

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1. 1 重要提示	2
1. 2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2. 1 基金基本情况	5
2. 2 基金产品说明	5
2. 3 基金管理人和基金托管人	5
2. 4 信息披露方式	6
2. 5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3. 1 主要会计数据和财务指标	6
3. 2 基金净值表现	7
3. 3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4. 1 基金管理人及基金经理情况	9
4. 2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	21
4. 3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	21
4. 4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	23
4. 5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	24
4. 6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	24
4. 7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	25
4. 8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	25
4. 9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	25
§ 5 托管人报告	26
5. 1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	26
5. 2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	26
5. 3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	26
§ 6 审计报告	26
6. 1 审计报告的基本信息	26
6. 2 审计报告的基本内容	26
§ 7 年度财务报表	28
7. 1 资产负债表	28
7. 2 利润表	29
7. 3 净资产变动表	30
7. 4 报表附注	32
§ 8 投资组合报告	70
8. 1 期末基金资产组合情况	70
8. 2 报告期末按行业分类的股票投资组合	71
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	72

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	107
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	108
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.....	108
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....	108
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....	108
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.....	109
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	109
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	109
8.12 投资组合报告附注.....	109
§ 9 基金份额持有人信息	110
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	110
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	110
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	111
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.....	112
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.....	112
§ 10 开放式基金份额变动	112
§ 11 重大事件揭示	112
11.1 基金份额持有人大会决议.....	112
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.....	112
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	113
11.4 基金投资策略的改变.....	113
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	113
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.....	113
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	113
11.8 其他重大事件.....	116
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	119
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.....	119
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	120
§ 13 备查文件目录	120
13.1 备查文件目录.....	120
13.2 存放地点	120
13.3 查阅方式	120

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 08 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额 (份)	6,148,187,198.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 16 日

注：扩位证券简称：800ETF。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 姓名	李鹏	潘琦

负责人	联系电话	021-28932888	0755-22168257
	电子邮箱	service@99fund.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95511-3
传真		021-28932998	0755-82080387
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		200010	518001
法定代表人		李文	谢永林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-11,192,996.60	-250,957,513.39	-18,812,314.48
本期利润	877,253,397.64	-696,623,165.87	-423,151,107.97
加权平均基金份额本期利润	0.1225	-0.1733	-0.2531
本期加权	13.51%	-17.57%	-22.33%

平均净值利润率			
本期基金份额净值增长率	15.11%	-8.25%	-19.33%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	82,924,600.93	-975,820,862.70	129,057,039.83
期末可供分配基金份额利润	0.0135	-0.1195	0.0739
期末基金资产净值	6,231,111,798.93	7,191,116,335.30	1,874,494,237.83
期末基金份额净值	1.0135	0.8805	1.0739
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	13.41%	-1.47%	7.39%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三	-1.42%	1.77%	-1.62%	1.78%	0.20%	-0.01%

个月						
过去六个月	15. 87%	1. 71%	14. 22%	1. 72%	1. 65%	-0. 01%
过去一年	15. 11%	1. 42%	12. 20%	1. 43%	2. 91%	-0. 01%
过去三年	-14. 80%	1. 19%	-20. 87%	1. 20%	6. 07%	-0. 01%
过去五年	12. 96%	1. 22%	-1. 22%	1. 23%	14. 18%	-0. 01%
自基金合同生效起至今	13. 41%	1. 20%	5. 91%	1. 21%	7. 50%	-0. 01%

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

添富中证 800ETF 累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

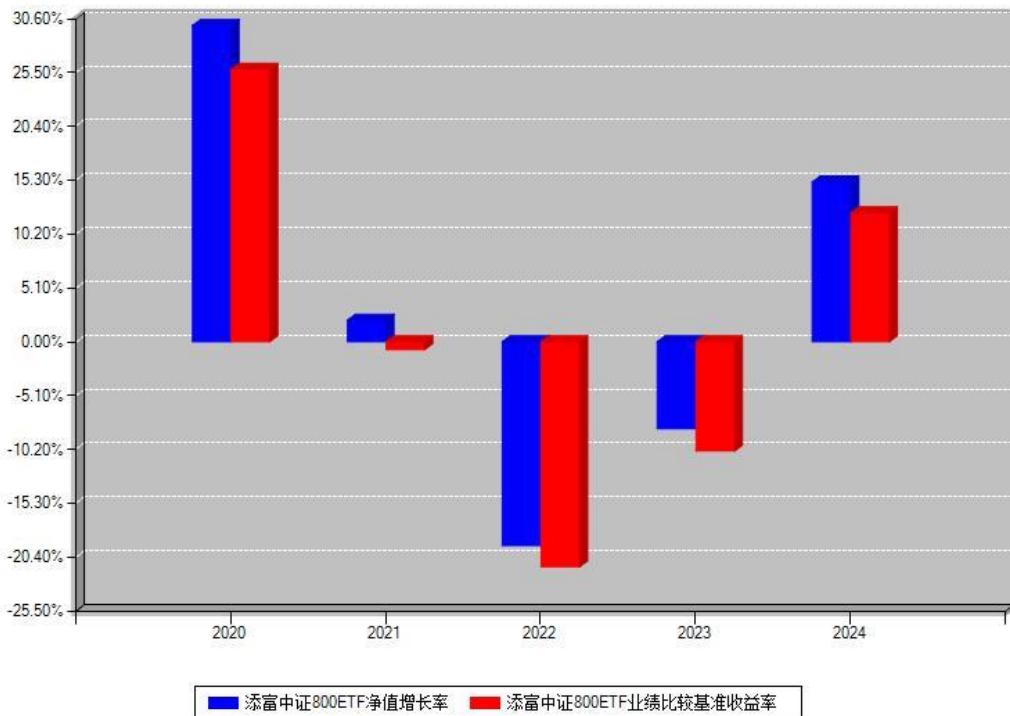


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

添富中证800ETF每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为2019年10月08日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024年	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
2023年	1.1200	929,368,966.13	0.00	929,368,966.13	-
2022年	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
合计	1.1200	929,368,966.13	0.00	929,368,966.13	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国、

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、汇添富投资管理有限公司、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。

2024 年,汇添富基金新成立 32 只公募基金,包括 6 只混合型基金,16 只股票型基金,10 只债券型基金。2024 年底,公司公募基金产品总数达 342 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。

2024 年,汇添富基金持续推进投顾式销售及服务模式的深度发展,注重从客户需求出发,坚持以客户回报为导向,不断优化基金售前、售中、售后服务及体验。同时,互金业务不断开拓从服务端发力的创新路径,积极探索数字化转型,利用大数据、人工智能等技术,持续优化平台各项功能,力争为客户提供差异化、智能化的服务体验。

另外,汇添富基金与第三方销售机构紧密合作,在工具创新、投教内容及形式创新、客户服务等方面展开了全方位深入合作,形成了较为完善的线上服务体系,更好地满足了客户多元化投资需求,进一步提升了客户体验及满意度。

2024 年,汇添富基金秉持金融服务实体经济、满足居民财富管理需求的宗旨,以高质量发展为目标,持续提升投资者的获得感。公司继续坚定推进与核心机构客户的合作战略,机构业务保持高质量发展势头。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,同时也致力于服务其他机构投资者的专业投资需求。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。

2024 年，汇添富渠道业务坚持一切从长期出发和客户第一的原则，持续深化渠道融合共建，秉持开放生态理念，通过渠道服务、产品布局、科技赋能与创新意识，全方位提升渠道服务体系的广度与深度，推动渠道合作迈向新高度。广泛开展线下投资者教育工作，全年合计举办投资者教育活动 4846 场，覆盖 417398 人次。线上数字化运营创新升级，围绕着优化运营模式、提升运营质量、增强运营效率等维度展开，获得银行渠道的一致认可。

2024 年，汇添富基金继续加强券商渠道的专业化服务。全年围绕不同投资主题推出“指增季”“固收季”“主动季”系列调研，并在全国举办多场投顾赋能培训活动，帮助券商提升资产配置和客户服务能力。为了让投资者获得更多交流机会，公司全年开展超过 2700 场线上线下活动，既有专业投资策略会，也有基金经理面对面和“走进汇添富”交流活动。公司始终把客户体验放在第一位，通过持续为券商提供专业支持，让优质服务覆盖更多投资者。

2024 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。

2024 年，汇添富香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化，并继续发挥显着成效，国际业务总资产管理规模保持稳定。随着汇添富稳定收益基金获批，汇添富香港子公司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。从 2024 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。

2024 年以来，汇添富基金积极开展公益慈善工作，充分发挥公募基金优势，践行社会责任，为助力实现“共同富裕”与中国式现代化贡献力量。公司连续十六年开展“河流·孩子”公益助学项目，举办第十七期乡村优秀青年教师培训和第七届乡村教育管理研习班，启动添富小学合唱团公益项目，助力乡村教育高质量发展；举办第四期“基业上善”慈善资产管理研修营，用专业力量推动我国公益慈善事业的可持续发展；发起第二期“致敬城市建设者”公益项目，让人民城市更有温度；参加云南、青海、内蒙古、陕西等地产业、教育和养老助老帮扶等项目，深化东西部协作，助力乡村振兴。

2025 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穷	本基金的基金经理	2019 年 10 月 08 日	-	10	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至 2023 年 8 月 29 日任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2024 年 4 月 19 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月

					8 日至今任汇添富中证沪港深互联互通交易型开放式指数证券投资基金管理的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金管理的基金经理。 2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金管理的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金管理的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2024 年 9 月 29 日任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金管理的基金经理。 2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。 2021 年 10 月 29 日至今任汇添富富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金管理的基金经理。2021 年 12
--	--	--	--	--	---

					月 28 日至今任 汇添富中证沪港 深云计算产业指 数型发起式证券 投资基金的基金 经理。2022 年 1 月 11 日至 2023 年 11 月 28 日任 汇添富 MSCI 中 国 A50 互联互通 交易型开放式指 数证券投资基金 联接基金的基金 经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任 汇添富中证人工 智能主题交易型 开放式指数证券 投资基金联接基 金的基金经理。 2022 年 6 月 13 日至 2023 年 9 月 28 日任中证 长三角一体化发 展主题交易型开 放式指数证券投 资基金联接基金 的基金经理。 2022 年 7 月 29 日至 2024 年 2 月 7 日任汇添富 中证 1000 交易 型开放式指数证 券投资基金的基 金经理。2022 年 8 月 31 日至今任 汇添富恒生科技 交易型开放式指 数证券投资基金 (QDII) 的基金 经理。2022 年 10 月 31 日至今 任汇添富恒生科
--	--	--	--	--	--

					技交易型开放式指数证券投资基 金发起式联接基金 (QDII) 的基 金经理。2022 年 12 月 7 日至今任 汇添富恒生生物 科技交易型开放 式指数证券投资 基金 (QDII) 的 基金经理。2023 年 4 月 13 日至 今任汇添富恒生 指 数型证券投资基 金 (QDII- LOF) 的基金经 理。2023 年 5 月 24 日至 2024 年 7 月 5 日任汇添 富中证国新央企 股东回报交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2023 年 6 月 19 日至 2024 年 7 月 9 日任汇添 富中证 1000 交易型开放式指 数证券投资基金 联接基金的基金 经理。2023 年 8 月 23 日至今任 汇添富中证智能 汽车主题交易型 开放式指数证券 投资基金的基金 经理。2023 年 12 月 28 日至今 任汇添富国证港 股通创新药交易 型开放式指数证 券投资基金的基 金经理。2024 年 2 月 5 日至今任
--	--	--	--	--	--

					汇添富 MSCI 美国 50 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。 2024 年 3 月 1 日至今任汇添富恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024 年 4 月 1 日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 2024 年 10 月 28 日至今任汇添富中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
过蓓蓓	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2019 年 10 月 08 日	-	13	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金管理从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年

					6 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 13 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至 2023 年 4 月 6 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 8 月 29 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至 2023 年 5 月 22 日任深证 300 交易型开放
--	--	--	--	--	--

