

汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	63
7.1 期末基金资产组合情况	63
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	64
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	89
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	92
7.6 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	92
7.7 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	92
7.8 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	93
7.9 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	93

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	93
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	93
7.12 投资组合报告附注.....	93
§ 8 基金份额持有人信息.....	94
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	94
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	94
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	94
8.4 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.....	95
§ 9 开放式基金份额变动.....	95
§ 10 重大事件揭示.....	95
10.1 基金份额持有人大会决议.....	95
10.2 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.....	95
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	95
10.4 基金投资策略的改变.....	96
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	96
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	96
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	96
10.8 其他重大事件.....	100
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	100
11.1 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.....	100
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	101
§ 12 备查文件目录.....	101
12.1 备查文件目录.....	101
12.2 存放地点.....	101
12.3 查阅方式.....	101

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	汇添富核心精选混合（LOF）
场内简称	添富精选
基金主代码	501188
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 08 月 03 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	1,627,730,086.57
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 03 月 29 日

注：扩位证券简称：添富核心精选 LOF。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选优质个股，力争为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；股票投资策略主要用于挖掘股票市场中的优质个股。本基金的投资策略还包括：战略配售策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*20%+中债综合指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。 本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分

	基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。
--	---------------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	李文	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2023年01月01日 - 2023年06月30日)
本期已实现收益	-32,704,045.58
本期利润	-148,578,033.84

加权平均基金份额本期利润	-0.0870
本期加权平均净值利润率	-10.01%
本期基金份额净值增长率	-9.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年06月30日)
期末可供分配利润	-294,715,855.25
期末可供分配基金份额利润	-0.1811
期末基金资产净值	1,333,014,231.32
期末基金份额净值	0.8189
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-29.95%

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
过去一个月	0.82%	1.50%	1.81%	0.67%	-0.99%	0.83%
过去三个月	-7.24%	1.30%	-2.72%	0.61%	-4.52%	0.69%
过去六个月	-9.63%	1.24%	-0.09%	0.63%	-9.54%	0.61%
过去一年	-21.31%	1.60%	-7.86%	0.76%	-13.45%	0.84%
自基金合同生效日起至今	-29.95%	1.72%	-14.15%	0.82%	-15.80%	0.90%

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准

收益率变动的比较

汇添富核心精选混合（LOF）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（2021 年 08 月 03 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。

本基金由原汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）于 2021 年 08 月 03 日转型而来。

§ 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、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。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。

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

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

2023 上半年，汇添富基金新成立 27 只公开募集证券投资基金，包括 10 只股票型基金、9 只混合型基金、8 只债券型基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 297 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

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		
刘江	本基金的基金经理	2021 年 08 月 03 日		12	国籍：中国。学历：清华大学工学硕士，德国亚琛工大工学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任医药行业分析师。2015 年 6 月 18 日至今任汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 8 月 16 日至今任汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇

				<p>添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 8 月 8 日至 2020 年 5 月 29 日任汇添富创新医药主题混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月 6 日至 2023 年 4 月 13 日任汇添富科技创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月 10 日至 2022 年 3 月 7 日任汇添富稳健添盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月 2 日至今任汇添富高质量成长精选 2 年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月 20 日至 2022 年 3 月 7 日任汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 9 日至今任汇添富高质量成长 30 一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 9 日至 2022</p>
--	--	--	--	--

					<p>年 3 月 7 日任汇添富稳进双盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 3 日至今任汇添富成长先锋六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 3 日至今任汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。</p>
刘伟林	本基金的基金经理, 研究总监	2021 年 08 月 03 日		15	<p>国籍：中国。学历：北京大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2008 年 7 月加入汇添富基金任行业分析师；2010 年 5 月至 2011 年 3 月在国家发展和改革委员会工作。2011 年 3 月至 2015 年 12 月在汇添富基金管理股份有限公司担任高级策略分析师，现任研究总监。2015 年 12 月 2 日至今任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇添富 3 年封闭运</p>

				<p>作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 8 月 19 日至 2022 年 8 月 29 日任汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 17 日至 2022 年 10 月 25 日任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 3 日至今任汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2021 年 8 月 3 日至今任汇添富稳健收益混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 17 日至 2023 年 6 月 14 日任汇添富均衡配置个股精选六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至今任汇添富中盘潜力增长一年持有期</p>
--	--	--	--	---

					混合型证券投资基金的基金经理。
杨璿	本基金的基金经理	2021 年 08 月 03 日		13	<p>国籍：中国。学历：清华大学工程学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。</p> <p>从业经历：2010 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司，2010 年 8 月至 2017 年 1 月担任公司的 TMT 行业分析师。2017 年 1 月 25 日至今任汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月 21 日至今任汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 1 月 18 日至 2020 年 12 月 22 日任汇添富移动互联网股票型证券投资基金的基金经理。2020 年 5 月 25 日至今任汇添富优质成长混合型证券投资基金的基金经</p>

					<p>理。2020 年 11 月 18 日至今任汇添富数字生活主题六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 24 日至今任汇添富数字未来混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 20 日至今任汇添富数字经济引领发展三年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 3 日至今任汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2022 年 2 月 21 日至今任汇添富自主核心科技一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 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

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 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 25 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。

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

市场上半年跌宕起伏，是非常有挑战性的一个投资阶段。指数整体呈现出先扬后抑走势，与宏观经济相关的总量资产，包括白酒为代表的消费品、传统制造业和资源行业等经历了一个较长时间的调整。但是，以计算机、电子、传媒和通信为代表的科技类资产表现活跃，机

构性机会丰富，但是波动也非常大。而以光伏、新能源汽车等为代表的高端制造业，由于供给大幅增加，不少环节盈利能力在下降，呈现出估值持续收缩的状态。如何规避风险？如何把握机构性机会？如何平衡长期的价值和短期的压力等？对投资人提出了较大的挑战。

上半年从大的市场环境来看，有三个显著特征。第一、整体宏观经济在一季度复苏后，二季度出现持续调整的态势。尤其以 PMI、PPI、CPI、消费增速等为代表的宏观经济数据逐渐走弱，企业的盈利持续承压。尤其考虑到不少制造业等，前几年资本支出比较大，正在形成的新增供给持续增加，加剧了这种盈利压力。大部分与宏观经济相关的消费、制造和资源等资产股价持续走弱。第二、流动性环境非常宽裕。国内货币环境保持了相对宽松的状态，同时实体经济相对偏弱，利率水平持续走低，宏观流动性是非常宽裕的。这为主题投资、科技股投资提供了很好的流动性环境。第三、人工智能全球的产业格局席卷全世界在资产市场产生共振。Chatgpt 的横空出世，宣布人工智能进入新的时代，全球展开了人工智能的激烈竞赛。处在产业前端的光模块、芯片、服务器等感受到了这种需求的快速上升。人工智能在应用端的创新也在逐步展开，这带动了相关科技行业的投资机会。

上半年，我们围绕着三条主线进行资产配置。第一，围绕着 AI 产业及其影响的许多行业的重估带来的投资机会，包括传媒、智能驾驶、半导体等，这些板块加大配置。第二，对于以互联网、创新药等为代表的龙头企业，过去两年受基本面走弱股价调整较大，但是这些行业基本面在逐步好转，公司的中长期价值和短期的经营向好同时具备，这类资产也加大了配置。第三、白酒、新能源汽车产业链、光伏新技术等高端制造业，尽管短期有经营的压力，但是不少龙头企业估值到了非常安全的位置，经营的底部逐步明朗，从中长期的角度适当配置了这类稳健类资产。

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-9.63%。同期业绩比较基准收益率为-0.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断下半年的市场将是积极可为的阶段。一方面，宏观经济经历了上半年的调整压力，不少中游制造业库存水平处在非常低的位置，客观上存在补库需求。随着财政政策和刺激内需政策的发力，宏观经济有望逐步改善。第二、政策明确提出活跃资本市场、提振投资者信心。政策层面对资本市场的呵护非常明显，对于提升投资人风险偏好有积极作用。第三、从估值水平看，无论横向的国际对比还是纵向的历史估值水平对比，A 股和港股都处在估值非常有吸引力的位置。

