

汇添富红利增长混合型证券投资基金 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	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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	59
7.1 期末基金资产组合情况	59
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
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	60
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69
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	69
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	69

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
7.12 投资组合报告附注.....	70
§ 8 基金份额持有人信息.....	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	71
§ 9 开放式基金份额变动.....	72
§ 10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
10.8 其他重大事件	78
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
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.....	78
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§ 12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录	78
12.2 存放地点	79
12.3 查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富红利增长混合型证券投资基金	
基金简称	添富红利增长混合	
基金主代码	006259	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 04 月 26 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）	642,052,467.44	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	添富红利增长混合 A	添富红利增长混合 C
下属分级基金的交易代码	006259	006260
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	543,438,999.60	98,613,467.84

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，重点投资于具有持续分红能力且估值相对合理的优质上市公司，力争实现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和个股精选策略。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；个股精选策略主要用于挖掘股票市场中具有持续分红能力且估值合理的优质上市公司。本基金的投资策略还包括：债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、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、权证投资策略、融资投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中证红利指数收益率*60%+中证港股通高股息投资指数收益率*20%+中债综合指数收益率*20%
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。 本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 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	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
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	《证券时报》
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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路728号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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)	
	添富红利增长混合 A	添富红利增长混合 C
本期已实现收益	-68,770,136.08	-12,111,583.22
本期利润	-51,822,633.25	-10,475,253.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0825	-0.1007
本期加权平均净值利润率	-5.60%	-7.08%
本期基金份额净值增	-6.80%	-7.17%

长率		
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	217,202,034.19	34,712,102.69
期末可供分配基金份额利润	0.3997	0.3520
期末基金资产净值	760,641,033.79	133,325,570.53
期末基金份额净值	1.3997	1.3520
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	39.97%	35.20%

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

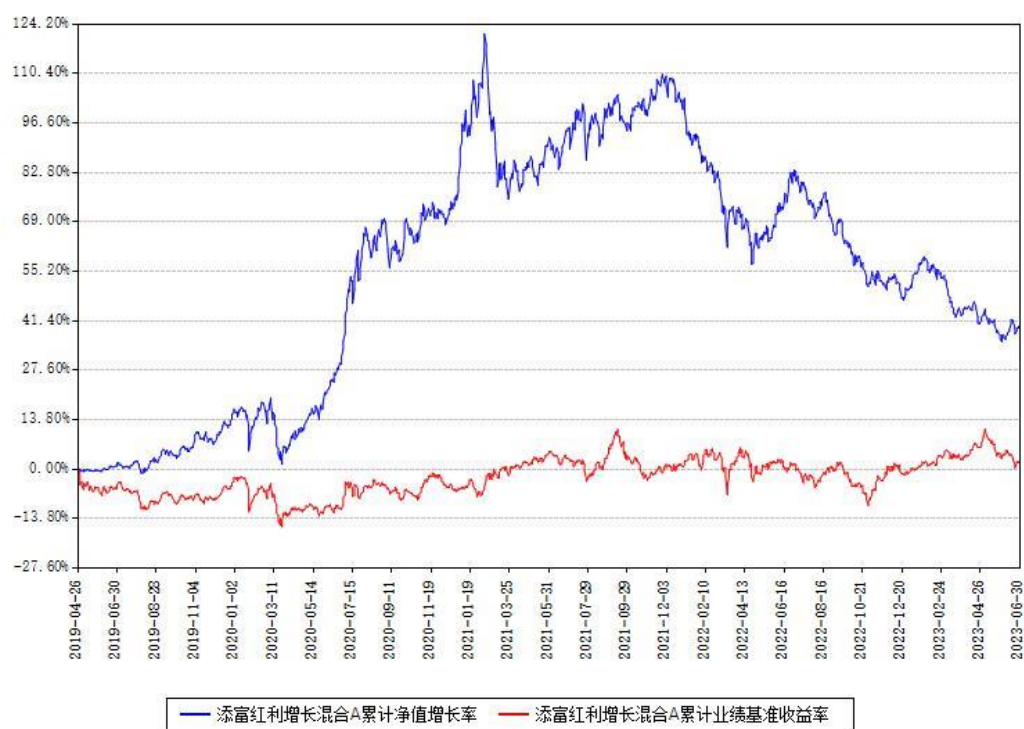
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