					式指数证券投资 基金的基金经理。 2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证 生物科技主题指数型 发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。 2016 年 12 月 29 日至 2022 年 12 月 1 日任 汇添富中证中药指数型 发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。 2018 年 5 月 23 日至 今任汇添富中证新能 源汽车产业指数型发 起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。 2018 年 10 月 23 日至 2023 年 5 月 22 日任 中证银行交易型开放 式指数证券投资基金的 基金经理。 2019 年 3 月 26 日至 今任汇添富中证医药 卫生交易型开放式指 数证券投资基金联接基 金的基金经理。 2019 年 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任 中证银行交易型开放 式指数证券投资基金 联接基金的基金经理。 2019 年 10 月 8 日至 今任中证 800 交易型 开放式指数
--	--	--	--	--	---

					证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至 2023 年 5 月 18 日任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至 2024 年 4 月 8 日任汇添富中证 100 交易型
--	--	--	--	--	---

					开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 2 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 3 月 14 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 3 月 30 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 8 月 2 日至今任汇添富纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) 的基金经理。2023 年 8 月 23 日至今任汇添富黄金及贵金属证券投资基金 (LOF) 的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注: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。

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。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

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

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

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

保公平对待各投资组合。

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块，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 9 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

2024 年全年资本市场经历较大震荡。一季度经历快速下跌后强势反弹。二三季度阶段性震荡后持续下行，在九月末迎来政策助推下的预期反转行情，成交放大、交易活跃度大幅改善。进入四季度市场体现为板块分化、波动加大的状态。全年 A 股主要宽基小幅上涨，大盘表现优于小盘。

美联储 9 月起开启降息。2024 年内，累计出现三次降息，在 9 月、11 月、12 月分别调降 50、25、25 个基点，累计降息幅度达到 100 个基点，联邦基金目标利率达到 4.25%-4.50%。同时美国四季度大选结果出炉，市场对美国 2025 年经济增长和通胀的预期均有所上修，或有对税收和移民政策方面出现调整的预期变化影响。

国内来看，政策的推出节奏在持续进行动态调整、积极适应市场变化，下半年发力超预期。3 月两会召开，政府工作报告提出，2024 年全年国内生产总值增长 5% 左右、居民消费价格涨幅 3% 左右、居民收入增长和经济增长同步等发展目标。总体政策基调依然坚持“稳中求进，以进促稳”。4 月《国务院关于加强监管防范风险推动资本市场高质量发展的若干意见》印发，为资本市场第三个“国九条”。随后，证监会、交易所各项配套制度规则也陆续发布，“1+N”政策体系快速推进落地。9 月下旬政治局会议政策发力超预期、央行降息降准落地等，对市场信心带来逆转式提振。12 月中央政治局会议、中央经济工作会议陆续召开，提出“坚持稳中求进、以进促稳”、“实施更加积极有为的宏观政策”等，并首次出现“超常规逆周期调节”的提法，体现了更加积极的政策基调。财政政策更加积极，货币政策适度宽松，相比 9 月会议也有边际加力的倾向。对于具体领域，“大力提振消费”、“稳住楼市股市”等也带来了市场信心及预期稳定的基础。

从资本市场的表现来看，9 月下旬的一系列政策出现了较强的扭转预期的效果，力度超过市场预期，市场情绪迅速提振，估值显著修复。但四季度边际改善相对有限，随着政策逐步落地，结合经济实质性修复，有望带来长期投资机遇。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 15.11%。同期业绩比较基准收益率为 12.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年宏观经济整体展现出较强的韧性，预计全年目标有望顺利实现。12 月中央政治局会议和中央经济工作会议释放大力提振内需等积极信号，消费与制造业景气度有望呈现回升态势。然而外部环境依然存在不确定性，全球竞争、国际关系、全球通胀等因素依然可能对国内经济发展带来挑战。整体来看预计政策力度将适时适度适应市场动态变化，继续推动经济稳步复苏，中国经济的中长期改善预期不变。

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、持续提升合规管理

公司以党的二十届三中全会精神、新“国九条”及证监会配套政策等国家重要政策方针为指导，大力深化合规管理体系建设，在合规管理工作中贯彻落实政策精神及各项法规要求，坚守合规底线、防范合规风险。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”的价值观，通过完善合规管理体系、提升合规专业能力、优化合规资源配置等举措，不断提升合规管理工作的有效性。公司强化工规制度建设，同时深入审慎开展合规审查、合规咨询、合规检查、合规监测等日常工作；高度重视并持续开展员工执业操守和职业道德建设，广泛开展合规培训，强化全员合规意识及合规敏感度；加强监督督促职能，规范人员执业行为，强化一线合规执行效果；高度重视合规管理专业能力建设，保障合规资源配置、优化合规工作机制，不断提升公司合规管理水平。

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；通过协助监管机构开展各项自查、核查工作，协调第三方独立机构开展审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过督促并跟踪检查风险隐患整改，持续优化公司内部控制管理，切实维护基金份额持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本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

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2025)审字第 70015647_B123 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度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

	守则，我们独立于中证 800 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>中证 800 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否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</p>

	<p>据获取的审计证据，就可能导致对中证 800 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中证 800 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈露 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	2025 年 03 月 31 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	32,338,603.37	31,664,606.54
结算备付金		54,036,579.69	20,496,024.86
存出保证金		16,327,350.18	11,218,473.50
交易性金融资产	7.4.7.2	6,093,957,932.04	7,092,656,805.20
其中：股票投资		6,093,957,932.04	7,092,532,901.40
基金投资		—	—
债券投资		—	123,903.80
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	-2,756.16	-6,390.42
债权投资	7.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—

资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
应收清算款		40,413,750.91	57,357,928.62
应收股利		—	19,940.00
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	136,954.82
资产总计		6,237,071,460.03	7,213,544,343.12
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		3,843,547.52	19,898,301.48
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		796,910.28	946,482.10
应付托管费		265,636.78	315,494.03
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		—	14,095.58
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.7	1,053,566.52	1,253,634.63
负债合计		5,959,661.10	22,428,007.82
净资产:			
实收基金	7.4.7.8	6,148,187,198.00	8,166,937,198.00
未分配利润	7.4.7.9	82,924,600.93	-975,820,862.70
净资产合计		6,231,111,798.93	7,191,116,335.30
负债和净资产总计		6,237,071,460.03	7,213,544,343.12

注: 报告截止日 2024 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.0135 元, 基金份额总额 6,148,187,198.00 份。

7.2 利润表

会计主体: 中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日
----	-----	---	--

一、营业总收入		892, 523, 605. 66	-687, 327, 550. 17
1. 利息收入		2, 726, 612. 85	3, 423, 243. 52
其中：存款利息收入	7. 4. 7. 10	904, 097. 53	530, 394. 70
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		84, 870. 74	19, 171. 23
其他利息收入		1, 737, 644. 58	2, 873, 677. 59
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3, 241, 745. 35	-248, 887, 897. 64
其中：股票投资收益	7. 4. 7. 11	-199, 696, 366. 70	-293, 720, 990. 96
基金投资收益	7. 4. 7. 12	—	—
债券投资收益	7. 4. 7. 13	98, 526. 63	181, 581. 24
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	20, 690, 978. 62	-12, 402, 435. 17
股利收益	7. 4. 7. 17	175, 665, 116. 10	57, 053, 947. 25
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	888, 446, 394. 24	-445, 665, 652. 48
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	4, 592, 343. 92	3, 802, 756. 43
减：二、营业总支出		15, 270, 208. 02	9, 295, 615. 70
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	9, 771, 805. 01	5, 925, 364. 65
其中：暂估管理人报酬		—	—
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	3, 257, 268. 41	1, 975, 121. 57
3. 销售服务费		—	—
4. 投资顾问费		—	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 信用减值损失	7. 4. 7. 20	—	—
7. 税金及附加		85, 607. 72	19, 473. 23
8. 其他费用	7. 4. 7. 21	2, 155, 526. 88	1, 375, 656. 25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		877, 253, 397. 64	-696, 623, 165. 87
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		877, 253, 397. 64	-696, 623, 165. 87
五、其他综合收益的税后净额		—	—
六、综合收益总额		877, 253, 397. 64	-696, 623, 165. 87

7.3 净资产变动表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	8,166,937,198.00	-975,820,862.70	7,191,116,335.30
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	8,166,937,198.00	-975,820,862.70	7,191,116,335.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,018,750,000.00	1,058,745,463.63	-960,004,536.37
(一)、综合收益总额	-	877,253,397.64	877,253,397.64
(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）	-2,018,750,000.00	181,492,065.99	-1,837,257,934.01
其中：1. 基金申购款	3,519,750,000.00	-227,703,691.15	3,292,046,308.85
2. 基金赎回款	-5,538,500,000.00	409,195,757.14	-5,129,304,242.86
(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	6,148,187,198.00	82,924,600.93	6,231,111,798.93
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,745,437,198.00	129,057,039.83	1,874,494,237.83
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,745,437,198.00	129,057,039.83	1,874,494,237.83
三、本期增减变	6,421,500,000.00	-1,104,877,902.53	5,316,622,097.47

变动额（减少以“-”号填列）			
(一)、综合收益总额	-	-696,623,165.87	-696,623,165.87
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	6,421,500,000.00	521,114,229.47	6,942,614,229.47
其中：1. 基金申购款	8,639,750,000.00	323,099,324.43	8,962,849,324.43
2. 基金赎回款	-2,218,250,000.00	198,014,905.04	-2,020,235,094.96
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-929,368,966.13	-929,368,966.13
四、本期期末净资产	8,166,937,198.00	-975,820,862.70	7,191,116,335.30

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：

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]162 号文《关于准予中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2019 年 10 月 8 日生效。首次设立基金募集规模为 6,601,437,198.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2019）验字第 60466941_A04 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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、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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 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，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期

间计入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权；
 2、本基金的收益分配采用现金分红；
 3、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；
 4、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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；

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征增值税试点的通知》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[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[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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	32,338,603.37	31,664,606.54
等于： 本金	32,331,354.55	31,657,593.50
加： 应计利息	7,248.82	7,013.04
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	32,338,603.37	31,664,606.54

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,856,179,782. 43	—	6,093,957,932.04	237,778,149.6 1
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	5,856,179,782. 43	—	6,093,957,932.04	237,778,149.6 1
项目	上年度末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,744,730,226. 03	—	7,092,532,901.40	652,197,324.6 3
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	123,900.00	3.80	123,903.80
	银行间市场	—	—	—
	其他	—	—	—
	合计	123,900.00	3.80	123,903.80
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	7,744,854,126. 03	3.80	7,092,656,805.20	652,197,324.6 3

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日				备注	
	合同/名义金额	公允价值		资产		
		负债				
利率衍生工具	-	-	-	-	-	
(国债期货投资)	-	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	-	
(外汇期货投资)	-	-	-	-	-	
权益衍生工具	127,415,220.00	-	-	-	-	
(权证投资)	-	-	-	-	-	
(股指期货投资)	127,415,220.00	-	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	-	
合计	127,415,220.00	-	-	-	-	
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				备注	
	合同/名义金额	公允价值		资产		
		负债				
利率衍生工具	-	-	-	-	-	
(国债期货投资)	-	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	-	
(外汇期货投资)	-	-	-	-	-	
权益衍生工具	68,375,360.00	-	-	-	-	
(权证投资)	-	-	-	-	-	
(股指期货投资)	68,375,360.00	-	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	-	

合计	68,375,360.00	-	-	-
----	---------------	---	---	---

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2501	IC2501	28	32,029,760.00	-815,320.00
IF2501	IF2501	80	94,531,200.00	-38,940.00
合计				-854,260.00
减：可抵销期货暂收款				-854,260.00
净额				-

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

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-2,756.16	-
银行间市场	-	-
合计	-2,756.16	-
项目	上年度末	
	2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-6,390.42	-
银行间市场	-	-
合计	-6,390.42	-

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	—	—
其他应收款	—	136,954.82
待摊费用	—	—
合计	—	136,954.82