未来我们将在四条主线加大配置。第一、对经典消费品、互联网等资产加大配置。这类

资产经营相对稳健，增长的确性比较高。之前受外部因素影响估值到了相对低估的位置，从长期视角看具备很好的投资价值，我们将继续加大配置。第二、人工智能产业的深化带来的投资机会，包括科技、智能驾驶、传媒娱乐等；第三、新能源汽车和光伏等领域里的新科技、新技术，带来提效降本的投资机会。第四、国企改革。包括在医药、传统制造业和资源行业等，围绕着国企改革带来的效率提升，盈利改善的投资机会。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	86,633,707.43	27,993,664.88
结算备付金		2,016,932.18	4,165,500.91
存出保证金		951,673.58	635,567.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,183,189,032.99	1,557,250,760.60
其中：股票投资		1,181,245,258.53	1,486,583,236.44
基金投资		-	-
债券投资		1,943,774.46	70,667,524.16
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		82,970,429.73	21,132,463.36
应收股利		-	-
应收申购款		54,103.34	170,960.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,355,815,879.25	1,611,348,917.19
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		10,030,212.16	2,090,801.07
应付赎回款		7,449,928.81	1,809,487.28
应付管理人报酬		1,703,053.40	2,020,416.13
应付托管费		283,842.21	336,736.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7.73	7.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	3,334,603.62	2,690,082.39
负债合计		22,801,647.93	8,947,530.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,627,730,086.57	1,768,213,346.34
未分配利润	6.4.7.9	-294,715,855.25	-165,811,960.02
净资产合计		1,333,014,231.32	1,602,401,386.32
负债和净资产总计		1,355,815,879.25	1,611,348,917.19

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值0.8189元，基金份额总额1,627,730,086.57份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023年01月01日至2023年06月30	2022年01月01日至2022年06月30

		日	日
一、营业总收入		-135,509,389.17	-138,664,098.08
1. 利息收入		1,043,381.79	454,771.67
其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,043,381.79	454,771.67
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-20,833,293.51	-251,471,973.79
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-25,219,217.72	-264,791,426.14
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-36,614.70	2,626,817.11
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	4,422,538.91	10,692,635.24
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）	6.4.7.18	-115,873,988.26	111,809,470.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	154,510.81	543,633.96
减：二、营业总支出		13,068,644.67	16,616,624.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,091,370.42	14,116,684.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,848,561.77	2,352,780.73
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	5,426.46
其中：卖出回购金融资产支出		-	5,426.46
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		4.98	13.63
8. 其他费用	6.4.7.21	128,707.50	141,719.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-148,578,033.84	-155,280,723.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-148,578,033.84	-155,280,723.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-148,578,033.84	-155,280,723.01

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,768,213,346.34	-165,811,960.02	1,602,401,386.32
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,768,213,346.34	-165,811,960.02	1,602,401,386.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-140,483,259.77	-128,903,895.23	-269,387,155.00
（一）、综合收益总额	-	-148,578,033.84	-148,578,033.84
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-140,483,259.77	19,674,138.61	-120,809,121.16
其中：1. 基金申购款	14,284,442.91	-1,827,204.11	12,457,238.80
2. 基金赎回款	-154,767,702.68	21,501,342.72	-133,266,359.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,627,730,086.57	-294,715,855.25	1,333,014,231.32
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,203,301,334.59	214,732,638.51	2,418,033,973.10
加：会计政策变更	-	-	-

二、本期期初净资产(基金净值)	2,203,301,334.59	214,732,638.51	2,418,033,973.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-264,587,278.41	-135,905,587.98	-400,492,866.39
（一）、综合收益总额	-	-155,280,723.01	-155,280,723.01
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-264,587,278.41	19,375,135.03	-245,212,143.38
其中：1. 基金申购款	56,489,026.81	-3,092,950.11	53,396,076.70
2. 基金赎回款	-321,076,305.22	22,468,085.14	-298,608,220.08
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,938,714,056.18	78,827,050.53	2,017,541,106.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），是由汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）变更而来。原汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]923 号文《关于准予汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2018 年 7 月 5 日生效。首次设立基金募集规模为

14,436,240,692.05 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（2018）验字第 60466941_B28 号验资报告予以验证。

根据相关法律法规及《汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型为汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。自 2021 年 7 月 5 日起至 2021 年 8 月 2 日，进入转型过渡期，转型过渡期结束的次日起，即自 2021 年 8 月 3 日起，《汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》失效。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 30%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选优质个股，力争为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统

称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;

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

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

2. 增值税

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

收增值税；

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

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

6. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	86,633,707.43
等于：本金	86,572,079.19
加：应计利息	61,628.24
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
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	-
合计	86,633,707.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,244,426,386.64	-	1,181,245,258.53	-63,181,128.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,744.46	1,943,774.46	121,030.00
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	2,744.46	1,943,774.46	121,030.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,246,246,386.64	2,744.46	1,183,189,032.99	-63,060,098.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,757.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,146,626.98
其中：交易所市场	3,146,626.98
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	124,712.18
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	3,334,603.62

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,768,213,346.34	1,768,213,346.34
本期申购	14,284,442.91	14,284,442.91
本期赎回（以“-”号填列）	-154,767,702.68	-154,767,702.68
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算	-	-

调整		
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,627,730,086.57	1,627,730,086.57

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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
本期期初	193,541,618.44	-359,353,578.46	-165,811,960.02
本期利润	-32,704,045.58	-115,873,988.26	-148,578,033.84
本期基金份额交易产生的变动数	-16,590,881.35	36,265,019.96	19,674,138.61
其中：基金申购款	1,706,970.38	-3,534,174.49	-1,827,204.11
基金赎回款	-18,297,851.73	39,799,194.45	21,501,342.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	144,246,691.51	-438,962,546.76	-294,715,855.25

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	948,061.97
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	89,699.76
其他	5,620.06
合计	1,043,381.79

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	4,485,515,956.42
减：卖出股票成本总额	4,498,488,381.39
减：交易费用	12,246,792.75
买卖股票差价收入	-25,219,217.72

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	73,501.84
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	-110,116.54
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	-36,614.70

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	71,002,049.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	69,645,116.54
减：应计利息总额	1,467,049.40
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-110,116.54

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,422,538.91
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,422,538.91

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-115,873,988.26
——股票投资	-115,932,122.66
——债券投资	58,134.40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-115,873,988.26

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	154,510.81
替代损益	-
其他	-
合计	154,510.81

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
审计费用		34,712.18
信息披露费		59,507.37
证券出借违约金		-
账户维护费		18,600.00
银行费用		499.00
指数使用费		-
持有人大会-公证费		-
持有人大会-律师费		-
开户费		-
上市费		-
其他		15,388.95
合计		128,707.50

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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	999,380,633.43	11.38	368,588,521.83	9.51

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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	-	-	15,100,000.00	20.54

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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	727,392.50	11.35	306,796.84	9.75
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 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	293,599.18	10.08	-	-

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,091,370.42	14,116,684.30
其中：支付销售机构的客户维护费	3,247,605.09	2,373,830.91

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,848,561.77	2,352,780.73

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

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

F 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	86,633,707.43	948,061.97	70,671,833.49	410,315.38

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	

		日		限						
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	
001380	华纬科技	2023年05月09日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	
300804	广康生化	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	
301170	锡南科技	2023年06月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	
301202	朗威股份	2023年06月28日	5个交易日	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	
301202	朗	2023	6	新	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	

	威股份	年 06 月 28 日	个 月	股 流 通 受 限						
301203	国泰环保	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	
301225	恒勃股份	2023 年 06 月 08 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	
301232	飞沃科技	2023 年 06 月 08 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	
301260	格力博	2023 年 01 月 20 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	30.85	23.63	2,935	90,544.75	69,354.05	
301261	恒工精密	2023 年 06 月 29 日	7 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	
301261	恒工精密	2023 年 06 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	
301262	海看股	2023 年 06 月	6 个 月	新 股 流	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	