添富红利增长混合 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.70%	0.68%	-1.11%	0.64%	3.81%	0.04%
过去三个月	-3.30%	0.67%	-1.19%	0.70%	-2.11%	-0.03%
过去六个月	-6.80%	0.69%	3.13%	0.64%	-9.93%	0.05%
过去一年	-23.45%	0.77%	0.89%	0.78%	-24.34%	-0.01%
过去三年	6.55%	1.18%	14.67%	0.88%	-8.12%	0.30%
自基金合同生	39.97%	1.14%	2.19%	0.90%	37.78%	0.24%

效日起 至今						
添富红利增长混合 C						
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去一 个月	2.63%	0.68%	-1.11%	0.64%	3.74%	0.04%
过去三 个月	-3.49%	0.67%	-1.19%	0.70%	-2.30%	-0.03%
过去六 个月	-7.17%	0.69%	3.13%	0.64%	-10.30%	0.05%
过去一 年	-24.06%	0.77%	0.89%	0.78%	-24.95%	-0.01%
过去三 年	4.02%	1.18%	14.67%	0.88%	-10.65%	0.30%
自基金 合同生 效日起 至今	35.20%	1.14%	2.19%	0.90%	33.01%	0.24%

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

添富红利增长混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富红利增长混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019 年 04 月 26 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。

§ 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		
黄耀锋	本基金的基金经理	2019 年 04 月 26 日		12	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：曾任职于瑞银证券、平安证券研究所，从事金融行

					业研究。2016 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司，任策略及金融、周期行业高级研究员。2019 年 4 月 26 日至今任汇添富红利增长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 27 日至今任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 12 日至今任汇添富上证 50 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 29 日至今任汇添富多元价值发现混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 27 日至今任汇添富研究优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
劳杰男	本基金的基金经理	2019 年 04 月 26 日		13	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：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，曾任研究总监。2015 年 7 月 10 日至

					2018 年 3 月 1 日任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 11 月 18 日至今任汇添富价值精选混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 2 月 13 日至 2019 年 2 月 22 日任汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 31 日至今任汇添富研究优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 4 月 26 日至今任汇添富红利增长混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 22 日至今任汇添富开放视野中国优势六个月持有期股票型证券投资基金的基金经理。2020 年 10 月 13 日至今任汇添富创新未来混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

本基金是混合型基金,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,重点投资于具有持续分红能力且估值相对合理的优质上市公司。力争实现基金资产的中长期稳健增值。回顾 2023 年上半年,经济进入疫后修复,但在政策保持定力的情况下,经济修复一波三折。在经济持续磨底、预期不稳定的环境下,资金存在分歧,行业持续轮动导致市场赚钱效应较弱。3 月后的稳增长政策预期下滑,高频数据修复的斜率放缓,市场总体进入震荡期,红利类、顺经济类资产超额收益放缓。但受益于大方向的经济修复和新一轮国改浪潮中“中字头”估值重估的推动,红利风格在一季度表现较好,波动较低。4 月份红利类资产在“中特估”概念加持下表现较好,而 5 月以来在国内经济进一步走弱、海外风险因素扰动下,顺周期板块大幅回落,红利指数也有所调整。整体二季度在经济走弱大背景下,新旧动能切换的矛盾显现,市场风险偏好再度回落。红利风格有一定防御性,但整体弱贝塔也造成了一些回撤。在这样的背景下,一季度市场情绪有所反弹,本基金适度提高了组合仓位,结构上适当增配了出行运输链以及基建链相关优质品种。二季度考虑到稳增长预期有所回落,本基金适度降低了组合仓位,结构上适当增配了低估、低配的央企优质品种。展望 2023 年下半年,预计仍有必要性的刺激政策支持,推动国内经济持续修复,同时美国衰退风险进一步下降,软着陆概率抬升,风险偏好将显著回升。考虑估值、情绪、交易面、重点龙头估值隐含的增速预期等多重因素,当前市场处于基本面底部位置,可积极布局参与。另一方面,宽裕的货币环境仍将形成有力支撑。在风格方面,后续随着利率下行空间有限、经济持续修复,红利策略上行空间打开,具有较强的配置性价比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期添富红利增长混合 A 类份额净值增长率为-6.80%,同期业绩比较基准收益率为 3.13%。本报告期添富红利增长混合 C 类份额净值增长率为-7.17%,同期业绩比较基准收益率为 3.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2023 年上半年,国内经济内生修复动能不足,内需疲弱、外需有韧性,通胀处于低位,流动性保持充裕,权益市场整体震荡,行业轮动加速导致赚钱效应弱。预计下半年流动性环境继续对估值形成支撑,经济维持弱复苏,利率下行空间有限。上半年来看,海外经济有韧性,美联储继续加息,居民收入预期下降、企业经营信心修复不足、地产尚未进入良