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	—	—
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	377,630.35	487,135.72
其中：交易所市场	377,630.35	487,135.72
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
应付审计费	80,000.00	70,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	475,936.17	576,498.91
应付账户维护费	—	—
应付汇划费	—	—
应付上市费	—	—
应付持有人大会费-公证费	—	—
应付持有人大会费-律师费	—	—
应付或有管理费	—	—
其他	—	—
合计	1,053,566.52	1,253,634.63

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	8,166,937,198.00	8,166,937,198.00
本期申购	3,519,750,000.00	3,519,750,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-5,538,500,000.00	-5,538,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	6,148,187,198.00	6,148,187,198.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,625,491,389.27	-2,601,312,251.97	-975,820,862.70
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	1,625,491,389.27	-2,601,312,251.97	-975,820,862.70
本期利润	-11,192,996.60	888,446,394.24	877,253,397.64
本期基金份额交易产生的变动数	-367,193,521.01	548,685,587.00	181,492,065.99
其中：基金申购款	670,540,624.87	-898,244,316.02	-227,703,691.15
基金赎回款	-1,037,734,145.88	1,446,929,903.02	409,195,757.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,247,104,871.66	-1,164,180,270.73	82,924,600.93

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	256,988.23	215,299.15
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	619,738.11	299,012.58
其他	27,371.19	16,082.97
合计	904,097.53	530,394.70

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-201,851,438.37	-212,133,729.22
股票投资收益——赎回差价收入	2,155,071.67	-81,587,261.74
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	-199,696,366.70	-293,720,990.96

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 2024年01月01日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
卖出股票成交总额	2,971,467,515.37	2,684,617,432.83
减：卖出股票成本总额	3,169,897,456.63	2,891,310,703.18
减：交易费用	3,421,497.11	5,440,458.87
买卖股票差价收入	-201,851,438.37	-212,133,729.22

7.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
赎回基金份额对价总额	5,129,304,242.86	2,020,235,094.96
减：现金支付赎回款总额	2,064,215,898.86	842,551,980.96
减：赎回股票成本总额	3,062,933,272.33	1,259,270,375.74

减: 交易费用	-	-
赎回差价收入	2,155,071.67	-81,587,261.74

7.4.7.11.4 股票投资收益——证券出借差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益— —利息收入	85.74	173.99
债券投资收益— —买卖债券(债转 股及债券到期兑 付)差价收入	98,440.89	181,407.25
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	98,526.63	181,581.24

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 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	778,464.31	1,100,526.74
减: 卖出债券(债转股及债 券到期兑付)成本总额	679,900.00	918,900.00
减: 应计利息总额	92.27	175.44
减: 交易费用	31.15	44.05
买卖债券差价收入	98,440.89	181,407.25

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	20,690,978.62	-12,402,435.17
外汇远期投资收益	-	-
国债期货投资收益	-	-
外汇期货投资收益	-	-

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	175,665,116.10	57,053,947.25
其中：证券出借权益补偿收入	1,101,430.41	1,073,787.77
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	175,665,116.10	57,053,947.25

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	889,975,474.24	-447,373,372.48
——股票投资	889,975,474.24	-447,373,372.48
——债券投资	-	-

——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
——贵金属投资	—	—
——其他	—	—
2. 衍生工具	−1,529,080.00	1,707,720.00
——权证投资	—	—
——期货投资	−1,529,080.00	1,707,720.00
3. 其他	—	—
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—	—
合计	888,446,394.24	−445,665,652.48

7.4.7.19 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	—	—
替代损益	4,592,343.92	3,802,756.43
其他	—	—
合计	4,592,343.92	3,802,756.43

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
账户维护费	—	—
银行费用	—	—
指数使用费	1,954,360.98	1,185,072.95
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	1,165.90	583.30
合计	2,155,526.88	1,375,656.25

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富投资管理有限公司	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
汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《基金管理公司子公司管理规定》等法律法规的有关规定，经中国证券监督管理委员会同意，汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）已受让汇添富资本管理有限公司持有的汇添富投资管理有限公司（以下简称“汇添富投资”）全部股权。汇添富投资已由本公司的“全资子公司的全资子公司”变

更为“全资子公司”。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	406,004,745.99	7.56	2,006,059,466.38	27.30

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	866,020.78	78.69

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
东方证券	53,000,000.00	27.04	-	-

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	71,428.45	4.49	67,507.33	17.88
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	1,474,877.63	43.43	-	-

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。截至 2024 年 6 月 30 日止，该类佣金协议的服务范围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等。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,771,805.01	5,925,364.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	278,536.19	6,879.98
应支付基金管理人的净管理费	9,493,268.82	5,918,484.67

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,257,268.41	1,975,121.57

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

单位：人民币元

本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日						
关联	交易金额	费率区间 (%)	加权 平均	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收 利息余额

方 名 称			费率 (%)			
东方证券	6,773,697.00	0.81~3.42	1.91	5,245.06	-	-
上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日						
关联 方 名 称	交易金额	费率区间 (%)	加权 平均 费率 (%)	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收 利息余额
东方证券	57,634,573.00	1.00~3.50	1.97	46,312.46	2,951,202.00	1,404.15

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名 称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金 份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 (%)	持有的基金 份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 (%)
东方证券 股份有限 公司	4,190,103.00	0.07	15,420,310.00	0.19
汇添富中 证 800 交 易型开放 式指数证 券投资基 金联接基 金	82,195,700.00	1.34	84,814,400.00	1.04

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

的规定。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	32,338,603.37	256,988.23	31,664,606.54	215,299.15

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 1,165,244.00 股，占本基金净值比例为 0.20%。持有基金托管人平安银行发行的股票 2,163,267.00 股，占本基金净值比例为 0.41%。（于上年度末，本基金持有基金管理人的股东东方证券发行的股票 1,571,544.00 股，占本基金净值比例为 0.19%。持有基金托管人平安银行发行的股票 2,907,867.00 股，占本基金净值比例为 0.38%。）

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。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（2024 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

金额单位：人民币元

股票 代码	股 票 名 称	停 牌 日 期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 (股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
00225 2	上 海	202 4 年	重 大	7.2 2	202 5 年	6.9 3	1,020,50 0	7,418,081.0 4	7,368,010.0 0	

莱士	12 月 23 日	事项停牌	01 月 07 日						
400174	中天 3	2023 年 08 月 30 日	重大事项停牌	0.01	-	371,600	952,476.03	3,716.00	

注：截止 2024 年 12 月 31 日，本基金合计持有中天 3（在深圳证券交易所退市时的股票简称为*ST 中天，证券代码为 000540）371,600 股。根据中天金融集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 6 月 29 日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市暨摘牌的公告》，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。

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

根据公司于 2023 年 8 月 28 日发布的《中天金融集团股份有限公司股票转让公告》，公司可在全国中小企业股份转让系统有限责任公司依托原证券公司代办股份转让系统设立并代为管理的两网公司及退市公司板块（以下简称“退市板块”）转让仅限于原在深圳证券交易所（以下简称“深交所”）挂牌交易的流通股份，确权代码（即挂牌退市板块后的股票代码）：400174，开始转让日为 2023 年 8 月 30 日。根据公司于同日发布的《中天金融集团股份有限公司关于公司股票挂牌当日即暂停转让的公告》，因公司正在进行重整事项，经向全国股转公司申请，公司股票自 2023 年 8 月 30 日起暂停转让。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 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 2024 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 2024 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管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》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 2024年 12月 31	1 个月以内	1 — 3 个月	3 个月-1 年	1 — 5 年 以上	5 年 以上	不计息	合计

目							
资产							
货币资金	32,338,603.37	-	-	-	-	-	32,338,603.37
结算备付金	54,036,579.69	-	-	-	-	-	54,036,579.69
存出保证金	1,140,034.98	-	-	-	-	15,187,315.20	16,327,350.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	6,093,957,932.04	6,093,957,932.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-2,756.16	-	-	-	-	-	-2,756.16
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收	-	-	-	-	-	40,413,750.91	40,413,750.91

清算款							
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	87,512,461.8 8	-	-	-	-	6,149,558,998.1 5	6,237,071,460.0 3
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	-	-	-	-	-	3,843,547.52	3,843,547.52
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	796,910.28	796,910.28
应付托管费	-	-	-	-	-	265,636.78	265,636.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	1,053,566.52	1,053,566.52
负债总计	-	-	-	-	-	5,959,661.10	5,959,661.10
利率敏感度缺口	87,512,461.88	-	-	-	-	6,143,599,337.05	6,231,111,798.93
上年度末 2023年 12月 31日	1 个月以内	1 - 3 个 月	3 个月-1 年	1 - 5 年 以 上	5	不计息	合计
资							

产							
货币资金	31,664,606.54	-	-	-	-	-	31,664,606.54
结算备付金	20,496,024.86	-	-	-	-	-	20,496,024.86
存出保证金	2,932,451.90	-	-	-	8,286,021.60	11,218,473.50	
交易性金融资产		-	123,903.80	-	7,092,532,901.40	7,092,656,805.20	
衍生金融资产		-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-6,390.42	-	-	-	-	-	-6,390.42
债权投资		-	-	-	-	-	-
应收清算		-	-	-	57,357,928.62	57,357,928.62	

款							
应收股利	-	-	-	-	-	19,940.00	19,940.00
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	136,954.82	136,954.82
资产总计	55,086,692.88	-	123,903.80	-	-	7,158,333,746.44	7,213,544,343.12
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	19,898,301.48	19,898,301.48
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	946,482.10	946,482.10
应付托管费	-	-	-	-	-	315,494.03	315,494.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问	-	-	-	-	-	-	-

费							
应交税费	-	-	-	-	-	14,095.58	14,095.58
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,253,634.63	1,253,634.63
负债总计	-	-	-	-	-	22,428,007.82	22,428,007.82
利率敏感度缺口	55,086,692.8 8	-	123,903.8 0	-	-	7,135,905,738.6 2	7,191,116,335.3 0

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	6,093,957,932.04	97.80	7,092,532,901.40	98.63
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	123,903.80	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	6,093,957,932.04	97.80	7,092,656,805.20	98.63

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。		
	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
分析	相关风险变量的变动	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
		中证 800 指数上涨 5%	309,655,005.34
	中证 800 指数下跌 5%	-309,655,005.34	-357,728,458.96

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		上年度末	
	2024 年 12 月 31 日		2023 年 12 月 31 日	
第一层次	6,086,586,206.04		7,092,529,185.40	
第二层次	7,368,010.00		123,903.80	
第三层次	3,716.00		3,716.00	
合计	6,093,957,932.04		7,092,656,805.20	

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间重大变动

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		合计	
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	交易性金融资产			
	债券投资	股票投资		

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

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估 值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权 平均值	与公允价 值之间的 关系
股权	3,716.00	上市公司 比较法	折现率	0.2	负相关
项目	上年度末公允价 值	采用的估 值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权 平均值	与公允价 值之间的 关系
股权	3,716.00	上市公司 比较法	折现率	0.2	负相关

7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,093,957,932.04	97.71

	其中：股票	6,093,957,932.04	97.71
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	-2,756.16	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	86,375,183.06	1.38
8	其他各项资产	56,741,101.09	0.91
9	合计	6,237,071,460.03	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	51,926,058.92	0.83
B	采矿业	274,946,706.02	4.41
C	制造业	3,327,754,462.87	53.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	233,031,052.82	3.74
E	建筑业	110,511,060.05	1.77
F	批发和零售业	49,196,815.76	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	185,140,859.32	2.97
H	住宿和餐饮业	4,905,735.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	343,974,811.82	5.52
J	金融业	1,290,873,456.96	20.72
K	房地产业	59,260,806.14	0.95
L	租赁和商务服务业	52,118,753.42	0.84
M	科学研究和技术服务业	52,560,983.24	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	7,580,307.25	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,713,140.00	0.06
Q	卫生和社会工作	22,902,207.65	0.37
R	文化、体育和娱乐业	19,768,074.80	0.32
S	综合	3,788,924.00	0.06
	合计	6,093,954,216.04	97.80

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	3,716.00	0.00
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	3,716.00	0.00