	份	月 13 日		通 受 限						
301281	科 源 制 药	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	
301292	海 科 新 源	2023 年 06 月 29 日	6 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	
301292	海 科 新 源	2023 年 06 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	
301293	三 博 脑 科	2023 年 04 月 25 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	
301301	川 宁 生 物	2022 年 12 月 20 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	
301305	朗 坤 环 境	2023 年 05 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	
301307	美 利 信	2023 年 04 月 14	6 个 月	新 股 流 通 受	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	

		日		限						
301310	鑫宏业	2023年05月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	
301315	威士顿	2023年06月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	
301317	鑫磊股份	2023年01月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	
301320	豪江智能	2023年06月01日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	
301337	亚华电子	2023年05月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	
301355	南王科技	2023年06月02日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	
301358	湖	2023	6	新	23.77	42.89	1,973	46,898.21	84,621.97	

	南裕能	年 02 月 01 日	个 月	股 流 通 受 限						
301360	荣旗科技	2023 年 04 月 17 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	
301373	凌玮科技	2023 年 01 月 20 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	
301376	致欧科技	2023 年 06 月 14 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	
301382	蜂助手	2023 年 05 月 09 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	
301383	天键股份	2023 年 05 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	
301397	溯联股份	2023 年 06 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	
301399	英特科	2023 年 05 月	6 个 月	新 股 流 通 受 限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	

	技	月 16 日		通 受 限						
301428	世纪恒通	2023 年 05 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	
301439	泓淋电力	2023 年 03 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	
301488	豪恩汽电	2023 年 06 月 26 日	6 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	
301488	豪恩汽电	2023 年 06 月 26 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	
601061	中信金属	2023 年 03 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	
601065	江西省盐业集团	2023 年 03 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	
601133	柏诚系统	2023 年 03 月	6 个 月	新 股 流 通	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	

	股份 公司	31 日		受 限						
603135	中 重 科 技	2023 年 03 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	
603137	恒 尚 节 能	2023 年 04 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	
688146	中 船 派 瑞 特 气	2023 年 04 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	
688334	西 高 院	2023 年 06 月 09 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	
688352	顾 中 科 技	2023 年 04 月 11 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	
688361	中 科 飞 测	2023 年 05 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	
688433	华 曙 高 科	2023 年 04 月	6 个 月	新 股 流 通	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	

		07 日		受 限						
688443	智翔金泰	2023 年 06 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	37.88	29.49	2,314	87,654.32	68,239.86	
688458	美芯晟科技	2023 年 05 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	
688472	阿特斯阳光电力	2023 年 06 月 02 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.10	17.04	4,751	52,736.10	80,957.04	
688479	用友汽车信息科技	2023 年 05 月 04 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	
688484	南芯科技	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	
688502	茂莱光学	2023 年 02 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	69.72	178.59	1,509	105,207.48	269,492.31	
688507	索辰科	2023 年 04 月	6 个 月	新 股 流	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	

	技	月 10 日		通 受 限						
688523	航天环宇科技	2023 年 05 月 26 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	
688535	华海诚科新材料	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	
688552	航天南湖	2023 年 05 月 08 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	
688562	航天软件股份	2023 年 05 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	
688581	安杰思医学	2023 年 05 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	
688582	芯动联科	2023 年 06 月 21 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	
688620	安凯微电	2023 年 06 月	6 个 月	新 股 流 通	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	

	子	15		受限						
688623	二元科技	2023年05月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	
688629	四川华丰科技	2023年06月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	
688631	莱斯信息	2023年06月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“科源制药”（证券代码：301281）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的96股（根据山东科源制药股份有限公司2022年年度权益分派实施公告，科源制药以公司现有总股本77,350,000股为基数，向全体股东每10股派4元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每10股转增4股，除权除息日为2023年5月26日。）。本基金持有的流通受限股票“索辰科技”（证券代码：688507）包含

其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 72 股（根据上海索辰信息科技股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告，索辰科技以公司现有总股本 41,333,400 股为基数，向全体股东每股派 0.15 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每股转增 0.48 股，除权除息日为 2023 年 6 月 20 日。）。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 3 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个 月 - 1 年	1 - 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资产							
银行 存款	86,633,707.43	-	-	-	-	-	86,633,707.43
结算 备付 金	2,016,932.18	-	-	-	-	-	2,016,932.18
存出 保证 金	951,673.58	-	-	-	-	-	951,673.58
交易 性金 融资 产	1,943,774.46	-	-	-	-	1,181,245,258.53	1,183,189,032.99
衍生 金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	82,970,429.73	82,970,429.73
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	7,971.57	-	-	-	-	46,131.77	54,103.34
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	91,554,059.22	-	-	-	-	1,264,261,820.03	1,355,815,879.25
资产							
负债							

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	-	-	-	-	-	10,030,212.16	10,030,212.16
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,449,928.81	7,449,928.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,703,053.40	1,703,053.40

应付托管费	-	-	-	-	-	283,842.21	283,842.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	7.73	7.73
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	3,334,603.62	3,334,603.62
负债总计	-	-	-	-	-	22,801,647.93	22,801,647.93
利率	91,554,059.22	-	-	-	-	1,241,460,172.10	1,333,014,231.32

敏感度缺口							
上年度末 2022年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月 - 1年	1- 5年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	27,993,664.88	-	-	-	-	-	27,993,664.88
结算备付金	4,165,500.91	-	-	-	-	-	4,165,500.91
存出保证金	635,567.00	-	-	-	-	-	635,567.00
交易性金融资产	63,127,414.79	7,540,109.37	-	-	-	1,486,583,236.44	1,557,250,760.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	21,132,463.36	21,132,463.36
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	17,385.52	-	-	-	-	153,574.92	170,960.44
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	95,939,533.10	7,540,109.37	-	-	-	1,507,869,274.72	1,611,348,917.19
负债							
短	-	-	-	-	-	-	-

期借款							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	2,090,801.07	2,090,801.07
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,809,487.28	1,809,487.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,020,416.13	2,020,416.13
应付	-	-	-	-	-	336,736.02	336,736.02

托管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	7.98	7.98
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,690,082.39	2,690,082.39
负债总计	-	-	-	-	-	8,947,530.87	8,947,530.87
利率敏感	95,939,533.10	7,540,109.37	-	-	-	1,498,921,743.85	1,602,401,386.32

度 缺 口							
-------------	--	--	--	--	--	--	--

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	-	8,617.39
	基准利率增加 25 个基点	-	-8,613.55

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	

以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	245,151,947.47	-	245,151,947.47
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	245,151,947.47	-	245,151,947.47
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	245,151,947.47	-	245,151,947.47
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	617,033,398.67	-	617,033,398.67
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	617,033,398.67	-	617,033,398.67
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金	-	-	-	-

融负债				
衍生金融 负债	-	-	-	-
卖出回购 金融资产 款	-	-	-	-
应付清算 款	-	-	-	-
应付赎回 款	-	-	-	-
应付管理 人报酬	-	-	-	-
应付托管 费	-	-	-	-
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	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债 表外汇风 险敞口净 额	-	617,033,398.67	-	617,033,398.67

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	12,257,597.37	30,851,669.93
	港币相对人民币贬值 5%	-12,257,597.37	-30,851,669.93

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,181,245,258.53	88.61	1,486,583,236.44	92.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,943,774.46	0.15	70,667,524.16	4.41
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,183,189,032.99	88.76	1,557,250,760.60	97.18

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	76,837,119.46	104,414,506.13
	沪深 300 指数下跌 5%	-76,837,119.46	-104,414,506.13

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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日
第一层次	1,181,318,192.65
第二层次	404,401.74
第三层次	1,466,438.60
合计	1,183,189,032.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,181,245,258.53	87.12
	其中：股票	1,181,245,258.53	87.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,943,774.46	0.14
	其中：债券	1,943,774.46	0.14
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	88,650,639.61	6.54
8	其他各项资产	83,976,206.65	6.19
9	合计	1,355,815,879.25	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 245,151,947.47 元，占期末净值比例为 18.39%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	61,974.00	0.00
B	采矿业	108,390.77	0.01
C	制造业	712,355,102.37	53.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	557,518.73	0.04
E	建筑业	272,925.15	0.02
F	批发和零售业	1,504,169.92	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	121,618.05	0.01