性循环，出口有结构性支撑。展望下半年，消费有较大修复空间，但有待居民收入改善，出口在海外周期性下行的背景下或继续走弱，投资端依然是主要支撑。整体上，我们预计经济继续修复，但幅度相对有限。通胀方面，在内需趋弱、外需仍有较大不确定性的情形下，预计价格指数全年将维持低位。稳增长诉求下，财政仍有发力的必要。海外高通胀风险或明显缓和，美联储逐步暂停加息，对国内资产价格的压制有所放缓。宏观经济的风险主要包括：1) 海外金融系统风险蔓延，导致国内权益风险偏好下降。2) 地产投资进一步下滑导致内需偏弱。资本市场方面，今年整体经济磨底，高质量发展下展现韧性，经济复苏的深度、广度兼具，对估值底部形成支撑。上半年 A 股市场在经济磨底环境下，风险偏好下降、风格快速轮动。下半年，国内宏观经济继续修复、企业盈利有望企稳反弹，同时流动性维持充裕，市场有望回归合理估值水平。政策方面，资本市场改革红利将继续释放，伴随注册制和再融资、信息披露、退市规则更加优化，这有利于国内权益市场形成真正意义上的慢牛格局。资产配置角度，居民、理财和外资依然是最主要的增量资金来源。个人养老金制度落地有望推动长期资金入市，而“房住不炒”、较低的租售比以及 A 股愈发合理的收益波动特征，居民财富再配置将大概率向权益市场倾斜。另外，金融对外开放背景下，A 股估值和盈利预期相对海外市场依然具备较强的吸引力，预计外资将持续保持流入状态。从风格角度而言，当前经济处于磨底区域，弱复苏的宏观环境下整体风格偏均衡，高股息类的红利资产往往有超额收益。汇添富红利增长坚守价值投资和长期投资理念，主要投资于具有较高股息回报的优质个股。在拥有稳定股息回报的同时，收获增长带来的红利。在全球高通胀叠加当前市场风格再平衡背景下，低估值投资机遇正在形成。我们主要聚焦中长期有成长空间和代表中国经济转型方向的领域，把握优质赛道，结合行业格局、股息分配等要素，多维度深度挖掘优质红利个股的投资机会。同时，我们也将更加审慎地研判宏观经济形势，适时调整建仓节奏，灵活应对外围环境不确定下市场波动风险。

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，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；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：汇添富红利增长混合型证券投资基金

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	143,897,725.10	217,851,332.29
结算备付金		5,094,346.06	11,959,314.74
存出保证金		409,182.11	778,985.68
交易性金融资产	6.4.7.2	730,077,142.08	1,199,203,897.08
其中：股票投资		730,077,142.08	1,199,203,897.08
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		18,828,370.98	-
应收股利		114,060.62	-
应收申购款		51,876.49	97,859.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		898,472,703.44	1,429,891,388.93
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		6.34	4,816,825.62
应付赎回款		425,235.99	763,372.09
应付管理人报酬		1,097,683.23	1,839,637.35
应付托管费		182,947.26	306,606.24
应付销售服务费		87,294.73	110,782.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	5.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.7	2,712,931.57	2,744,759.04
负债合计		4,506,099.12	10,581,987.95
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	642,052,467.44	948,419,520.26
未分配利润	6.4.7.9	251,914,136.88	470,889,880.72
净资产合计		893,966,604.32	1,419,309,400.98
负债和净资产总计		898,472,703.44	1,429,891,388.93

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 642,052,467.44 份。本基金下属添富红利增长混合 A 基金份额净值 1.3997 元，基金份额总额 543,438,999.60 份；本基金下属添富红利增长混合 C 基金份额净值 1.3520 元，基金份额总额 98,613,467.84 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富红利增长混合型证券投资基金

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 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
一、营业总收入		-52,209,259.61	-259,106,859.05
1. 利息收入		369,969.78	932,347.54
其中：存款利息收入	6.4.7.10	369,969.78	932,347.54
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）		-71,189,814.84	-320,465,283.80
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-78,926,812.24	-329,410,460.33
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	46,194.03	109,088.41
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	7,690,803.37	8,836,088.12
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	18,583,833.00	59,868,259.81
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	26,752.45	557,817.40