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	139,915	213,230,460.00	3.42
2	300750	宁德时代	588,640	156,578,240.00	2.51
3	601318	中国平安	2,397,356	126,220,793.40	2.03

		安			
4	600036	招商银行	2,758,200	108,397,260.00	1.74
5	000333	美的集团	1,089,461	81,949,256.42	1.32
6	600900	长江电力	2,725,840	80,548,572.00	1.29
7	300059	东方财富	2,813,828	72,653,038.96	1.17
8	600030	中信证券	2,173,950	63,414,121.50	1.02
9	601166	兴业银行	3,240,000	62,078,400.00	1.00
10	000858	五粮液	432,229	60,529,349.16	0.97
11	002594	比亚迪	201,840	57,052,094.40	0.92
12	601899	紫金矿业	3,668,100	55,461,672.00	0.89
13	601398	工商银行	7,803,100	53,997,452.00	0.87
14	002475	立讯精密	1,127,384	45,952,171.84	0.74
15	600276	恒瑞医药	994,942	45,667,837.80	0.73
16	000651	格力电器	998,440	45,379,098.00	0.73
17	600887	伊利股份	1,417,700	42,786,186.00	0.69
18	688981	中芯国际	442,609	41,879,663.58	0.67
19	601328	交通银行	5,244,200	40,747,434.00	0.65
20	601816	京沪高铁	6,565,600	40,444,096.00	0.65
21	601288	农业银行	7,117,200	38,005,848.00	0.61
22	000725	京东方A	8,233,800	36,146,382.00	0.58
23	300760	迈瑞医疗	135,000	34,425,000.00	0.55
24	600919	江苏银行	3,271,950	32,130,549.00	0.52
25	601088	中国神	734,140	31,920,407.20	0.51

		华			
26	688041	海光信息	207,147	31,028,549.13	0.50
27	603259	药明康德	557,181	30,667,242.24	0.49
28	688256	寒武纪科技	46,474	30,579,892.00	0.49
29	600309	万华化学	420,000	29,967,000.00	0.48
30	000063	中兴通讯	718,250	29,017,300.00	0.47
31	300124	汇川技术	479,450	28,086,181.00	0.45
32	002371	北方华创	71,208	27,842,328.00	0.45
33	601668	中国建筑	4,631,600	27,789,600.00	0.45
34	600000	浦发银行	2,614,638	26,904,625.02	0.43
35	601601	中国太保	763,300	26,013,264.00	0.42
36	601988	中国银行	4,692,800	25,857,328.00	0.41
37	000001	平安银行	2,163,267	25,310,223.90	0.41
38	002415	海康威视	822,400	25,247,680.00	0.41
39	601728	中国电信	3,455,711	24,950,233.42	0.40
40	300308	中际旭创	200,000	24,702,000.00	0.40
41	600837	海通证券	2,152,000	23,930,240.00	0.38
42	300274	阳光电源	323,380	23,875,145.40	0.38
43	600690	海尔智家	836,500	23,815,155.00	0.38
44	600941	中国移动	201,100	23,761,976.00	0.38
45	603019	中科曙光	326,220	23,592,230.40	0.38
46	002714	牧原股份	608,658	23,396,813.52	0.38

47	600016	民生银行	5, 526, 200	22, 823, 206. 00	0. 37
48	601766	中国中车	2, 710, 900	22, 717, 342. 00	0. 36
49	601857	中国石油	2, 523, 500	22, 560, 090. 00	0. 36
50	600406	国电南瑞	893, 474	22, 533, 414. 28	0. 36
51	601127	赛力斯	168, 100	22, 422, 859. 00	0. 36
52	600660	福耀玻璃	357, 210	22, 289, 904. 00	0. 36
53	601919	中远海控	1, 421, 460	22, 032, 630. 00	0. 35
54	601985	中国核电	2, 104, 300	21, 947, 849. 00	0. 35
55	600031	三一重工	1, 319, 800	21, 750, 304. 00	0. 35
56	600028	中国石化	3, 247, 000	21, 689, 960. 00	0. 35
57	002352	顺丰控股	537, 144	21, 646, 903. 20	0. 35
58	600104	上汽集团	1, 032, 800	21, 440, 928. 00	0. 34
59	601012	隆基绿能	1, 352, 332	21, 245, 135. 72	0. 34
60	000100	TCL 科技	4, 183, 490	21, 042, 954. 70	0. 34
61	000568	泸州老窖	163, 702	20, 495, 490. 40	0. 33
62	601229	上海银行	2, 216, 800	20, 283, 720. 00	0. 33
63	601169	北京银行	3, 293, 500	20, 255, 025. 00	0. 33
64	601225	陕西煤业	864, 900	20, 117, 574. 00	0. 32
65	601688	华泰证券	1, 138, 900	20, 033, 251. 00	0. 32
66	600809	山西汾酒	108, 660	20, 016, 258. 60	0. 32
67	002230	科大讯飞	411, 900	19, 903, 008. 00	0. 32
68	603501	韦尔股份	189, 242	19, 758, 757. 22	0. 32

69	300498	温氏股份	1,183,140	19,533,641.40	0.31
70	601138	工业富联	886,300	19,055,450.00	0.31
71	600050	中国联通	3,541,500	18,805,365.00	0.30
72	601211	国泰君安	1,003,800	18,720,870.00	0.30
73	688012	中微半导体设备	96,757	18,302,554.12	0.29
74	300502	新易盛	158,000	18,261,640.00	0.29
75	600150	中国船舶	497,568	17,892,545.28	0.29
76	002142	宁波银行	734,970	17,867,120.70	0.29
77	688008	澜起科技	254,590	17,286,661.00	0.28
78	603288	海天味业	372,155	17,081,914.50	0.27
79	000338	潍柴动力	1,209,400	16,568,780.00	0.27
80	002625	光启技术	336,000	16,060,800.00	0.26
81	601818	光大银行	4,127,600	15,973,812.00	0.26
82	002027	分众传媒	2,248,200	15,804,846.00	0.25
83	603986	兆易创新	147,968	15,802,982.40	0.25
84	600999	招商证券	824,510	15,797,611.60	0.25
85	601628	中国人寿	370,513	15,531,904.96	0.25
86	000625	长安汽车	1,107,466	14,795,745.76	0.24
87	688111	金山办公	51,310	14,694,670.90	0.24
88	601390	中国中铁	2,291,000	14,639,490.00	0.23
89	000425	徐工机械	1,843,700	14,620,541.00	0.23
90	600418	江淮汽车	388,400	14,565,000.00	0.23

91	601888	中国中免	217,142	14,550,685.42	0.23
92	600436	片仔癀	67,300	14,435,850.00	0.23
93	600089	特变电工	1,124,451	14,325,505.74	0.23
94	000938	紫光股份	509,660	14,183,837.80	0.23
95	600048	保利发展	1,596,800	14,147,648.00	0.23
96	601658	邮储银行	2,472,578	14,044,243.04	0.23
97	002241	歌尔股份	542,500	14,001,925.00	0.22
98	600905	三峡能源	3,191,671	13,947,602.27	0.22
99	000792	盐湖股份	847,100	13,943,266.00	0.22
100	601006	大秦铁路	2,035,404	13,800,039.12	0.22
101	300015	爱尔眼科	1,040,449	13,785,949.25	0.22
102	600938	中国海油	465,900	13,748,709.00	0.22
103	300033	同花顺	47,800	13,742,500.00	0.22
104	600019	宝钢股份	1,954,200	13,679,400.00	0.22
105	600438	通威股份	601,600	13,301,376.00	0.21
106	601939	建设银行	1,499,700	13,182,363.00	0.21
107	600584	长电科技	318,500	13,013,910.00	0.21
108	601600	中国铝业	1,762,000	12,950,700.00	0.21
109	300014	亿纬锂能	273,583	12,787,269.42	0.21
110	601009	南京银行	1,195,900	12,736,335.00	0.20
111	600585	海螺水泥	533,300	12,681,874.00	0.20
112	600760	中航沈飞	245,180	12,435,529.60	0.20
113	600958	东方证	1,165,244	12,304,976.64	0.20

		券			
114	600893	航发动力	296,595	12,293,862.75	0.20
115	601989	中国重工	2,542,000	12,227,020.00	0.20
116	600111	北方稀土	563,700	11,961,714.00	0.19
117	000538	云南白药	198,760	11,915,662.00	0.19
118	000977	浪潮信息	229,400	11,901,272.00	0.19
119	002463	沪电股份	298,500	11,835,525.00	0.19
120	002050	三花智控	499,880	11,752,178.80	0.19
121	600926	杭州银行	801,860	11,715,174.60	0.19
122	688271	联影医疗	91,469	11,561,681.60	0.19
123	605499	东鹏饮料	46,400	11,531,328.00	0.19
124	300408	三环集团	299,200	11,522,192.00	0.18
125	600015	华夏银行	1,416,700	11,347,767.00	0.18
126	002304	洋河股份	134,300	11,218,079.00	0.18
127	002179	中航光电	283,150	11,127,795.00	0.18
128	600886	国投电力	665,400	11,058,948.00	0.18
129	000002	万科A	1,517,300	11,015,598.00	0.18
130	000166	申万宏源	2,002,800	10,714,980.00	0.17
131	000776	广发证券	659,100	10,684,011.00	0.17
132	603993	洛阳钼业	1,576,700	10,485,055.00	0.17
133	601669	中国电建	1,916,600	10,464,636.00	0.17
134	002028	思源电气	138,000	10,032,600.00	0.16

135	601916	浙商银行	3,352,000	9,754,320.00	0.16
136	002049	紫光国微	151,480	9,750,767.60	0.16
137	300433	蓝思科技	443,600	9,714,840.00	0.16
138	688036	传音控股	102,260	9,714,700.00	0.16
139	000988	华工科技	224,300	9,712,190.00	0.16
140	601377	兴业证券	1,540,012	9,640,475.12	0.15
141	600570	恒生电子	338,610	9,477,693.90	0.15
142	600009	上海机场	276,400	9,439,060.00	0.15
143	601186	中国铁建	1,026,500	9,413,005.00	0.15
144	600010	包钢股份	5,046,800	9,387,048.00	0.15
145	601336	新华保险	185,365	9,212,640.50	0.15
146	601901	方正证券	1,101,800	9,177,994.00	0.15
147	600547	山东黄金	402,500	9,108,575.00	0.15
148	002311	海大集团	185,200	9,084,060.00	0.15
149	600795	国电电力	1,983,200	9,083,056.00	0.15
150	601838	成都银行	530,584	9,078,292.24	0.15
151	300339	润和软件	177,100	8,860,313.00	0.14
152	002384	东山精密	302,900	8,844,680.00	0.14
153	002460	赣锋锂业	251,980	8,821,819.80	0.14
154	603799	华友钴业	301,370	8,818,086.20	0.14
155	601995	中金公司	259,900	8,756,031.00	0.14
156	000768	中航西飞	308,600	8,714,864.00	0.14

157	002422	科伦药业	284, 300	8, 509, 099. 00	0. 14
158	600157	永泰能源	4, 963, 700	8, 487, 927. 00	0. 14
159	001979	招商蛇口	810, 000	8, 294, 400. 00	0. 13
160	600989	宝丰能源	492, 200	8, 288, 648. 00	0. 13
161	601800	中国交建	790, 800	8, 263, 860. 00	0. 13
162	600415	小商品城	609, 800	8, 177, 418. 00	0. 13
163	601360	三六零	778, 000	8, 052, 300. 00	0. 13
164	300442	润泽科技	153, 800	7, 991, 448. 00	0. 13
165	000157	中联重科	1, 104, 900	7, 988, 427. 00	0. 13
166	600839	四川长虹	822, 300	7, 935, 195. 00	0. 13
167	601788	光大证券	434, 800	7, 874, 228. 00	0. 13
168	002797	第一创业	938, 200	7, 833, 970. 00	0. 13
169	600489	中金黄金	649, 500	7, 813, 485. 00	0. 13
170	600066	宇通客车	295, 859	7, 804, 760. 42	0. 13
171	600029	南方航空	1, 202, 400	7, 803, 576. 00	0. 13
172	600115	中国东航	1, 912, 300	7, 649, 200. 00	0. 12
173	002466	天齐锂业	231, 100	7, 626, 300. 00	0. 12
174	603369	今世缘	167, 657	7, 583, 126. 11	0. 12
175	002001	新和成	345, 088	7, 581, 583. 36	0. 12
176	600487	亨通光电	438, 600	7, 552, 692. 00	0. 12
177	600745	闻泰科技	194, 200	7, 531, 076. 00	0. 12
178	600674	川投能源	435, 119	7, 505, 802. 75	0. 12
179	601878	浙商证	612, 000	7, 490, 880. 00	0. 12