H	住宿和餐饮业	117,119.70	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,764,960.21	5.46
J	金融业	235,643.55	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	35,996,794.90	2.70
M	科学研究和技术服务业	29,366,985.61	2.20
N	水利、环境和公共设施管理业	1,349,785.60	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,571.97	0.00
Q	卫生和社会工作	1,667,179.52	0.13
R	文化、体育和娱乐业	79,588,571.01	5.97
S	综合	-	-
	合计	936,093,311.06	70.22

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	66,597,220.92	5.00
30 日常消费	12,153,319.08	0.91
35 医疗保健	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	166,401,407.47	12.48
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	245,151,947.47	18.39

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控	326,800	99,912,096.02	7.50

		股			
2	003031	中瓷电 子	509,441	67,816,785.92	5.09
3	03690	美团一 w	590,620	66,597,220.92	5.00
4	01024	快手一 w	1,346,700	66,489,311.45	4.99
5	003021	兆威机 电	652,600	57,252,598.00	4.29
6	603198	迎驾贡 酒	844,100	53,853,580.00	4.04
7	600276	恒瑞医 药	1,123,680	53,824,272.00	4.04
8	300364	中文在 线	2,990,449	53,289,801.18	4.00
9	000568	泸州老 窖	253,923	53,214,643.11	3.99
10	300496	中科创 达	551,800	53,165,930.00	3.99
11	300893	松原股 份	1,609,120	41,402,657.60	3.11
12	000858	五 粮 液	243,900	39,894,723.00	2.99
13	300280	紫天科 技	753,000	35,970,810.00	2.70
14	688385	复旦微 电	670,981	33,616,148.10	2.52
15	688630	芯碁微 装	334,381	28,094,691.62	2.11
16	688515	裕太微 电子	161,825	27,778,879.50	2.08
17	300666	江丰电 子	405,800	27,578,168.00	2.07
18	300347	泰格医 药	417,806	26,965,199.24	2.02
19	300413	芒果超 媒	760,843	26,028,439.03	1.95
20	600559	老白干 酒	1,042,500	25,551,675.00	1.92
21	300068	南都电 源	1,037,300	20,082,128.00	1.51
22	600702	舍得酒 业	153,011	18,965,713.45	1.42

23	301018	申菱环境	522,882	18,818,523.18	1.41
24	000063	中兴通讯	320,000	14,572,800.00	1.09
25	002709	天赐材料	344,300	14,181,717.00	1.06
26	600633	浙数文化	855,700	13,870,897.00	1.04
27	603799	华友钴业	295,600	13,570,996.00	1.02
28	002068	黑猫股份	1,134,300	13,464,141.00	1.01
29	600085	同仁堂	230,300	13,256,068.00	0.99
30	002837	英维克	440,776	13,196,833.44	0.99
31	300474	景嘉微	145,436	13,087,785.64	0.98
32	603369	今世缘	240,126	12,678,652.80	0.95
33	06969	思摩尔国际	1,656,000	12,153,319.08	0.91
34	688387	中信科移动	106,186	886,653.10	0.07
35	301358	湖南裕能	19,730	866,107.54	0.06
36	688472	阿特斯阳光电力	47,508	865,975.56	0.06
37	688279	峰岷科技	5,505	726,660.00	0.05
38	688443	智翔金泰	23,136	711,847.88	0.05
39	688302	海创药业	13,082	694,915.84	0.05
40	688361	中科飞测	8,303	673,991.49	0.05
41	688425	铁建重工	135,282	650,706.42	0.05
42	301267	华夏眼科	10,052	612,669.40	0.05
43	688337	普源精电	9,713	585,305.38	0.04
44	301239	普瑞眼科	5,747	563,665.76	0.04
45	688295	中复神鹰碳纤	13,998	513,446.64	0.04

		维			
46	688110	东芯股份	14,044	506,988.40	0.04
47	688234	天岳先进	6,759	499,760.46	0.04
48	688375	国博电子	6,110	483,912.00	0.04
49	688503	聚和材料股份公司	4,850	472,875.00	0.04
50	688107	安路科技	7,821	433,205.19	0.03
51	688392	骄成超声波	3,843	426,534.57	0.03
52	688146	中船派瑞特气	10,101	422,147.43	0.03
53	688484	南芯科技	10,071	410,399.28	0.03
54	688400	凌云光技术	13,111	399,623.28	0.03
55	301175	中科环保	63,694	396,813.62	0.03
56	001286	陕西能源	37,667	391,397.47	0.03
57	688566	吉贝尔药业	9,882	385,496.82	0.03
58	001287	中电港	13,860	375,661.44	0.03
59	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.03
60	301162	国能日新	4,663	367,817.44	0.03
61	688372	伟测科技	2,383	364,956.45	0.03
62	601061	中信金属	40,154	347,732.92	0.03
63	688270	浙江臻镭科技股份有限公司	5,187	336,791.91	0.03
64	688147	微导纳米科技	6,293	332,144.54	0.02
65	301367	怡和嘉业	2,229	330,649.86	0.02
66	688739	成大生物	9,882	325,710.72	0.02

67	300687	赛意信息	11,700	325,026.00	0.02
68	688246	嘉和美康科技	7,719	323,194.53	0.02
69	688432	有研硅	20,044	314,490.36	0.02
70	688352	颀中科技	23,609	314,070.39	0.02
71	301109	军信股份	18,375	303,371.25	0.02
72	688053	思科瑞微电子	4,865	302,311.10	0.02
73	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.02
74	301391	卡莱特	2,470	289,409.90	0.02
75	688507	索辰科技	2,213	287,192.75	0.02
76	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.02
77	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.02
78	688170	德龙激光	6,175	276,454.75	0.02
79	688373	盟科药业	31,886	272,625.30	0.02
80	688502	茂莱光学	1,509	269,492.31	0.02
81	301268	铭利达	6,407	268,261.09	0.02
82	301263	泰恩康	12,263	256,051.44	0.02
83	688410	山外山血液净化	4,853	254,782.50	0.02
84	688073	毕得医药科技股份	3,562	252,118.36	0.02
85	301327	华宝新能	3,142	248,563.62	0.02
86	688539	高华科技	5,334	247,497.60	0.02
87	688336	三生国健	14,352	245,275.68	0.02
88	301311	昆船智能	8,320	245,273.60	0.02
89	301356	天振股份	11,038	241,732.20	0.02

90	688552	航天南湖	9,556	239,960.00	0.02
91	688496	清越科技	12,000	238,560.00	0.02
92	688212	澳华内镜	3,496	237,378.40	0.02
93	688162	巨一科技	5,671	235,233.08	0.02
94	688046	药康生物	12,070	234,037.30	0.02
95	688353	华盛锂电	6,319	233,676.62	0.02
96	301368	丰立智能	3,368	233,031.92	0.02
97	301286	侨源股份	7,839	231,250.50	0.02
98	301307	美利信	6,865	230,766.00	0.02
99	301389	隆扬电子	12,690	230,704.20	0.02
100	688230	芯导科技	5,085	230,401.35	0.02
101	301339	通行宝	9,127	229,361.51	0.02
102	688403	汇成股份	18,553	226,717.66	0.02
103	688231	隆达超合金股份	7,835	223,532.55	0.02
104	688276	长春百克生物科技	3,486	218,223.60	0.02
105	688351	微创电生理股份	10,946	213,118.62	0.02
106	301103	何氏眼科	5,065	212,527.40	0.02
107	688458	美芯晟科技	2,206	210,955.41	0.02
108	301366	一博科技	4,810	208,994.50	0.02
109	688486	龙迅股份	1,887	207,664.35	0.02
110	836077	吉林碳谷	9,957	203,421.51	0.02
111	688211	中科微	4,501	203,310.17	0.02

