	601099	太平洋	99,900	369,630.00	0.03
17	601108	财通证 券	47,595	369,337.20	0.03
18	601881	中国银 河	30,204	363,958.20	0.03
19	600109	国金证 券	38,190	346,765.20	0.03
20	601162	天风证 券	101,570	313,851.30	0.03
21	000783	长江证 券	56,712	305,110.56	0.03
22	601878	浙商证 券	28,363	295,826.09	0.03
23	002797	第一创 业	49,300	286,433.00	0.02
24	600918	中泰证 券	40,800	279,888.00	0.02
25	600155	华创云 信	33,100	276,054.00	0.02
26	000728	国元证 券	38,420	262,408.60	0.02
27	601990	南京证 券	32,401	258,559.98	0.02
28	600061	国投资 本	37,669	253,889.06	0.02
29	601696	中银证 券	24,400	251,076.00	0.02
30	002673	西部证 券	39,300	250,341.00	0.02
31	600369	西南证 券	58,400	238,856.00	0.02
32	601198	东兴证 券	28,397	233,707.31	0.02
33	600909	华安证 券	41,356	201,817.28	0.02
34	000750	国海证 券	56,200	198,948.00	0.02
35	601456	国联证 券	17,466	189,331.44	0.02
36	002939	长城证	23,646	189,168.00	0.02

		券			
37	002926	华西证 券	23,100	179,256.00	0.02
38	002500	山西证 券	31,600	170,324.00	0.01
39	002670	国盛金 控	17,022	158,645.04	0.01
40	601236	红塔证 券	20,730	157,340.70	0.01
41	601375	中原证 券	40,400	154,732.00	0.01
42	000686	东北证 券	20,600	146,260.00	0.01
43	600906	财达证 券	19,000	142,500.00	0.01
44	600621	华鑫股 份	9,300	130,851.00	0.01
45	600864	哈投股 份	18,300	104,127.00	0.01
46	000712	锦龙股 份	6,600	96,822.00	0.01
47	600095	湘财股 份	12,600	94,626.00	0.01
48	601059	信达证 券	4,800	86,352.00	0.01
49	601136	首创证 券	4,400	74,624.00	0.01
50	002945	华林证 券	4,000	60,400.00	0.01

## 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	600030	中信证券	10,358,757.00	0.89
2	300059	东方财富	6,025,872.00	0.52
3	600837	海通证券	5,076,861.00	0.44
4	601688	华泰证券	3,843,024.00	0.33
5	601211	国泰君安	2,031,343.00	0.18

6	601995	中金公司	1,699,827.00	0.15
7	000776	广发证券	1,388,937.00	0.12
8	601377	兴业证券	1,332,206.89	0.12
9	000166	申万宏源	1,276,222.00	0.11
10	601901	方正证券	1,210,627.00	0.10
11	600958	东方证券	1,098,559.00	0.09
12	600999	招商证券	1,041,678.00	0.09
13	601108	财通证券	993,540.30	0.09
14	002736	国信证券	830,282.00	0.07
15	000783	长江证券	699,258.00	0.06
16	600155	华创云信	637,575.00	0.06
17	002797	第一创业	608,130.00	0.05
18	601162	天风证券	601,609.00	0.05
19	601555	东吴证券	586,915.00	0.05
20	000728	国元证券	543,677.00	0.05

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	300059	东方财富	182,161,254.34	15.74
2	000776	广发证券	41,808,898.23	3.61
3	000166	申万宏源	38,517,191.00	3.33
4	600030	中信证券	25,386,601.75	2.19
5	002736	国信证券	25,257,443.91	2.18
6	000783	长江证券	21,005,295.00	1.81
7	002797	第一创业	18,103,053.00	1.56
8	000728	国元证券	16,400,316.00	1.42
9	002673	西部证券	16,103,371.40	1.39
10	000750	国海证券	12,144,516.00	1.05
11	002926	华西证券	12,088,633.00	1.04
12	002500	山西证券	11,467,001.00	0.99
13	600837	海通证券	10,686,524.00	0.92
14	000686	东北证券	9,494,551.00	0.82
15	002939	长城证券	9,491,108.00	0.82
16	601688	华泰证券	8,780,812.00	0.76
17	002670	国盛金控	8,578,995.00	0.74
18	601211	国泰君安	5,795,802.00	0.50
19	000712	锦龙股份	5,405,131.00	0.47