		券			
180	002340	格林美	1,144,100	7,470,973.00	0.12
181	300782	卓胜微	83,220	7,464,834.00	0.12
182	301236	软通动力	127,100	7,462,041.00	0.12
183	601066	中信建投	288,300	7,423,725.00	0.12
184	601689	拓普集团	150,740	7,386,260.00	0.12
185	300418	昆仑万维	191,500	7,368,920.00	0.12
186	002252	上海莱士	1,020,500	7,368,010.00	0.12
187	601881	中国银河	483,000	7,356,090.00	0.12
188	300207	欣旺达	328,300	7,324,373.00	0.12
189	601633	长城汽车	277,862	7,316,106.46	0.12
190	003816	中国广核	1,749,500	7,225,435.00	0.12
191	002736	国信证券	644,900	7,222,880.00	0.12
192	600160	巨化股份	299,400	7,221,528.00	0.12
193	600346	恒力石化	469,700	7,209,895.00	0.12
194	688169	石头科技	32,831	7,199,509.99	0.12
195	600426	华鲁恒升	331,860	7,171,494.60	0.12
196	000661	长春高新	71,847	7,144,465.68	0.11
197	002648	卫星化学	374,340	7,033,848.60	0.11
198	688777	中控技术	141,401	7,023,387.67	0.11
199	300122	智飞生物	266,600	7,011,580.00	0.11
200	002236	大华股份	437,600	7,001,600.00	0.11
201	600196	复星医药	281,700	7,000,245.00	0.11
202	002156	通富微	235,700	6,964,935.00	0.11

		电			
203	601162	天风证券	1,547,760	6,933,964.80	0.11
204	002273	水晶光电	310,600	6,901,532.00	0.11
205	688126	上海硅产业集团	366,637	6,900,108.34	0.11
206	601555	东吴证券	883,902	6,894,435.60	0.11
207	000786	北新建材	226,600	6,868,246.00	0.11
208	002966	苏州银行	842,170	6,829,998.70	0.11
209	002920	德赛西威	61,900	6,815,809.00	0.11
210	300394	天孚通信	74,260	6,784,393.60	0.11
211	000963	华东医药	196,000	6,781,600.00	0.11
212	600460	士兰微	259,700	6,757,394.00	0.11
213	601117	中国化学	814,800	6,754,692.00	0.11
214	600011	华能国际	983,700	6,659,649.00	0.11
215	002185	华天科技	572,300	6,644,403.00	0.11
216	601868	中国能建	2,900,265	6,641,606.85	0.11
217	600372	中航机载	537,637	6,629,064.21	0.11
218	601111	中国国航	832,200	6,582,702.00	0.11
219	002601	龙佰集团	371,600	6,566,172.00	0.11
220	600183	生益科技	271,020	6,518,031.00	0.10
221	601099	太平洋	1,518,500	6,468,810.00	0.10
222	600600	青岛啤酒	79,425	6,427,071.00	0.10
223	601933	永辉超市	1,007,400	6,386,916.00	0.10
224	002129	TCL 中	719,650	6,383,295.50	0.10

		环			
225	600096	云天化	285, 200	6, 359, 960. 00	0. 10
226	001965	招商公路	455, 500	6, 354, 225. 00	0. 10
227	688223	晶科能源	892, 689	6, 347, 018. 79	0. 10
228	002202	金风科技	613, 700	6, 339, 521. 00	0. 10
229	300347	泰格医药	115, 500	6, 308, 610. 00	0. 10
230	601100	恒立液压	119, 248	6, 292, 716. 96	0. 10
231	601021	春秋航空	109, 100	6, 291, 797. 00	0. 10
232	000066	中国长城	431, 200	6, 282, 584. 00	0. 10
233	000596	古井贡酒	36, 200	6, 273, 460. 00	0. 10
234	000423	东阿阿胶	100, 000	6, 272, 000. 00	0. 10
235	000807	云铝股份	463, 100	6, 265, 743. 00	0. 10
236	002180	纳思达	221, 500	6, 239, 655. 00	0. 10
237	300832	新产业	87, 900	6, 227, 715. 00	0. 10
238	600085	同仁堂	153, 100	6, 214, 329. 00	0. 10
239	600536	中国软件	132, 925	6, 206, 268. 25	0. 10
240	600741	华域汽车	352, 400	6, 205, 764. 00	0. 10
241	600482	中国动力	251, 600	6, 156, 652. 00	0. 10
242	300896	爱美客	33, 700	6, 150, 250. 00	0. 10
243	002493	荣盛石化	677, 150	6, 128, 207. 50	0. 10
244	002459	晶澳科技	444, 236	6, 108, 245. 00	0. 10
245	601998	中信银行	873, 300	6, 095, 634. 00	0. 10
246	600176	中国巨石	534, 023	6, 082, 521. 97	0. 10
247	600219	南山铝业	1, 548, 500	6, 054, 635. 00	0. 10
248	300661	圣邦股	73, 895	6, 043, 133. 10	0. 10

		份			
249	000895	双汇发展	232,002	6,022,771.92	0.10
250	603392	万泰生物	84,878	5,980,503.88	0.10
251	601168	西部矿业	371,000	5,961,970.00	0.10
252	600352	浙江龙盛	579,300	5,960,997.00	0.10
253	600079	人福医药	254,900	5,959,562.00	0.10
254	300759	康龙化成	231,500	5,949,550.00	0.10
255	600885	宏发股份	185,834	5,913,237.88	0.09
256	601108	财通证券	721,680	5,896,125.60	0.09
257	002709	天赐材料	298,160	5,879,715.20	0.09
258	301269	华大九天	48,300	5,849,130.00	0.09
259	600988	赤峰黄金	372,000	5,806,920.00	0.09
260	600515	海南机场	1,524,233	5,761,600.74	0.09
261	300017	网宿科技	541,300	5,721,541.00	0.09
262	002916	深南电路	45,500	5,687,500.00	0.09
263	300476	胜宏科技	135,000	5,682,150.00	0.09
264	002738	中矿资源	160,040	5,681,420.00	0.09
265	000975	山金国际	369,200	5,674,604.00	0.09
266	002138	顺络电子	179,700	5,656,956.00	0.09
267	002938	鹏鼎控股	155,000	5,654,400.00	0.09
268	600845	宝信软件	192,773	5,640,537.98	0.09
269	600188	兖矿能源	397,946	5,638,894.82	0.09

270	002271	东方雨虹	434,000	5,633,320.00	0.09
271	601877	正泰电器	238,451	5,582,137.91	0.09
272	002078	太阳纸业	374,700	5,571,789.00	0.09
273	688396	华润微电子	117,896	5,563,512.24	0.09
274	601577	长沙银行	624,600	5,552,694.00	0.09
275	002281	光迅科技	106,100	5,535,237.00	0.09
276	000630	铜陵有色	1,701,000	5,494,230.00	0.09
277	300474	景嘉微	58,600	5,478,514.00	0.09
278	300136	信维通信	215,300	5,477,232.00	0.09
279	600233	圆通速递	381,700	5,416,323.00	0.09
280	601319	中国人保	709,878	5,409,270.36	0.09
281	600161	天坛生物	263,646	5,404,743.00	0.09
282	002555	三七互娱	345,200	5,398,928.00	0.09
283	002085	万丰奥威	282,900	5,360,955.00	0.09
284	689009	九号公司	112,528	5,345,080.00	0.09
285	600879	航天电子	587,400	5,263,104.00	0.08
286	002517	恺英网络	385,700	5,249,377.00	0.08
287	601618	中国中冶	1,587,400	5,238,420.00	0.08
288	601607	上海医药	249,200	5,233,200.00	0.08
289	300058	蓝色光标	563,900	5,232,992.00	0.08
290	300803	指南针	54,400	5,219,680.00	0.08
291	000983	山西焦煤	631,200	5,201,088.00	0.08
292	002444	巨星科	160,100	5,179,235.00	0.08

		技			
293	300223	北京君正	75,300	5,135,460.00	0.08
294	688120	华海清科	31,503	5,134,673.97	0.08
295	603893	瑞芯微	46,500	5,117,790.00	0.08
296	601615	明阳智能	405,300	5,110,833.00	0.08
297	688099	晶晨半导体	74,357	5,106,838.76	0.08
298	002074	国轩高科	240,200	5,097,044.00	0.08
299	600023	浙能电力	900,100	5,094,566.00	0.08
300	002353	杰瑞股份	137,700	5,093,523.00	0.08
301	601128	常熟银行	671,850	5,085,904.50	0.08
302	300002	神州泰岳	437,700	5,072,943.00	0.08
303	000783	长江证券	740,900	5,052,938.00	0.08
304	000999	华润三九	113,810	5,046,335.40	0.08
305	600109	国金证券	576,500	5,032,845.00	0.08
306	300024	机器人	279,600	5,018,820.00	0.08
307	002195	岩山科技	1,260,000	5,002,200.00	0.08
308	603160	汇顶科技	61,600	4,961,264.00	0.08
309	601898	中煤能源	406,500	4,951,170.00	0.08
310	002532	天山铝业	624,900	4,917,963.00	0.08
311	300496	中科创达	82,500	4,913,700.00	0.08
312	600588	用友网络	457,807	4,912,269.11	0.08
313	300450	先导智能	245,000	4,904,900.00	0.08
314	600298	安琪酵母	135,900	4,899,195.00	0.08

315	002223	鱼跃医疗	133,800	4,882,362.00	0.08
316	002673	西部证券	596,704	4,863,137.60	0.08
317	605117	德业股份	57,344	4,862,771.20	0.08
318	002465	海格通信	442,800	4,861,944.00	0.08
319	002128	电投能源	248,200	4,859,756.00	0.08
320	000408	藏格矿业	175,200	4,858,296.00	0.08
321	688469	芯联集成	945,300	4,849,389.00	0.08
322	000728	国元证券	580,030	4,849,050.80	0.08
323	000301	东方盛虹	589,000	4,835,690.00	0.08
324	688213	思特威电子科技	62,197	4,833,950.84	0.08
325	603296	华勤技术	67,900	4,817,505.00	0.08
326	601567	三星医疗	156,500	4,813,940.00	0.08
327	603606	东方电缆	91,500	4,808,325.00	0.08
328	688072	拓荆科技	31,053	4,771,914.51	0.08
329	600765	中航重机	232,560	4,760,503.20	0.08
330	600362	江西铜业	230,300	4,753,392.00	0.08
331	601198	东兴证券	430,700	4,742,007.00	0.08
332	300114	中航电测	65,600	4,708,768.00	0.08
333	688047	龙芯中科	35,551	4,702,686.28	0.08
334	688599	天合光能	243,334	4,696,346.20	0.08
335	600862	中航高科	185,200	4,678,152.00	0.08
336	002008	大族激光	187,000	4,675,000.00	0.08