		至			
112	688581	安杰思 医学	1,629	198,809.23	0.01
113	301363	美好医 疗	4,447	195,623.53	0.01
114	688562	航天软 件股份	7,254	195,390.66	0.01
115	301185	鸥玛软 件	5,776	190,723.52	0.01
116	301262	海看股 份	6,917	190,389.75	0.01
117	301069	凯盛新 材	7,439	189,248.16	0.01
118	301091	深城交	10,218	189,237.36	0.01
119	688238	和元生 物	16,687	188,396.23	0.01
120	301317	鑫磊股 份	6,936	186,571.14	0.01
121	301383	天键股 份	4,925	183,366.76	0.01
122	301179	泽宇智 能	5,294	178,407.80	0.01
123	301377	鼎泰高 科	7,695	176,985.00	0.01
124	301399	英特科 技	2,925	171,714.01	0.01
125	301117	佳缘科 技	2,616	169,045.92	0.01
126	301439	泓淋电 力	9,486	168,338.18	0.01
127	688206	概伦电 子	6,000	168,240.00	0.01
128	688711	江苏宏 微科技	2,872	167,552.48	0.01
129	301123	奕东电 子	6,551	167,312.54	0.01
130	688459	哈铁科 技	17,259	166,376.76	0.01
131	301082	久盛电 气	9,144	165,049.20	0.01
132	301096	百诚医 药	2,714	164,495.54	0.01
133	688293	奥浦迈	3,433	163,651.11	0.01

		生物			
134	688152	麒麟信安	1,772	163,520.16	0.01
135	301139	元道通信	5,651	163,257.39	0.01
136	688084	晶品特装	1,875	162,881.25	0.01
137	688623	双元科技	1,776	162,256.88	0.01
138	301187	欧圣电气	8,759	161,778.73	0.01
139	688629	四川华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
140	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.01
141	688325	赛微微电子	4,039	157,722.95	0.01
142	301305	朗坤环境	7,523	155,710.27	0.01
143	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.01
144	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.01
145	301396	宏景科技	4,752	155,152.80	0.01
146	300834	星辉环材	6,349	154,915.60	0.01
147	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.01
148	688697	纽威数控装备	5,837	150,769.71	0.01
149	301280	珠城科技	4,175	149,298.00	0.01
150	300981	中红医疗	9,834	148,985.10	0.01
151	688376	美埃科技	3,713	146,626.37	0.01
152	688195	腾景科技	2,693	143,886.99	0.01
153	301093	华兰股份	4,088	141,444.80	0.01
154	688433	华曙高科	4,171	140,769.00	0.01
155	688677	青岛海泰新光	2,475	140,431.50	0.01

156	301335	天元宠物	5,869	139,916.96	0.01
157	301338	凯格精机	3,595	139,845.50	0.01
158	688237	超卓航科	2,891	139,577.48	0.01
159	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.01
160	688121	卓然技术	3,681	137,669.40	0.01
161	688426	康为世纪生物科技	4,531	136,836.20	0.01
162	688184	帕瓦股份	4,358	136,231.08	0.01
163	301212	联盛化学	4,158	136,132.92	0.01
164	301349	信德新材	2,697	135,227.58	0.01
165	688620	安凯微电子	10,157	135,209.66	0.01
166	688553	汇宇制药	8,928	133,295.04	0.01
167	688137	近岸蛋白	2,588	133,230.24	0.01
168	301235	华康医疗	4,178	132,943.96	0.01
169	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.01
170	688060	江苏云涌电子科技	2,400	132,240.00	0.01
171	688292	浩瀚深度信息技术	4,503	129,236.10	0.01
172	301277	新天地	6,576	128,297.76	0.01
173	301199	迈赫股份	4,014	127,805.76	0.01
174	301365	矩阵股份	7,740	127,400.40	0.01
175	603135	中重科技	6,273	126,392.92	0.01
176	688259	创耀通信科技	1,595	126,244.25	0.01
177	301345	涛涛车	2,652	126,242.30	0.01

		业			
178	688150	莱特光电股份	5,626	126,022.40	0.01
179	301088	戎美股份	7,036	125,733.32	0.01
180	688291	金橙子科技	3,961	125,405.26	0.01
181	688523	航天环宇科技	4,717	125,405.25	0.01
182	301379	天山电子	4,481	125,154.33	0.01
183	301052	果麦文化	2,520	124,286.40	0.01
184	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.01
185	301048	金鹰重工	8,424	117,683.28	0.01
186	301073	君亭酒店	3,222	117,119.70	0.01
187	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
188	601065	江西省盐业集团	8,748	116,094.39	0.01
189	688209	英集芯科技	6,822	111,335.04	0.01
190	301148	嘉戎技术	5,153	110,171.14	0.01
191	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
192	688257	新锐股份	4,059	107,604.09	0.01
193	688768	容知日新	1,342	107,185.54	0.01
194	301290	东星医疗	3,291	105,476.55	0.01
195	301313	凡拓数创	2,464	104,301.12	0.01
196	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
197	688479	用友汽车信息科技	3,318	103,760.10	0.01
198	301355	南王科	5,624	99,516.05	0.01

		技			
199	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.01
200	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.01
201	301306	西测测试	2,543	98,795.55	0.01
202	301136	招标股份	7,172	98,399.84	0.01
203	601133	柏诚系统股份公司	6,632	97,123.52	0.01
204	688173	希荻微电子	4,236	96,919.68	0.01
205	688535	华海诚科新材料	1,607	96,642.01	0.01
206	301398	星源卓镁	2,549	95,587.50	0.01
207	300973	立高食品	1,393	95,309.06	0.01
208	301265	华新环保	8,181	95,063.22	0.01
209	688143	长盈通光电	2,519	94,966.30	0.01
210	301176	逸豪新材	5,431	93,304.58	0.01
211	688420	天津美腾科技	2,408	93,261.84	0.01
212	301135	瑞德智能	3,376	92,569.92	0.01
213	301231	荣信文化	2,744	92,308.16	0.01
214	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
215	301196	唯科科技	2,705	91,834.75	0.01
216	301197	工大科雅	3,791	91,363.10	0.01
217	301373	凌玮科技	2,764	89,376.38	0.01
218	301116	益客食品	5,764	88,765.60	0.01
219	301126	达嘉维	6,615	88,641.00	0.01

		康			
220	301281	科源制药	3,367	88,390.10	0.01
221	688737	中自科技	2,186	85,232.14	0.01
222	301092	争光股份	3,230	84,561.40	0.01
223	301118	恒光股份	3,142	83,985.66	0.01
224	301157	华塑科技	1,498	83,481.42	0.01
225	688115	思林杰科技	2,153	83,170.39	0.01
226	301283	聚胶股份	2,344	83,165.12	0.01
227	301316	慧博云通	3,584	81,894.40	0.01
228	301285	鸿日达	5,643	81,767.07	0.01
229	301028	东亚机械	7,329	81,718.35	0.01
230	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.01
231	300930	屹通新材	3,220	80,339.00	0.01
232	601059	信达证券	5,628	80,255.28	0.01
233	688307	中润光学	2,455	80,253.95	0.01
234	301203	国泰环保	2,243	79,964.22	0.01
235	301161	唯万密封	3,460	79,960.60	0.01
236	300814	中富电路	3,280	79,015.20	0.01
237	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
238	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.01
239	301227	森鹰窗业	2,840	78,753.20	0.01
240	301388	欣灵电气	2,920	78,402.00	0.01
241	688255	凯尔达	2,309	78,182.74	0.01

		机器人			
242	300994	久祺股份	5,034	77,724.96	0.01
243	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.01
244	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
245	688480	赛恩斯环保	2,302	71,269.92	0.01
246	301041	金百泽	2,150	71,208.00	0.01
247	688193	仁度生物	1,635	70,435.80	0.01
248	301260	格力博	2,935	69,354.05	0.01
249	301011	华立科技	2,958	69,305.94	0.01
250	301319	唯特偶	1,149	68,767.65	0.01
251	301233	盛帮股份	1,576	68,193.52	0.01
252	688448	南京磁谷科技	1,985	67,946.55	0.01
253	688113	联测科技	1,415	67,750.20	0.01
254	688071	华依科技集团	1,101	67,326.15	0.01
255	601136	首创证券	4,739	67,151.63	0.01
256	301300	远翔新材	2,107	66,581.20	0.00
257	301165	锐捷网络	1,077	66,472.44	0.00
258	001301	尚太科技	1,164	65,544.84	0.00
259	688517	金冠电气	2,892	63,508.32	0.00
260	301038	深水规院	3,458	62,555.22	0.00
261	301309	万得凯	2,271	62,543.34	0.00
262	688226	威腾电气集团股份	2,693	58,761.26	0.00
263	001269	欧晶科技	764	56,176.92	0.00
264	301098	金埔园	4,603	55,466.15	0.00