20	600999	招商证券	5,223,960.00	0.45
----	--------	------	--------------	------

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	51,126,482.33
卖出股票收入（成交）总额	548,180,113.48

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.12 本报告期投资基金情况

##### 8.12.1 投资政策与风险说明

本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便投资者通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理



措施避免跟踪误差进一步扩大。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策，投资限制等要求。

### 8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	560090	证券指数ETF	交易型开放式	1,091,627,300.00	1,070,122,242.19	92.45	是

### 8.13 投资组合报告附注

#### 8.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、广发证券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。

### 8.13.2

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。

### 8.13.3 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	180,943.13
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,496,944.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,677,887.26

### 8.13.4 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。

### 8.13.5 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。

## § 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	1,417,444,485.57	93.24
	其中：股票	1,417,444,485.57	93.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	81,286,426.48	5.35
8	其他各项资产	21,437,146.00	1.41
9	合计	1,520,168,058.05	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,417,385,808.28	94.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,417,385,808.28	94.58

**8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,713.84	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,294.89	0.00
F	批发和零售业	27,668.56	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	58,677.29	0.00

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	8,613,144	195,432,237.36	13.04
2	300059	东方财富	11,193,956	180,446,570.72	12.04
3	600837	海通证券	8,519,734	87,753,260.20	5.86
4	601688	华泰证券	4,544,448	67,530,497.28	4.51
5	601211	国泰君安	3,978,758	62,784,801.24	4.19
6	600958	东方证券	4,614,044	52,230,978.08	3.49
7	600999	招商证券	3,274,831	49,711,934.58	3.32
8	000776	广发证券	2,611,802	42,494,018.54	2.84
9	601377	兴业证券	6,096,483	42,065,732.70	2.81
10	000166	申万宏源	7,955,600	38,902,884.00	2.60
11	601995	中金公司	773,899	32,782,361.64	2.19
12	601066	中信建投	1,146,635	30,798,616.10	2.06

13	601788	光大证 券	1,723,301	28,520,631.55	1.90
14	601901	方正证 券	3,633,000	26,230,260.00	1.75
15	601555	东吴证 券	3,534,079	26,222,866.18	1.75
16	002736	国信证 券	2,544,101	25,390,127.98	1.69
17	601108	财通证 券	2,868,995	22,951,960.00	1.53
18	000783	长江证 券	3,416,912	21,048,177.92	1.40
19	601162	天风证 券	6,117,170	20,125,489.30	1.34
20	600918	中泰证 券	2,460,300	18,919,707.00	1.26
21	600109	国金证 券	1,971,490	18,670,010.30	1.25
22	601878	浙商证 券	1,711,063	18,359,705.99	1.23
23	002797	第一创 业	2,967,000	18,128,370.00	1.21
24	600061	国投资 本	2,267,969	17,826,236.34	1.19
25	601990	南京证 券	1,951,101	16,877,023.65	1.13
26	601099	太平洋	6,014,400	16,780,176.00	1.12
27	000728	国元证 券	2,310,620	16,775,101.20	1.12
28	601696	中银证 券	1,471,000	16,666,430.00	1.11
29	002673	西部证 券	2,366,400	16,186,176.00	1.08
30	601881	中国银 河	1,137,504	15,094,678.08	1.01
31	601198	东兴证 券	1,710,997	14,765,904.11	0.99
32	600909	华安证 券	2,488,456	12,790,663.84	0.85
33	002926	华西证 券	1,389,500	12,338,760.00	0.82
34	000750	国海证 券	3,364,000	12,177,680.00	0.81

35	600369	西南证 券	2,930,200	11,574,290.00	0.77
36	002500	山西证 券	1,900,700	11,499,235.00	0.77
37	601456	国联证 券	1,053,566	11,157,263.94	0.74
38	601375	中原证 券	2,434,200	9,858,510.00	0.66
39	000686	东北证 券	1,239,800	9,782,022.00	0.65
40	002939	长城证 券	1,067,646	9,555,431.70	0.64
41	600906	财达证 券	1,145,000	8,976,800.00	0.60
42	002670	国盛金 控	1,024,922	8,568,347.92	0.57
43	601236	红塔证 券	832,030	7,047,294.10	0.47
44	600155	华创阳 安	997,279	7,040,789.74	0.47
45	600095	湘财股 份	755,000	6,462,800.00	0.43
46	600621	华鑫股 份	561,500	6,395,485.00	0.43
47	000712	锦龙股 份	395,400	5,444,658.00	0.36
48	600864	哈投股 份	917,600	4,964,216.00	0.33
49	002945	华林证 券	238,100	3,278,637.00	0.22