		光			
337	300316	晶盛机电	145,900	4,654,210.00	0.07
338	300383	光环新网	318,900	4,652,751.00	0.07
339	300012	华测检测	374,200	4,651,306.00	0.07
340	601872	招商轮船	722,460	4,630,968.60	0.07
341	300866	安克创新	47,416	4,629,698.24	0.07
342	002472	双环传动	151,100	4,626,682.00	0.07
343	000831	中国稀土	164,700	4,619,835.00	0.07
344	600895	张江高科	172,323	4,618,256.40	0.07
345	301358	湖南裕能	101,700	4,609,044.00	0.07
346	600177	雅戈尔	515,000	4,583,500.00	0.07
347	601238	广汽集团	490,600	4,582,204.00	0.07
348	000876	新希望	504,400	4,529,512.00	0.07
349	300413	芒果超媒	167,600	4,506,764.00	0.07
350	600803	新奥股份	207,800	4,505,104.00	0.07
351	603605	珀莱雅	52,800	4,472,160.00	0.07
352	300699	光威复材	128,780	4,462,227.00	0.07
353	002595	豪迈科技	88,900	4,461,891.00	0.07
354	600332	白云山	156,000	4,433,520.00	0.07
355	600873	梅花生物	441,700	4,430,251.00	0.07
356	601233	桐昆股份	375,300	4,428,540.00	0.07
357	603260	合盛硅业	79,000	4,389,240.00	0.07
358	000400	许继电气	159,200	4,382,776.00	0.07
359	300037	新宙邦	116,800	4,372,992.00	0.07

360	300395	菲利华	116,200	4,370,282.00	0.07
361	300054	鼎龙股份	167,400	4,355,748.00	0.07
362	688122	西部超导	101,287	4,337,109.34	0.07
363	300628	亿联网络	112,100	4,327,060.00	0.07
364	300999	金龙鱼	132,500	4,320,825.00	0.07
365	300604	长川科技	97,900	4,320,327.00	0.07
366	300142	沃森生物	357,600	4,319,808.00	0.07
367	600061	国投资本	568,696	4,276,593.92	0.07
368	601990	南京证券	492,000	4,260,720.00	0.07
369	600039	四川路桥	583,840	4,250,355.20	0.07
370	000750	国海证券	990,290	4,238,441.20	0.07
371	600027	华电国际	753,800	4,228,818.00	0.07
372	603596	伯特利	94,600	4,218,214.00	0.07
373	688249	晶合集成	180,435	4,211,352.90	0.07
374	000009	中国宝安	458,500	4,195,275.00	0.07
375	688525	佰维存储	67,100	4,158,187.00	0.07
376	002436	兴森科技	374,200	4,157,362.00	0.07
377	002812	恩捷股份	129,700	4,149,103.00	0.07
378	601696	中银证券	370,700	4,137,012.00	0.07
379	600369	西南证券	885,800	4,136,686.00	0.07
380	600153	建发股份	393,000	4,134,360.00	0.07
381	002007	华兰生物	245,020	4,128,587.00	0.07
382	600642	申能股份	434,700	4,125,303.00	0.07

383	688472	阿特斯 阳光电力	328,100	4,120,936.00	0.07
384	002850	科达利	42,100	4,112,328.00	0.07
385	002261	拓维信息	223,300	4,088,623.00	0.07
386	600549	厦门钨业	212,100	4,087,167.00	0.07
387	600143	金发科技	471,100	4,070,304.00	0.07
388	688521	芯原微电子	77,626	4,069,931.18	0.07
389	600918	中泰证券	616,900	4,053,033.00	0.07
390	600398	海澜之家	538,200	4,036,500.00	0.06
391	002821	凯莱英	52,996	4,032,465.64	0.06
392	000021	深科技	208,736	3,978,508.16	0.06
393	601216	君正集团	750,900	3,949,734.00	0.06
394	000738	航发控制	176,800	3,932,032.00	0.06
395	300724	捷佳伟创	61,900	3,912,699.00	0.06
396	600875	东方电气	245,600	3,902,584.00	0.06
397	601997	贵阳银行	650,138	3,900,828.00	0.06
398	000932	华菱钢铁	927,800	3,878,204.00	0.06
399	002558	巨人网络	303,800	3,855,222.00	0.06
400	000617	中油资本	559,400	3,854,266.00	0.06
401	002294	信立泰	124,600	3,853,878.00	0.06
402	600909	华安证券	632,570	3,833,374.20	0.06
403	601699	潞安环能	265,900	3,818,324.00	0.06
404	000878	云南铜业	312,400	3,808,156.00	0.06
405	603659	璞泰来	239,350	3,808,058.50	0.06
406	600529	山东药	147,600	3,803,652.00	0.06

		玻			
407	600018	上港集团	621,300	3,802,356.00	0.06
408	000729	燕京啤酒	315,500	3,798,620.00	0.06
409	600025	华能水电	399,100	3,795,441.00	0.06
410	600673	东阳光	335,600	3,788,924.00	0.06
411	300919	中伟股份	104,400	3,770,928.00	0.06
412	600497	驰宏锌锗	676,900	3,770,333.00	0.06
413	688361	中科飞测	42,800	3,747,140.00	0.06
414	688002	睿创微纳	79,635	3,743,641.35	0.06
415	600141	兴发集团	172,400	3,741,080.00	0.06
416	603345	安井食品	45,800	3,731,784.00	0.06
417	002409	雅克科技	64,200	3,720,390.00	0.06
418	002607	中公教育	1,092,100	3,713,140.00	0.06
419	600155	华创云信	498,600	3,689,640.00	0.06
420	000623	吉林敖东	213,200	3,681,964.00	0.06
421	000997	新大陆	184,100	3,672,795.00	0.06
422	000034	神州数码	104,000	3,645,200.00	0.06
423	300073	当升科技	90,200	3,633,256.00	0.06
424	603338	浙江鼎力	56,240	3,628,604.80	0.06
425	300001	特锐德	165,300	3,628,335.00	0.06
426	000733	振华科技	86,000	3,626,620.00	0.06
427	601456	国联证券	267,300	3,613,896.00	0.06
428	600026	中远海能	311,400	3,612,240.00	0.06

429	002064	华峰化学	441,400	3,610,652.00	0.06
430	002065	东华软件	495,900	3,600,234.00	0.06
431	600118	中国卫星	131,800	3,598,140.00	0.06
432	688009	中国通号	573,616	3,590,836.16	0.06
433	601665	齐鲁银行	641,500	3,585,985.00	0.06
434	002432	九安医疗	87,600	3,572,328.00	0.06
435	002318	久立特材	152,400	3,567,684.00	0.06
436	603087	甘李药业	80,500	3,550,050.00	0.06
437	002739	万达电影	292,400	3,549,736.00	0.06
438	600820	隧道股份	489,200	3,517,348.00	0.06
439	601179	中国西电	460,100	3,492,159.00	0.06
440	600312	平高电气	181,500	3,484,800.00	0.06
441	600580	卧龙电驱	202,700	3,484,413.00	0.06
442	600704	物产中大	688,400	3,483,304.00	0.06
443	600521	华海药业	194,600	3,477,502.00	0.06
444	600637	东方明珠	447,630	3,473,608.80	0.06
445	688303	大全能源	143,802	3,471,380.28	0.06
446	603806	福斯特	234,516	3,470,836.80	0.06
447	002841	视源股份	93,800	3,462,158.00	0.06
448	600060	海信视像	173,600	3,461,584.00	0.06
449	600699	均胜电子	220,400	3,453,668.00	0.06
450	002410	广联达	292,030	3,434,272.80	0.06
451	688506	百利天	17,896	3,431,200.08	0.06

		恒药业			
452	600132	重庆啤酒	54,400	3,428,288.00	0.06
453	002984	森麒麟	138,100	3,405,546.00	0.05
454	002385	大北农	775,600	3,358,348.00	0.05
455	601666	平煤股份	330,800	3,314,616.00	0.05
456	002262	恩华药业	136,000	3,311,600.00	0.05
457	601865	福莱特	167,606	3,300,162.14	0.05
458	300003	乐普医疗	290,788	3,297,535.92	0.05
459	688180	君实生物	120,190	3,284,792.70	0.05
460	603939	益丰药房	135,857	3,278,229.41	0.05
461	000683	远兴能源	586,400	3,277,976.00	0.05
462	300144	宋城演艺	352,720	3,276,768.80	0.05
463	603568	伟明环保	151,375	3,274,241.25	0.05
464	601059	信达证券	218,200	3,268,636.00	0.05
465	002568	百润股份	116,400	3,260,364.00	0.05
466	603179	新泉股份	76,300	3,258,010.00	0.05
467	300763	锦浪科技	53,300	3,255,031.00	0.05
468	600390	五矿资本	501,300	3,233,385.00	0.05
469	600008	首创环保	985,190	3,231,423.20	0.05
470	002044	美年健康	700,900	3,217,131.00	0.05
471	002152	广电运通	275,800	3,215,828.00	0.05
472	000039	中集集团	412,300	3,203,571.00	0.05
473	600392	盛和资源	309,500	3,181,660.00	0.05
474	002407	多氟多	264,380	3,172,560.00	0.05

475	600170	上海建工	1,195,300	3,167,545.00	0.05
476	600863	内蒙华电	731,100	3,165,663.00	0.05
477	300373	扬杰科技	72,600	3,159,552.00	0.05
478	600486	扬农化工	54,567	3,157,792.29	0.05
479	300529	健帆生物	107,600	3,156,984.00	0.05
480	603589	口子窖	80,100	3,143,124.00	0.05
481	000513	丽珠集团	82,200	3,123,600.00	0.05
482	600763	通策医疗	70,096	3,112,262.40	0.05
483	601717	郑煤机	239,600	3,110,008.00	0.05
484	002624	完美世界	300,150	3,100,549.50	0.05
485	000703	恒逸石化	492,910	3,095,474.80	0.05
486	601000	唐山港	656,400	3,091,644.00	0.05
487	300251	光线传媒	327,100	3,087,824.00	0.05
488	000960	锡业股份	219,900	3,085,197.00	0.05
489	600872	中炬高新	139,900	3,080,598.00	0.05
490	600816	建元信托	879,300	3,077,550.00	0.05
491	600498	烽火通信	157,700	3,068,842.00	0.05
492	000426	兴业银锡	275,000	3,058,000.00	0.05
493	603979	金诚信	84,200	3,056,460.00	0.05
494	600316	洪都航空	95,000	3,051,400.00	0.05
495	300285	国瓷材料	178,900	3,048,456.00	0.05
496	603195	公牛集团	43,318	3,042,656.32	0.05
497	603816	顾家家居	110,100	3,036,558.00	0.05
498	002500	山西证	482,880	3,032,486.40	0.05

		券			
499	000723	美锦能 源	671, 300	3, 027, 563. 00	0. 05
500	600516	方大炭 素	626, 720	3, 027, 057. 60	0. 05
501	002958	青农商 行	989, 100	3, 006, 864. 00	0. 05
502	002603	以岭药 业	187, 800	3, 006, 678. 00	0. 05
503	000629	钒钛股 份	1, 043, 300	3, 004, 704. 00	0. 05
504	300558	贝达药 业	55, 700	3, 003, 901. 00	0. 05
505	688578	艾力斯 医药科 技	50, 061	2, 998, 653. 90	0. 05
506	300390	天华新 能	130, 080	2, 998, 344. 00	0. 05
507	000830	鲁西化 工	255, 800	2, 990, 302. 00	0. 05
508	000921	海信家 电	103, 300	2, 985, 370. 00	0. 05
509	002025	航天电 器	61, 139	2, 968, 909. 84	0. 05
510	601966	玲珑轮 胎	164, 100	2, 960, 364. 00	0. 05
511	000636	风华高 科	206, 296	2, 960, 347. 60	0. 05
512	002939	长城证 券	360, 900	2, 959, 380. 00	0. 05
513	002155	湖南黄 金	187, 500	2, 949, 375. 00	0. 05
514	605358	立昂微	119, 000	2, 947, 630. 00	0. 05
515	002429	兆驰股 份	508, 700	2, 940, 286. 00	0. 05
516	002926	华西证 券	352, 900	2, 932, 599. 00	0. 05
517	000591	太阳能	615, 500	2, 929, 780. 00	0. 05
518	000893	亚钾国 际	144, 400	2, 911, 104. 00	0. 05
519	600511	国药股 份	84, 800	2, 901, 856. 00	0. 05
520	601880	辽港股	1, 676, 000	2, 899, 480. 00	0. 05