		林			
265	301062	上海艾录	5,225	55,332.75	0.00
266	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.00
267	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.00
268	688718	唯赛勃科技	3,145	54,439.95	0.00
269	300774	倍杰特	4,435	51,623.40	0.00
270	688501	青岛达能环保	2,287	50,885.75	0.00
271	301201	诚达药业	1,225	50,470.00	0.00
272	688328	深科达智能装备	1,499	50,186.52	0.00
273	301068	大地海洋	1,436	48,263.96	0.00
274	301033	迈普医学	1,076	47,300.96	0.00
275	301007	德迈仕	3,022	46,629.46	0.00
276	001328	登康口腔	1,445	46,323.05	0.00
277	301032	新柴股份	5,124	45,859.80	0.00
278	300910	瑞丰新材	901	45,320.30	0.00
279	301072	中捷精工	1,802	45,140.10	0.00
280	300979	华利集团	925	45,084.50	0.00
281	605376	博迁新材	1,421	44,590.98	0.00
282	301010	晶雪节能	2,172	44,069.88	0.00
283	688395	深圳正弦电气股份	1,627	43,261.93	0.00
284	301049	超越科技	1,954	43,183.40	0.00
285	688622	禾信仪器	1,204	42,742.00	0.00

286	301063	海锅股份	1,524	42,458.64	0.00
287	300750	宁德时代	180	41,182.20	0.00
288	600916	中国黄金	3,371	39,811.51	0.00
289	301053	远信工业	1,544	39,171.28	0.00
290	688296	和达科技	2,173	38,788.05	0.00
291	301079	邵阳液压	1,815	38,695.80	0.00
292	301036	双乐股份	2,047	38,340.31	0.00
293	301037	保立佳	2,115	37,689.30	0.00
294	301057	汇隆新材	2,173	37,462.52	0.00
295	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.00
296	001311	多利科技	649	37,272.07	0.00
297	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
298	605009	豪悦护理	741	35,568.00	0.00
299	605090	九丰能源	1,526	34,075.58	0.00
300	300929	华骐环保	2,923	33,117.59	0.00
301	600955	维远股份	1,694	32,914.42	0.00
302	300854	中兰环保	2,026	32,213.40	0.00
303	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
304	688038	武汉中科通达	2,132	31,894.72	0.00
305	605186	健麾信息	626	30,987.00	0.00
306	605020	永和股份	1,190	30,713.90	0.00
307	688681	科汇电力自动化	1,899	30,687.84	0.00

308	301177	迪阿股份	792	30,436.56	0.00
309	001338	永顺泰	1,649	30,407.56	0.00
310	688367	工大高科	1,717	30,356.56	0.00
311	001258	立新能源	3,188	30,254.12	0.00
312	600927	永安期货	1,859	30,227.34	0.00
313	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.00
314	688670	金迪克生物	637	29,989.96	0.00
315	605598	上海港湾	553	29,120.98	0.00
316	300870	欧陆通	478	28,646.54	0.00
317	601089	福元医药	1,749	28,508.70	0.00
318	688067	爱威科技	1,259	27,698.00	0.00
319	603324	盛剑环境	733	27,634.10	0.00
320	601921	浙版传媒	3,154	27,408.26	0.00
321	301039	中集车辆	2,064	27,306.72	0.00
322	601156	东航物流	2,090	27,170.00	0.00
323	603071	物产环能	1,627	26,991.93	0.00
324	300887	谱尼测试	680	26,914.40	0.00
325	001322	箭牌家居	1,595	26,700.30	0.00
326	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.00
327	605337	李子园	1,434	26,213.52	0.00
328	300867	圣元环保	1,498	26,110.14	0.00
329	001213	中铁特货	5,818	25,657.38	0.00
330	605507	国邦医药	1,202	25,566.54	0.00

331	603171	税友股份	637	25,467.26	0.00
332	603255	鼎际得股份	488	24,770.88	0.00
333	001367	海森药业	549	24,687.92	0.00
334	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.00
335	300872	天阳科技	1,568	24,366.72	0.00
336	605060	联德股份	883	24,247.18	0.00
337	001339	智微智能	812	24,092.04	0.00
338	605167	利柏特	2,471	23,919.28	0.00
339	688272	*ST 富吉瑞光电	1,263	23,820.18	0.00
340	001308	康冠科技	867	23,807.82	0.00
341	603211	晋拓科技股份	1,286	23,636.68	0.00
342	003029	吉大正元	716	23,234.20	0.00
343	001227	兰州银行	7,868	22,502.48	0.00
344	603191	望变电气	1,149	22,348.05	0.00
345	605016	百龙创园	872	21,590.72	0.00
346	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.00
347	001236	弘业期货	1,399	21,446.67	0.00
348	603206	嘉环科技	1,210	20,872.50	0.00
349	601022	宁波远洋	1,983	20,603.37	0.00
350	605089	味知香	511	20,082.30	0.00
351	003040	楚天龙	1,101	19,972.14	0.00
352	300869	康泰医学	862	19,791.52	0.00
353	001215	千味央厨	295	19,614.55	0.00

354	001323	慕思股份	573	19,459.08	0.00
355	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.00
356	301058	中粮科工	1,386	19,334.70	0.00
357	001201	东瑞股份	802	19,320.18	0.00
358	300982	苏文电能	317	19,197.52	0.00
359	003038	鑫铂股份	460	19,071.60	0.00
360	300972	万辰生物	430	19,066.20	0.00
361	605377	华旺科技	1,050	18,952.50	0.00
362	605011	杭州热电	525	18,574.50	0.00
363	605289	罗曼股份	474	18,158.94	0.00
364	003026	中晶科技	461	18,131.13	0.00
365	003028	振邦智能	432	18,061.92	0.00
366	600935	华塑股份	4,811	18,041.25	0.00
367	603122	合富中国	2,198	18,023.60	0.00
368	603235	天新药业	572	17,937.92	0.00
369	605305	中际联合	508	17,708.88	0.00
370	603173	福斯达深冷	588	17,316.60	0.00
371	605286	同力日升	597	17,265.24	0.00
372	605339	南侨食品	864	17,202.24	0.00
373	001205	盛航股份	808	17,145.76	0.00
374	605268	王力安防	1,642	16,797.66	0.00
375	001208	华菱线缆	1,754	16,627.92	0.00

376	300996	普联软件	539	16,547.30	0.00
377	300878	维康药业	722	16,389.40	0.00
378	605098	行动教育	405	16,033.95	0.00
379	605296	神农集团	740	15,850.80	0.00
380	603282	亚光科技股份	457	15,771.07	0.00
381	605068	明新旭腾	641	15,678.86	0.00
382	003037	三和管桩	1,274	15,670.20	0.00
383	605277	新亚电子	966	15,610.56	0.00
384	003019	宸展光电	760	15,580.00	0.00
385	001216	华瓷股份	1,178	15,502.48	0.00
386	001318	阳光乳业	1,142	15,451.26	0.00
387	300909	汇创达	579	15,297.18	0.00
388	300871	回盛生物	927	15,276.96	0.00
389	603759	海天股份	1,656	15,168.96	0.00
390	605162	新中港	1,377	14,802.75	0.00
391	001228	永泰运	383	14,718.69	0.00
392	603230	内蒙新华	1,140	14,706.00	0.00
393	003025	思进智能	898	14,502.70	0.00
394	001298	好上好	584	14,454.00	0.00
395	001217	华尔泰	1,239	14,421.96	0.00
396	603190	烟台亚通精工机械	470	14,382.00	0.00
397	605389	长龄液压	498	14,377.26	0.00
398	605208	永茂泰	1,405	14,078.10	0.00
399	601528	瑞丰银行	2,899	14,060.15	0.00