### 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	001287	中电港	1,460	27,668.56	0.00
2	603135	中重科技	628	10,462.48	0.00
3	301265	华新环保	819	9,361.17	0.00
4	603125	江苏常青 树科技	196	5,157.16	0.00

5	001360	南矿集团	177	2,816.07	0.00
6	603137	恒尚节能	139	2,294.89	0.00
7	601065	江西省盐业集团	88	916.96	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	300059	东方财富	5,249,511.20	0.33
2	600030	中信证券	4,893,799.94	0.31
3	600837	海通证券	2,117,633.00	0.13
4	601688	华泰证券	1,620,202.00	0.10
5	601211	国泰君安	1,570,437.30	0.10
6	600958	东方证券	1,279,839.44	0.08
7	600999	招商证券	1,275,393.00	0.08
8	000776	广发证券	1,131,954.00	0.07
9	601377	兴业证券	1,077,038.00	0.07
10	000166	申万宏源	925,316.00	0.06
11	601995	中金公司	844,781.00	0.05
12	601066	中信建投	823,310.00	0.05
13	601788	光大证券	722,053.00	0.05
14	601555	东吴证券	684,723.27	0.04
15	601901	方正证券	668,832.00	0.04
16	002736	国信证券	660,672.00	0.04
17	601108	财通证券	575,040.00	0.04
18	000783	长江证券	504,504.00	0.03
19	600109	国金证券	502,568.00	0.03
20	002797	第一创业	489,282.00	0.03

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	300059	东方财富	42,091,879.82	2.67
2	600030	中信证券	37,801,880.75	2.40

3	600837	海通证券	16,303,142.49	1.03
4	601688	华泰证券	12,219,379.00	0.77
5	601211	国泰君安	11,906,924.00	0.75
6	600958	东方证券	10,107,723.31	0.64
7	600999	招商证券	9,642,893.00	0.61
8	000776	广发证券	9,027,046.00	0.57
9	601377	兴业证券	8,249,532.00	0.52
10	000166	申万宏源	6,992,825.00	0.44
11	601995	中金公司	6,459,963.00	0.41
12	601066	中信建投	6,269,694.00	0.40
13	601788	光大证券	5,657,340.00	0.36
14	601555	东吴证券	5,189,423.60	0.33
15	601901	方正证券	5,147,151.00	0.33
16	002736	国信证券	5,009,549.00	0.32
17	601108	财通证券	4,581,860.50	0.29
18	000783	长江证券	4,018,267.00	0.25
19	600109	国金证券	3,917,051.00	0.25
20	601162	天风证券	3,850,875.00	0.24

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	37,170,226.88
卖出股票收入（成交）总额	284,660,918.92

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。



## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、招商证券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	264,652.52
2	应收清算款	20,036,143.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,136,349.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,437,146.00

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	001287	中电港	25,848.90	0.00	新股流通受限
2	603135	中重科技	10,462.48	0.00	新股流通受限
3	301265	华新环保	9,361.17	0.00	新股流通受限
4	603125	江苏常青树科技	4,091.20	0.00	新股流通受限
5	001360	南矿集团	2,816.07	0.00	新股流通受限

## § 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 (%)
汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A	26,695	18,201.93	3,469,598.83	0.71	482,430,863.44	99.29
汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C	50,135	14,904.52	6,262,969.32	0.84	740,974,910.29	99.16
合计	76,830	16,050.22	9,732,568.15	0.79	1,223,405,773.73	99.21

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	郭宗海	146,905.00	4.71
2	曾美青	109,485.00	3.51
3	扎西	101,400.00	3.25
4	杨永高	100,000.00	3.21
5	杨晓燕	99,443.00	3.19
6	王莉	99,443.00	3.19
7	侯建华	99,416.00	3.19
8	刘仡博	90,593.00	2.91
9	范东启	88,410.00	2.84
10	张建兴	85,200.00	2.73
汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	郑辉	1,715,496.00	36.92
2	张汉明	239,591.00	5.16
3	侍绕娣	202,939.00	4.37
4	李钰	200,036.00	4.31
5	吴建芳	122,484.00	2.64
6	李国强	122,200.00	2.63
7	于爱国	100,045.00	2.15
8	陶秀英	96,609.00	2.08
9	杨稳柱	90,000.00	1.94
10	温小芳	56,324.00	1.21