		份			
521	600535	天士力	199,400	2,883,324.00	0.05
522	600021	上海电力	313,730	2,876,904.10	0.05
523	600998	九州通	559,979	2,867,092.48	0.05
524	002203	海亮股份	266,500	2,864,875.00	0.05
525	601698	中国卫通	140,200	2,860,080.00	0.05
526	600038	中直股份	74,100	2,857,296.00	0.05
527	600325	华发股份	495,200	2,852,352.00	0.05
528	600348	华阳股份	401,900	2,849,471.00	0.05
529	603833	欧派家居	40,920	2,821,024.80	0.05
530	600380	健康元	250,100	2,818,627.00	0.05
531	600970	中材国际	296,700	2,812,716.00	0.05
532	002414	高德红外	377,911	2,807,878.73	0.05
533	600208	衢州发展	945,300	2,798,088.00	0.04
534	603927	中科软	128,944	2,798,084.80	0.04
535	603077	和邦生物	1,370,800	2,796,432.00	0.04
536	002423	中粮资本	207,800	2,782,442.00	0.04
537	600655	豫园股份	432,400	2,780,332.00	0.04
538	000060	中金岭南	589,300	2,763,817.00	0.04
539	688385	复旦微电	71,750	2,754,482.50	0.04
540	688187	时代电气	57,347	2,748,068.24	0.04
541	600754	锦江酒店	102,300	2,747,778.00	0.04
542	600859	王府井	178,172	2,745,630.52	0.04
543	300146	汤臣倍健	226,800	2,732,940.00	0.04
544	300567	精测电	42,500	2,732,750.00	0.04

		子			
545	601016	节能风电	861,950	2,732,381.50	0.04
546	300748	金力永磁	152,060	2,718,832.80	0.04
547	603000	人民网	123,000	2,710,920.00	0.04
548	601136	首创证券	123,100	2,708,200.00	0.04
549	002756	永兴材料	71,710	2,704,901.20	0.04
550	300487	蓝晓科技	56,350	2,697,474.50	0.04
551	600901	江苏金租	516,380	2,695,503.60	0.04
552	601236	红塔证券	317,260	2,693,537.40	0.04
553	002683	广东宏大	101,700	2,693,016.00	0.04
554	603885	吉祥航空	195,700	2,681,090.00	0.04
555	600583	海油工程	487,500	2,666,625.00	0.04
556	000519	中兵红箭	184,500	2,666,025.00	0.04
557	688278	特宝生物	36,225	2,657,828.25	0.04
558	300979	华利集团	33,700	2,650,505.00	0.04
559	600707	彩虹股份	321,200	2,640,264.00	0.04
560	600166	福田汽车	1,046,700	2,627,217.00	0.04
561	300212	易华录	112,220	2,625,948.00	0.04
562	600546	山煤国际	220,000	2,602,600.00	0.04
563	600282	南钢股份	554,000	2,598,260.00	0.04
564	000998	隆平高科	232,500	2,597,025.00	0.04
565	000708	中信特钢	227,400	2,594,634.00	0.04
566	603156	养元饮品	112,932	2,579,366.88	0.04

567	300677	英科医疗	101,540	2,566,931.20	0.04
568	002439	启明星辰	162,100	2,564,422.00	0.04
569	002507	涪陵榨菜	181,320	2,562,051.60	0.04
570	600004	白云机场	266,500	2,558,400.00	0.04
571	000598	兴蓉环境	334,800	2,541,132.00	0.04
572	688220	翱捷科技	46,915	2,537,632.35	0.04
573	300601	康泰生物	147,420	2,528,253.00	0.04
574	688065	凯赛生物	65,100	2,525,880.00	0.04
575	600131	国网信通	133,300	2,520,703.00	0.04
576	601001	晋控煤业	184,300	2,519,381.00	0.04
577	601918	新集能源	349,900	2,512,282.00	0.04
578	002373	千方科技	246,500	2,499,510.00	0.04
579	000050	深天马A	276,400	2,495,892.00	0.04
580	300765	新诺威	93,200	2,478,188.00	0.04
581	603899	晨光股份	81,900	2,477,475.00	0.04
582	300070	碧水源	487,700	2,467,762.00	0.04
583	002653	海思科	74,183	2,466,584.75	0.04
584	600483	福能股份	247,300	2,465,581.00	0.04
585	600867	通化东宝	305,104	2,459,138.24	0.04
586	300118	东方日升	204,700	2,452,306.00	0.04
587	000563	陕国投A	687,600	2,447,856.00	0.04
588	601611	中国核建	269,700	2,438,088.00	0.04
589	688772	珠海冠宇电池	151,387	2,434,302.96	0.04

590	601155	新城控股	203,300	2,431,468.00	0.04
591	600737	中粮糖业	238,000	2,429,980.00	0.04
592	002120	韵达股份	322,270	2,423,470.40	0.04
593	603486	科沃斯	51,500	2,420,500.00	0.04
594	600566	济川药业	82,607	2,402,211.56	0.04
595	601098	中南传媒	160,000	2,401,600.00	0.04
596	002430	杭氧股份	109,578	2,388,800.40	0.04
597	601231	环旭电子	144,600	2,385,900.00	0.04
598	603529	爱玛科技	58,100	2,383,262.00	0.04
599	002244	滨江集团	276,500	2,380,665.00	0.04
600	601156	东航物流	141,000	2,378,670.00	0.04
601	000987	越秀资本	338,305	2,374,901.10	0.04
602	601991	大唐发电	832,800	2,373,480.00	0.04
603	300676	华大基因	56,100	2,354,517.00	0.04
604	688005	容百科技	74,389	2,346,972.95	0.04
605	000818	航锦科技	122,700	2,343,570.00	0.04
606	002056	横店东磁	180,300	2,336,688.00	0.04
607	002368	太极股份	98,599	2,334,824.32	0.04
608	600598	北大荒	157,900	2,329,025.00	0.04
609	600416	湘电股份	205,700	2,322,353.00	0.04
610	603228	景旺电子	83,380	2,321,299.20	0.04
611	600582	天地科技	373,400	2,307,612.00	0.04
612	300595	欧普康	121,260	2,297,877.00	0.04

		视			
613	000887	中鼎股 份	175,100	2,297,312.00	0.04
614	601866	中远海 发	873,300	2,279,313.00	0.04
615	600271	航天信 息	250,000	2,277,500.00	0.04
616	600435	北方导 航	232,300	2,267,248.00	0.04
617	603658	安图生 物	51,950	2,267,098.00	0.04
618	300009	安科生 物	260,840	2,253,657.60	0.04
619	000958	电投产 融	361,600	2,252,768.00	0.04
620	002670	国盛金 控	171,600	2,246,244.00	0.04
621	002508	老板电 器	104,400	2,237,292.00	0.04
622	002572	索菲亚	129,900	2,231,682.00	0.04
623	002240	盛新锂 能	161,800	2,229,604.00	0.04
624	600755	厦门国 贸	335,300	2,226,392.00	0.04
625	002831	裕同科 技	81,900	2,219,490.00	0.04
626	688363	华熙生 物	43,392	2,214,727.68	0.04
627	600685	中船防 务	92,100	2,182,770.00	0.04
628	000155	川能动 力	204,300	2,181,924.00	0.04
629	601958	金钼股 份	216,800	2,181,008.00	0.04
630	000883	湖北能 源	436,500	2,173,770.00	0.03
631	300888	稳健医 疗	51,480	2,166,278.40	0.03
632	600258	首旅酒 店	147,100	2,157,957.00	0.03
633	600129	太极集 团	86,900	2,148,168.00	0.03
634	600995	南网储	212,100	2,146,452.00	0.03

		能			
635	688114	华大智造	45,819	2,143,871.01	0.03
636	002268	电科网安	131,800	2,141,750.00	0.03
637	688538	和辉光电	922,315	2,139,770.80	0.03
638	600848	上海临港	211,700	2,138,170.00	0.03
639	600378	昊华科技	73,900	2,136,449.00	0.03
640	600517	国网英大	384,300	2,117,493.00	0.03
641	000739	普洛药业	130,000	2,113,800.00	0.03
642	600739	辽宁成大	203,500	2,106,225.00	0.03
643	603298	杭叉集团	116,600	2,085,974.00	0.03
644	603379	三美股份	54,200	2,080,196.00	0.03
645	003031	中瓷电子	39,700	2,079,883.00	0.03
646	601118	海南橡胶	382,600	2,069,866.00	0.03
647	000778	新兴铸管	538,500	2,067,840.00	0.03
648	600906	财达证券	290,000	2,059,000.00	0.03
649	603728	鸣志电器	37,800	2,041,200.00	0.03
650	000403	派林生物	96,600	2,041,158.00	0.03
651	601636	旗滨集团	363,700	2,040,357.00	0.03
652	000709	河钢股份	921,700	2,036,957.00	0.03
653	000027	深圳能源	314,100	2,035,368.00	0.03
654	600528	中铁工业	249,000	2,006,940.00	0.03
655	002299	圣农发展	138,100	1,999,688.00	0.03

656	601808	中海油服	130,900	1,996,225.00	0.03
657	603712	七一二	102,400	1,993,728.00	0.03
658	603737	三棵树	46,780	1,992,828.00	0.03
659	000785	居然智家	558,000	1,992,060.00	0.03
660	600329	达仁堂	64,600	1,989,680.00	0.03
661	688234	天岳先进	38,668	1,979,801.60	0.03
662	600499	科达制造	253,700	1,978,860.00	0.03
663	600606	绿地控股	941,100	1,976,310.00	0.03
664	002557	洽洽食品	67,749	1,968,108.45	0.03
665	600373	中文传媒	156,200	1,960,310.00	0.03
666	601399	国机重装	635,600	1,957,648.00	0.03
667	600977	中国电影	168,500	1,956,285.00	0.03
668	002080	中材科技	148,800	1,946,304.00	0.03
669	600968	海油发展	453,300	1,935,591.00	0.03
670	601928	凤凰传媒	167,400	1,931,796.00	0.03
671	603858	步长制药	121,700	1,922,860.00	0.03
672	688567	孚能科技	163,545	1,897,122.00	0.03
673	603650	彤程新材	53,900	1,884,883.00	0.03
674	601598	中国外运	349,000	1,867,150.00	0.03
675	600959	江苏有线	557,300	1,866,955.00	0.03
676	600884	杉杉股份	247,400	1,843,130.00	0.03
677	002266	浙富控股	589,200	1,838,304.00	0.03
678	600062	华润双鹤	92,800	1,837,440.00	0.03

679	600095	湘财股份	254, 500	1, 832, 400. 00	0. 03
680	600764	中国海防	64, 500	1, 826, 640. 00	0. 03
681	000800	一汽解放	222, 500	1, 824, 500. 00	0. 03
682	600871	石化油服	893, 900	1, 823, 556. 00	0. 03
683	600056	中国医药	163, 867	1, 818, 923. 70	0. 03
684	000032	深桑达 A	102, 700	1, 811, 628. 00	0. 03
685	688387	中信科移动	303, 500	1, 808, 860. 00	0. 03
686	000559	万向钱潮	293, 700	1, 806, 255. 00	0. 03
687	601212	白银有色	649, 500	1, 805, 610. 00	0. 03
688	601106	中国一重	619, 594	1, 803, 018. 54	0. 03
689	002372	伟星新材	142, 100	1, 794, 723. 00	0. 03
690	688297	中航无人机	44, 500	1, 792, 460. 00	0. 03
691	600801	华新水泥	147, 800	1, 788, 380. 00	0. 03
692	002019	亿帆医药	164, 000	1, 758, 080. 00	0. 03
693	000825	太钢不锈	501, 600	1, 745, 568. 00	0. 03
694	301301	川宁生物	146, 400	1, 736, 304. 00	0. 03
695	601608	中信重工	413, 300	1, 735, 860. 00	0. 03
696	603688	石英股份	60, 400	1, 735, 292. 00	0. 03
697	002487	大金重工	84, 200	1, 725, 258. 00	0. 03
698	603882	金域医学	62, 500	1, 720, 625. 00	0. 03
699	600377	宁沪高速	112, 200	1, 717, 782. 00	0. 03
700	600663	陆家嘴	172, 500	1, 697, 400. 00	0. 03