400	300884	狄耐克	1,047	13,862.28	0.00
401	603237	五芳斋 实业	455	13,800.15	0.00
402	603057	上海紫 燕食品	549	13,796.37	0.00
403	300997	欢乐家	928	13,520.96	0.00
404	605183	确成股 份	741	13,412.10	0.00
405	605169	洪通燃 气	1,292	13,268.84	0.00
406	605056	咸亨国 际	933	13,220.61	0.00
407	603162	海通发 展	774	13,196.70	0.00
408	605151	西上海	723	13,158.60	0.00
409	603153	上海建 科集团	740	13,135.00	0.00
410	603097	江苏华 辰	577	13,074.82	0.00
411	605599	菜百股 份	980	12,945.80	0.00
412	300908	仲景食 品	285	12,924.75	0.00
413	301015	百洋医 药	462	12,825.12	0.00
414	603051	鹿山新 材	272	12,737.76	0.00
415	605300	佳禾食 品	576	12,522.24	0.00
416	605580	恒盛能 源	916	12,356.84	0.00
417	603176	汇通集 团	1,924	12,313.60	0.00
418	300962	中金辐 照	657	12,285.90	0.00
419	605319	无锡振 华	764	12,124.68	0.00
420	605500	森林包 装	1,579	11,779.34	0.00
421	300911	亿田智 能	309	11,732.73	0.00
422	003030	祖名股 份	480	11,587.20	0.00

423	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.00
424	603170	宝立食品科技	542	11,522.92	0.00
425	301180	万祥科技	654	11,464.62	0.00
426	605259	绿田机械	295	11,451.90	0.00
427	001207	联科科技	682	11,403.04	0.00
428	003042	中农联合	546	11,313.12	0.00
429	603836	海程邦达	733	11,266.21	0.00
430	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
431	001319	铭科精技	536	11,234.56	0.00
432	601279	英利汽车	2,004	11,102.16	0.00
433	300898	熊猫乳品	496	11,100.48	0.00
434	001218	丽臣实业	490	11,078.90	0.00
435	001317	三羊马	300	11,070.00	0.00
436	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
437	605378	野马电池	473	11,025.63	0.00
438	300993	玉马遮阳	959	10,980.55	0.00
439	003027	同兴环保	523	10,904.55	0.00
440	603130	云中马股份	480	10,900.80	0.00
441	605177	东亚药业	439	10,816.96	0.00
442	301017	漱玉平民	555	10,567.20	0.00
443	003033	征和工业	301	10,565.10	0.00
444	603216	梦天家居	772	10,522.36	0.00

445	003036	泰坦股份	776	10,460.48	0.00
446	300891	惠云钛业	1,143	10,447.02	0.00
447	605122	四方新材	703	10,432.52	0.00
448	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
449	300986	志特新材	370	10,360.00	0.00
450	300968	格林精密	1,162	10,330.18	0.00
451	605179	一鸣食品	939	10,216.32	0.00
452	001288	运机集团	537	10,149.30	0.00
453	301013	利和兴	706	10,095.80	0.00
454	300877	金春股份	569	10,037.16	0.00
455	605005	合兴股份	634	10,036.22	0.00
456	605566	福莱茵特	435	10,005.00	0.00
457	605136	丽人丽妆	867	9,996.51	0.00
458	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
459	003018	金富科技	1,027	9,931.09	0.00
460	001212	中旗新材	400	9,876.00	0.00
461	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
462	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
463	605365	立达信	645	9,662.10	0.00
464	603213	镇洋发展	799	9,532.07	0.00
465	603511	爱慕股份	553	9,511.60	0.00
466	001268	联合精密	409	9,492.89	0.00
467	301046	能辉科技	290	9,483.00	0.00

468	605488	福莱新材	603	9,461.07	0.00
469	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
470	605299	舒华体育	738	9,372.60	0.00
471	001206	依依股份	629	9,309.20	0.00
472	605086	龙高股份	443	9,205.54	0.00
473	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.00
474	001222	源飞宠物	607	9,183.91	0.00
475	300876	蒙泰高新	350	9,117.50	0.00
476	605007	五洲特纸	598	9,065.68	0.00
477	300614	百川畅银	329	9,011.31	0.00
478	603280	南方路面机械	363	8,922.54	0.00
479	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
480	300879	大叶股份	466	8,867.98	0.00
481	003004	声迅股份	306	8,834.22	0.00
482	605258	协和电子	340	8,833.20	0.00
483	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
484	603151	邦基科技股份	535	8,741.90	0.00
485	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
486	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
487	301078	孩子王	756	8,641.08	0.00
488	300933	中辰股份	1,112	8,562.40	0.00
489	003032	传智教育	586	8,538.02	0.00

490	001296	长江材料	403	8,467.03	0.00
491	001231	农心科技	355	8,445.45	0.00
492	001219	青岛食品	460	8,390.40	0.00
493	001210	金房能源	373	8,377.58	0.00
494	605196	华通线缆	1,172	8,344.64	0.00
495	605189	富春染织	507	8,319.87	0.00
496	605287	德才股份	349	8,271.30	0.00
497	603182	嘉华生物科技股份有限公司	546	8,255.52	0.00
498	605298	必得科技	508	8,107.68	0.00
499	605567	春雪食品	629	8,070.07	0.00
500	605180	华生科技	649	8,028.13	0.00
501	001209	洪兴股份	450	8,014.50	0.00
502	003041	真爱美家	503	7,977.58	0.00
503	605033	美邦股份	423	7,910.10	0.00
504	003023	彩虹集团	385	7,896.35	0.00
505	300967	晓鸣股份	507	7,736.82	0.00
506	300952	恒辉安防	340	7,670.40	0.00
507	001336	楚环科技	274	7,666.52	0.00
508	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.00
509	300945	曼卡龙	474	7,356.48	0.00
510	301026	浩通科技	203	7,251.16	0.00
511	300889	爱克股份	479	7,170.63	0.00

512	605155	西大门	490	7,109.90	0.00
513	300950	德固特	328	6,953.60	0.00
514	605069	正和生态	790	6,912.50	0.00
515	605055	迎丰股份	1,146	6,830.16	0.00
516	300991	创益通	406	6,824.86	0.00
517	001202	炬申股份	459	6,774.84	0.00
518	605303	园林股份	610	6,771.00	0.00
519	605577	龙版传媒	588	6,697.32	0.00
520	603150	万朗磁塑	250	6,590.00	0.00
521	300943	春晖智控	382	6,478.72	0.00
522	300971	博亚精工	245	6,431.25	0.00
523	300966	共同药业	286	6,392.10	0.00
524	605138	盛泰集团	723	6,304.56	0.00
525	300892	品渥食品	272	6,228.80	0.00
526	301012	扬电科技	238	6,152.30	0.00
527	300942	易瑞生物	443	5,533.07	0.00
528	301016	雷尔伟	275	5,516.50	0.00
529	300958	建工修复	300	5,322.00	0.00
530	301055	张小泉	355	5,051.65	0.00
531	300955	嘉亨家化	232	4,941.60	0.00
532	301025	读客文化	403	4,924.66	0.00
533	300948	冠中生态	324	4,895.64	0.00
534	300992	泰福泵业	200	4,024.00	0.00
535	300995	奇德新材	191	3,896.40	0.00

536	301027	华蓝集团	286	3,514.94	0.00
537	000538	云南白药	55	2,886.40	0.00
538	600031	三一重工	100	1,663.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300413	芒果超媒	216,676,610.35	13.52
2	000568	泸州老窖	161,728,872.00	10.09
3	01024	快手-W	133,528,872.94	8.33
4	002027	分众传媒	129,470,007.40	8.08
5	600702	舍得酒业	128,588,072.62	8.02
6	300068	南都电源	117,276,825.93	7.32
7	000858	五粮液	109,956,468.00	6.86
8	000063	中兴通讯	102,508,975.72	6.40
9	300820	英杰电气	97,817,990.49	6.10
10	002463	沪电股份	96,622,151.07	6.03
11	300474	景嘉微	94,193,263.86	5.88
12	003031	中瓷电子	92,092,290.80	5.75
13	688630	芯碁微装	87,272,712.78	5.45
14	000681	视觉中国	85,577,149.72	5.34
15	688385	复旦微电	83,635,489.18	5.22
16	002351	漫步者	83,237,677.86	5.19
17	03690	美团-W	83,195,882.59	5.19
18	300347	泰格医药	82,983,852.12	5.18
19	300666	江丰电子	82,597,767.95	5.15
20	300571	平治信息	80,951,132.00	5.05
21	002236	大华股份	78,013,739.00	4.87
22	300418	昆仑万维	77,548,079.82	4.84
23	00700	腾讯控股	75,546,919.11	4.71
24	300459	汤姆猫	67,341,958.88	4.20
25	600872	中炬高新	67,052,897.00	4.18
26	300624	万兴科技	66,722,617.80	4.16
27	600276	恒瑞医药	65,809,699.16	4.11
28	003021	兆威机电	65,768,527.00	4.10