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

## 9.3 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	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A	242,919.91	0.05
	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C	8,880.48	0.00
	合计	251,800.39	0.02

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A	0
	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A	0
	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C	0
	合计	0

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

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

## § 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

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 (%)
汇添富中证全指证券公司指数 (LOF) A	31,330	18,783.33	37,475,033.61	6.37	551,006,599.80	93.63
汇添富中证全指证券公司指数	60,353	14,867.83	1,490,659.29	0.17	895,827,192.20	99.83

(LOF)C						
合计	91,683	16,205.83	38,965,692.90	2.62	1,446,833,792.00	97.38

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证全指证券公司指数（LOF）A			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	杨凯	571,197.00	12.68
2	北京银行股份有限公司—汇添富均衡增长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	203,050.00	4.51
3	郭宗海	146,905.00	3.26
4	刘万飞	122,131.00	2.71
5	曾美青	109,485.00	2.43
6	胥怀建	100,613.00	2.23
7	刘伧博	100,593.00	2.23
8	杨永高	100,000.00	2.22
9	杨晓燕	99,443.00	2.21
10	王莉	99,443.00	2.21
汇添富中证全指证券公司指数（LOF）C			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	郑辉	1,715,496.00	31.18
2	上海复熙资产管理有限公司—复熙恒赢8号私募证券投资基金	292,266.00	5.31
3	李贵民	287,800.00	5.23
4	侍绕娣	202,939.00	3.69
5	李钰	200,036.00	3.64
6	张汉明	124,905.00	2.27
7	于爱国	100,045.00	1.82
8	陶秀英	96,609.00	1.76
9	范东启	92,453.00	1.68
10	杨稳柱	90,000.00	1.64

注：本基金为LOF基金，上表持有人为场内持有人。

## 9.3 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	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	169,524.68	0.03
	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C	46,282.47	0.01
	合计	215,807.15	0.01

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	0
	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	0
	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C	0
	合计	0

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

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

#### 9.6 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,001,350.04 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 12 月 04 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

### § 10 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) A	汇添富中证全指证券公司 ETF 联接 (LOF) C
基金合同生效日 (2023 年 05 月 09 日) 基金份额总额	588,481,633.41	897,317,851.49
基金合同生效日起至 报告期末基金总申	202,303,708.91	403,827,777.72

购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	304,884,880.05	553,907,749.60
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	485,900,462.27	747,237,879.61

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	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)A	汇添富中证全指证券公司指数 (LOF)C
基金合同生效日 (2017年12月04日) 基金份额总额	92,502,649.80	162,836,832.00
本报告期期初基金份额总额	696,727,802.78	1,044,851,835.39
本报告期基金总申购份额	85,052,157.09	236,658,830.86
减：本报告期基金总赎回份额	193,298,326.46	384,192,814.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	588,481,633.41	897,317,851.49

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金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 5 月 9 日原“汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF)”转型为“汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)”。汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的投资策略请详见 2023 年 5 月 9 日刊登在本公司网站的《汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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 (2017 年 12 月 04 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 (%)	
中信建投证券	5	599,306,595.81	100.00	432,297.35	100.00	

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。



### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中信建投证券	14,623,002.00	100.00	-	-	-	-	352,034,019.20	100.00

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

- （1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- （2）交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- （3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- （4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。
- （5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。
- （6）成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- （7）调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。
- （8）按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理

公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：中信建投证券（北交所单元）。

### 11.7 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 (%)	
中信建投证券	4	321,251,003.07	100.00	231,717.84	100.00	

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分

配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元:中信建投证券(深交所单元,上交所单元)。

## 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	关于汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金(LOF)转型为汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)并相应修订法律文件的公告	中证报,上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 09 日
2	汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)法律文件	上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 09 日
3	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
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固有资金投资旗下基金的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日

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	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	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

注: 无。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 募集的文件；

2、《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同》；

3、《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 托管协议》；

4、《汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》；

5、《汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 托管协议》；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、报告期内汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 在规定报刊上披露的各项公告；

8、报告期内汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 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](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2024 年 03 月 29 日