701	600808	马钢股份	539,700	1,667,673.00	0.03
702	688349	三一重能	53,904	1,664,555.52	0.03
703	688561	奇安信集团	61,551	1,651,413.33	0.03
704	600500	中化国际	407,044	1,636,316.88	0.03
705	603456	九洲药业	118,700	1,623,816.00	0.03
706	002408	齐翔腾达	322,580	1,622,577.40	0.03
707	300957	贝泰妮	37,800	1,613,682.00	0.03
708	603556	海兴电力	43,600	1,612,764.00	0.03
709	600925	苏能股份	303,400	1,608,020.00	0.03
710	601019	山东出版	141,300	1,603,755.00	0.03
711	002531	天顺风能	202,300	1,600,193.00	0.03
712	601965	中国汽研	90,700	1,598,134.00	0.03
713	600350	山东高速	153,600	1,579,008.00	0.03
714	001227	兰州银行	641,300	1,577,598.00	0.03
715	688425	铁建重工	357,900	1,574,760.00	0.03
716	600578	京能电力	444,200	1,563,584.00	0.03
717	688390	固德威电源	38,156	1,560,580.40	0.03
718	001286	陕西能源	166,100	1,541,408.00	0.02
719	600098	广州发展	238,500	1,531,170.00	0.02
720	688516	奥特维科技	35,217	1,525,248.27	0.02
721	603185	弘元绿能	92,975	1,510,843.75	0.02
722	000937	冀中能源	238,800	1,509,216.00	0.02

723	603233	大参林	99,920	1,504,795.20	0.02
724	601568	北元集团	353,540	1,484,868.00	0.02
725	600688	上海石化	490,800	1,482,216.00	0.02
726	603225	新凤鸣	133,000	1,480,290.00	0.02
727	603707	健友股份	109,227	1,449,442.29	0.02
728	600126	杭钢股份	299,800	1,433,044.00	0.02
729	603883	老百姓	86,385	1,414,122.45	0.02
730	000967	盈峰环境	283,600	1,409,492.00	0.02
731	002867	周大生	96,700	1,405,051.00	0.02
732	600720	中交设计	154,000	1,364,440.00	0.02
733	601992	金隅集团	748,220	1,331,831.60	0.02
734	600339	中油工程	372,000	1,331,760.00	0.02
735	601139	深圳燃气	188,100	1,327,986.00	0.02
736	600295	鄂尔多斯	132,900	1,297,104.00	0.02
737	002153	石基信息	181,457	1,295,602.98	0.02
738	000898	鞍钢股份	530,800	1,273,920.00	0.02
739	002608	江苏国信	165,800	1,271,686.00	0.02
740	002563	森马服饰	180,200	1,265,004.00	0.02
741	000537	中绿电	137,700	1,255,824.00	0.02
742	300140	节能环境	208,400	1,248,316.00	0.02
743	000401	冀东水泥	233,100	1,219,113.00	0.02
744	600032	浙江新能	163,500	1,209,900.00	0.02
745	003022	联泓新科	87,800	1,209,006.00	0.02
746	688331	荣昌生物	38,975	1,173,537.25	0.02

747	601228	广州港	344,700	1,168,533.00	0.02
748	002690	美亚光电	77,762	1,152,432.84	0.02
749	600007	中国国贸	46,000	1,125,160.00	0.02
750	600299	安迪苏	88,000	1,104,400.00	0.02
751	600928	西安银行	305,100	1,101,411.00	0.02
752	688172	燕东微电子股份	54,000	1,082,700.00	0.02
753	301267	华夏眼科	56,000	1,066,240.00	0.02
754	600361	创新新材	275,900	1,064,974.00	0.02
755	000959	首钢股份	345,300	1,053,165.00	0.02
756	003035	南网能源	246,800	1,031,624.00	0.02
757	603056	德邦股份	69,100	990,203.00	0.02
758	002945	华林证券	62,000	950,460.00	0.02
759	000539	粤电力A	200,700	909,171.00	0.01
760	001203	大中矿业	98,500	853,010.00	0.01
761	603826	坤彩科技	44,100	848,925.00	0.01
762	601061	中信金属	116,300	844,338.00	0.01
763	600927	永安期货	63,100	832,289.00	0.01
764	601158	重庆水务	122,700	601,230.00	0.01
765	600956	新天绿能	66,100	498,394.00	0.01

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	占基金资产
----	------	------	-------	------	-------

				(元)	净值比例 (%)
1	400174	中天 3	371,600	3,716.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超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	300750	宁德时代	86,449,461.42	1.20
2	000333	美的集团	49,330,632.33	0.69
3	002594	比亚迪	43,584,006.83	0.61
4	002371	北方华创	40,462,975.40	0.56
5	000858	五 粮 液	35,499,944.00	0.49
6	300059	东方财富	31,029,382.04	0.43
7	000651	格力电器	25,730,785.95	0.36
8	002475	立讯精密	25,185,614.00	0.35
9	300760	迈瑞医疗	22,370,720.00	0.31
10	601127	赛力斯	22,292,034.00	0.31
11	600900	长江电力	22,252,657.00	0.31
12	000725	京东方 A	21,690,862.00	0.30
13	300124	汇川技术	20,468,201.00	0.28
14	300308	中际旭创	18,602,191.43	0.26
15	300274	阳光电源	18,589,565.00	0.26
16	002415	海康威视	18,152,552.40	0.25
17	002714	牧原股份	16,685,177.43	0.23
18	000001	平安银行	14,527,129.00	0.20
19	600519	贵州茅台	14,392,628.80	0.20
20	000063	中兴通讯	14,080,169.20	0.20

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	300750	宁德时代	125,055,873.30	1.74
2	000333	美的集团	75,141,755.08	1.04

3	002594	比亚迪	60,438,630.44	0.84
4	000858	五粮液	56,534,932.02	0.79
5	300059	东方财富	44,643,962.73	0.62
6	002371	北方华创	42,576,670.76	0.59
7	000651	格力电器	40,882,604.00	0.57
8	002475	立讯精密	38,791,882.28	0.54
9	300760	迈瑞医疗	35,587,807.24	0.49
10	000725	京东方A	33,626,061.00	0.47
11	300124	汇川技术	29,056,090.90	0.40
12	300308	中际旭创	27,885,882.92	0.39
13	300274	阳光电源	27,277,125.65	0.38
14	002415	海康威视	27,222,855.56	0.38
15	600519	贵州茅台	26,538,463.00	0.37
16	000792	盐湖股份	26,265,826.50	0.37
17	002714	牧原股份	25,630,456.12	0.36
18	000001	平安银行	22,522,279.00	0.31
19	002142	宁波银行	22,132,918.21	0.31
20	000568	泸州老窖	22,033,359.08	0.31

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	2,401,945,210.62
卖出股票收入（成交）总额	2,971,467,515.37

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

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

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,327,350.18
2	应收清算款	40,413,750.91
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	56,741,101.09

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	400174	中天 3	3,716.00	0.00	重大事项停牌

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		平安银行股份有限公司-汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
6,244	984,655.22	5,880,745,146.00	95.65	267,442,052.00	4.35	82,195,700.00	1.34

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

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中央汇金资产管理有限责任公司	1,307,627,911.00	21.27
2	中国人寿保险股份有限公司	893,220,988.00	14.53
3	汇添富基金-中国人寿保险股份	551,585,200.00	8.97

	有限公司一分红 险—汇添富基金 国寿股份成长股 票型组合		
4	汇添富基金—中 国人寿保险股份 有限公司—传统 险—汇添富国寿 股份成长股票传 统可供出	508,909,200.00	8.28
5	大家人寿保险股 份有限公司—传 统产品	263,805,300.00	4.29
6	汇添富基金—中 国人寿保险股份 有限公司—传统 险—汇添富国寿 股份均衡股票传 统可供出	263,344,800.00	4.28
7	友邦人寿保险有 限公司—传统	149,624,000.00	2.43
8	中国平安人寿保 险股份有限公司 —传统—普通保 险产品	140,056,000.00	2.28
9	汇添富基金—中 国人寿保险股份 有限公司一分红 险—汇添富基金 国寿股份均衡股 票型组合	133,783,900.00	2.18
10	中汇人寿保险股 份有限公司一分 红产品	122,197,400.00	1.99
11	平安银行股份有 限公司—汇添富 中证 800 交易型 开放式指数证券 投资基金联接基 金	82,195,700.00	1.34

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	200,000.00	0.00

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 10 月 08 日）基金份额总额	6,601,437,198.00
本报告期期初基金份额总额	8,166,937,198.00
本报告期基金总申购份额	3,519,750,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,538,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,148,187,198.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

2024 年 12 月 9 日，根据工作安排，宋菁女士不再担任平安银行股份有限公司资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2019 年 10 月 08 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 80,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商 名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例 (%)	佣金	占当期佣 金总量的 比例 (%)	
华泰 证券	2	1,865,891,383.91	34.72	400,783.95	25.19	
中泰 证券	1	1,657,402,972.29	30.84	556,735.66	34.99	
海通 证券	2	927,582,264.89	17.26	471,348.31	29.62	
兴业 证券	1	516,531,358.91	9.61	90,871.63	5.71	

东方证券	2	406,004,745.99	7.56	71,428.45	4.49	
广发证券	4	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	2	-	-	-	-	
银河证券	2	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	3	-	-	-	-	

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
华泰证券	640,674.39	82.30	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证	137,789.92	17.70	53,000,000.00	27.04	-	-	-	-

券								
兴业证券	-	-	90,000,000.00	45.92	-	-	-	-
东方证券	-	-	53,000,000.00	27.04	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部(合称“投资研究部门”)根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

(2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。(采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)

(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门决定。

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

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 5 家证券公司的 10 个交易单元：招商证券(深交所单元，上交所单元)、中信证券(深交所单元，上交所单元)、银河证券(上交所单元，深交所单元)、申万宏源证券(深交所单元，上交所单元)、广发证券(深交所单元，上交所单元)；不再租用 1 家证券公司的 2 个交易单元：兴业证券(深交所单元，上交所单元)。

3、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施，《汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度)》公告首次披露的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，特此说明。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2024 年 01 月 02 日
2	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京增财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	2024 年 01 月 17 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 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	2024 年 01 月 22 日

		站	
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华金证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 08 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 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	2024 年 03 月 29 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息资料的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 03 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富投资管理有限公司股东变更的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 16 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 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	2024 年 04 月 22 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加渤海证券为申购赎回代理券商的公告	中证报,上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 20 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华源证券为申购赎回代理券商的公告	中证报,上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 20 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加财达证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 03 日
12	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 07 日
13	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京中期时代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	2024 年 06 月 13 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券为申购赎回代理券商的公告	中证报,上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 18 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回	中证报,上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 19 日

	代理券商的公告		
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 05 日
17	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 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	2024 年 07 月 19 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加万和证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 25 日
19	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加信达证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 31 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华鑫证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 08 月 07 日
21	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与中民财富基金销售(上海)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	2024 年 08 月 15 日
22	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 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	2024 年 08 月 30 日
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加联储证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 09 月 02 日
24	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加湘财证券为申购赎回代理券商的公告	中证报,上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 09 月 27 日
25	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 18 日
26	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	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 18 日
27	汇添富基金管理股份有限公司	上交所,上证报,公司	2024 年 10 月 25 日

	旗下基金 2024 年第三季度报告	网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	
28	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与乾道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	2024 年 11 月 20 日
29	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大同证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 25 日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 19 日
31	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中航证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024 年 10 月 10 日至 2024 年 12 月 31	1,307,627,911.00	-	-	1,307,627,911.00	21.27

日					
产品特有风险					
1、持有人大会投票权集中的风险					
当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。					
2、基金规模较小导致的风险					
持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。					
3、提前终止基金合同的风险					
持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。					

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 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

2025 年 03 月 31 日