29	300496	中科创达	61,217,720.07	3.82
30	603198	迎驾贡酒	61,182,524.14	3.82
31	603983	丸美股份	60,185,051.00	3.76
32	300364	中文在线	57,760,853.51	3.60
33	000034	神州数码	57,734,551.00	3.60
34	002709	天赐材料	52,288,622.00	3.26
35	300604	长川科技	51,898,277.85	3.24
36	600559	老白干酒	51,299,609.98	3.20
37	688153	唯捷创芯	49,349,099.49	3.08
38	301165	锐捷网络	45,441,352.13	2.84
39	603369	今世缘	44,184,277.00	2.76
40	688008	澜起科技	44,145,001.76	2.75
41	603799	华友钴业	43,790,255.48	2.73
42	600602	云赛智联	43,379,255.67	2.71
43	300280	紫天科技	42,589,611.00	2.66
44	605117	德业股份	42,215,666.00	2.63
45	300893	松原股份	42,064,854.67	2.63
46	300763	锦浪科技	41,881,940.44	2.61
47	688363	华熙生物	41,587,724.15	2.60
48	600475	华光环能	41,507,716.41	2.59
49	002291	遥望科技	38,701,166.80	2.42
50	603222	济民医疗	38,115,396.80	2.38
51	603868	飞科电器	36,488,297.96	2.28
52	688515	裕太微电子	35,261,456.15	2.20
53	002534	西子洁能	32,533,786.10	2.03

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	000568	泸州老窖	208,191,109.35	12.99
2	300413	芒果超媒	182,286,798.19	11.38
3	01024	快手-W	175,032,112.72	10.92
4	688363	华熙生物	172,244,095.12	10.75
5	000858	五粮液	135,838,528.09	8.48
6	002027	分众传媒	127,057,930.60	7.93
7	00388	香港交易所	121,478,182.88	7.58

8	300418	昆仑万维	120,147,585.19	7.50
9	002463	沪电股份	110,714,021.13	6.91
10	600702	舍得酒业	103,369,796.40	6.45
11	600809	山西汾酒	100,274,071.72	6.26
12	002351	漫步者	97,448,347.87	6.08
13	02331	李宁	96,023,571.66	5.99
14	300820	英杰电气	94,759,020.72	5.91
15	000063	中兴通讯	92,258,238.38	5.76
16	03690	美团-W	91,936,125.34	5.74
17	002236	大华股份	90,221,921.00	5.63
18	00700	腾讯控股	87,012,804.07	5.43
19	000681	视觉中国	85,141,702.35	5.31
20	300624	万兴科技	80,994,207.96	5.05
21	300068	南都电源	80,563,161.00	5.03
22	001330	博纳影业	76,721,469.29	4.79
23	300459	汤姆猫	73,367,710.59	4.58
24	300474	景嘉微	68,496,149.07	4.27
25	600872	中炬高新	64,502,358.38	4.03
26	300571	平治信息	63,449,387.00	3.96
27	688630	芯碁微装	63,002,904.14	3.93
28	603589	口子窖	62,197,743.12	3.88
29	000034	神州数码	58,522,705.20	3.65
30	603983	丸美股份	57,745,467.90	3.60
31	301165	锐捷网络	57,709,853.33	3.60
32	300666	江丰电子	55,888,666.10	3.49
33	688153	唯捷创芯	54,556,082.68	3.40
34	600519	贵州茅台	51,134,290.01	3.19
35	300604	长川科技	49,697,881.46	3.10
36	00175	吉利汽车	48,570,214.69	3.03
37	002304	洋河股份	45,852,265.00	2.86
38	688008	澜起科技	43,296,225.18	2.70
39	600602	云赛智联	42,705,151.05	2.67
40	688390	固德威电 源	42,474,160.73	2.65
41	600475	华光环能	42,233,306.48	2.64
42	300015	爱尔眼科	40,914,512.40	2.55
43	300750	宁德时代	40,007,429.00	2.50
44	605117	德业股份	39,786,735.21	2.48
45	003031	中瓷电子	38,499,344.44	2.40
46	300763	锦浪科技	35,826,580.05	2.24
47	603868	飞科电器	35,312,235.60	2.20
48	002709	天赐材料	35,000,153.83	2.18
49	603222	济民医疗	34,527,085.66	2.15

50	002594	比亚迪	32,697,078.41	2.04
51	688141	杰华特微电子	32,067,190.33	2.00

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,309,082,526.14
卖出股票收入（成交）总额	4,485,515,956.42

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,943,774.46	0.15
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,943,774.46	0.15

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113652	伟 22 转债	18,200	1,943,774.46	0.15

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	951,673.58
2	应收清算款	82,970,429.73
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,103.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,976,206.65

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	------	---------

				比例（%）
1	113652	伟 22 转债	1,943,774.46	0.15

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
124,205	13,105.19	13,513,232.02	0.83	1,614,216,854.55	99.17

8.2 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	狄堃	4,274,688.00	5.26
2	邵常红	2,022,860.00	2.49
3	欧静虹	1,074,800.00	1.32
4	洪维初	1,063,719.00	1.31
5	巢瑾	1,000,000.00	1.23
6	冯月蓉	1,000,000.00	1.23
7	万里	847,800.00	1.04
8	王昭晶	665,245.00	0.82
9	朱洁瑛	653,300.00	0.80
10	朱杰	586,500.00	0.72

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

8.3 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	1,296,158.32	0.08

8.4 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 08 月 03 日）基金份额总额	14,436,240,692.05
本报告期期初基金份额总额	1,768,213,346.34
本报告期基金总申购份额	14,284,442.91
减：本报告期基金总赎回份额	154,767,702.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,627,730,086.57

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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形。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	1,910,124,483.28	21.75	1,403,491.38	21.89	
中泰证券	1	1,761,261,594.34	20.06	1,284,351.19	20.03	
东方证券	4	999,380,633.43	11.38	727,392.50	11.35	
国海证券	2	832,714,153.20	9.48	615,966.78	9.61	
中信建投证券	1	538,289,289.49	6.13	388,267.55	6.06	
长江证券	1	514,525,039.18	5.86	371,120.31	5.79	
国泰君安	1	431,559,751.63	4.91	313,518.65	4.89	

瑞银证券	2	422,302,775.35	4.81	304,599.15	4.75	
平安证券	1	421,046,758.59	4.79	313,886.79	4.90	
信达证券	1	318,836,673.11	3.63	229,976.23	3.59	
国信证券	2	186,268,306.15	2.12	136,703.52	2.13	
海通证券	1	124,934,614.68	1.42	90,115.52	1.41	
申万宏源证券	1	92,312,013.03	1.05	66,583.26	1.04	
东吴证券	1	84,877,677.80	0.97	61,221.53	0.95	
中银国际	1	73,897,458.94	0.84	53,301.39	0.83	
兴业证券	1	60,522,774.40	0.69	43,653.31	0.68	
长城证券	2	9,150,648.00	0.10	6,599.90	0.10	
东北证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
恒泰证券	2	-	-	-	-	
华西证券	1	-	-	-	-	
太平洋证券	2	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中信证券	2	-	-	-	-	

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。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	2,215,868.04	100.00	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

助及时催缴。

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 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	关于汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）非港股通交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 17 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
3	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
5	关于汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）非港股通交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 04 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
7	关于汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）非港股通交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）募集的文件；

2、《汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。

12.2 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

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日