减：二、营业总支出		10,088,626.69	19,528,190.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,051,829.88	15,859,427.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,341,971.65	2,643,237.89
3. 销售服务费		588,979.06	909,413.63
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	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		0.26	1.23
8. 其他费用	6.4.7.21	105,845.84	116,110.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-62,297,886.30	-278,635,049.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-62,297,886.30	-278,635,049.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-62,297,886.30	-278,635,049.68

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富红利增长混合型证券投资基金

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）	948,419,520.26	470,889,880.72	1,419,309,400.98
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	948,419,520.26	470,889,880.72	1,419,309,400.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-306,367,052.82	-218,975,743.84	-525,342,796.66
（一）、综合收益总额	-	-62,297,886.30	-62,297,886.30
（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）	-306,367,052.82	-156,677,857.54	-463,044,910.36

其中：1. 基金申购款	14,515,587.73	6,810,009.37	21,325,597.10
2. 基金赎回款	-320,882,640.55	-163,487,866.91	-484,370,507.46
（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）	642,052,467.44	251,914,136.88	893,966,604.32
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）	1,282,373,286.96	1,320,866,150.93	2,603,239,437.89
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,282,373,286.96	1,320,866,150.93	2,603,239,437.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-96,297,383.42	-344,373,646.35	-440,671,029.77
（一）、综合收益总额	-	-278,635,049.68	-278,635,049.68
（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）	-96,297,383.42	-65,738,596.67	-162,035,980.09
其中：1. 基金申购款	170,170,234.67	130,558,303.27	300,728,537.94
2. 基金赎回款	-266,467,618.09	-196,296,899.94	-462,764,518.03
（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）	1,186,075,903.54	976,492,504.58	2,162,568,408.12

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

汇添富红利增长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]908 号文《关于准予汇添富印度精选混合型证券投资基金（QDII）注册的批复》以及中国证监会证监许可[2019]423 号文《关于准予汇添富印度精选混合型证券投资基金（QDII）变更注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2019 年 4 月 26 日生效。首次设立基金募集规模为 7,081,920,693.15 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_B19 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、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或票据）、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、权证、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金还可根据法律法规参与融资。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投资比例为基金资产的 60-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，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。本基金投资于红利增长型证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。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，重点投资于具有持续分红能力且估值相对合理的优质上市公司，力争实现基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率×60%+中证港股通高股息投资指数收益率×20%+中债综合指数收益率×20%。

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作为增值税纳税人；

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	143,897,725.10
等于：本金	143,881,170.58
加：应计利息	16,554.52
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	143,897,725.10

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		737,705,031.20	-	730,077,142.08	-7,627,889.12
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		737,705,031.20	-	730,077,142.08	-7,627,889.12

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	7.25
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	2,528,704.77
其中：交易所市场	2,528,704.77
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	2,712,931.57

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

添富红利增长混合 A		
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	837,452,948.79	837,452,948.79
本期申购	10,243,292.85	10,243,292.85
本期赎回（以“-”号填列）	-304,257,242.04	-304,257,242.04
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	543,438,999.60	543,438,999.60
添富红利增长混合 C		
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	110,966,571.47	110,966,571.47
本期申购	4,272,294.88	4,272,294.88
本期赎回（以“-”号填列）	-16,625,398.51	-16,625,398.51
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	98,613,467.84	98,613,467.84

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

添富红利增长混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	514,198,477.23	-93,959,463.29	420,239,013.94
本期利润	-68,770,136.08	16,947,502.83	-51,822,633.25
本期基金份额交易产生	-175,812,333.62	24,597,987.12	-151,214,346.50

的变动数			
其中：基金 申购款	5,950,529.34	-970,592.42	4,979,936.92
基金赎回款	-181,762,862.96	25,568,579.54	-156,194,283.42
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	269,616,007.53	-52,413,973.34	217,202,034.19
添富红利增长混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	62,747,670.31	-12,096,803.53	50,650,866.78
本期利润	-12,111,583.22	1,636,330.17	-10,475,253.05
本期基金份额 交易产生的 变动数	-6,672,136.41	1,208,625.37	-5,463,511.04
其中：基金 申购款	2,292,556.34	-462,483.89	1,830,072.45
基金赎回款	-8,964,692.75	1,671,109.26	-7,293,583.49
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	43,963,950.68	-9,251,847.99	34,712,102.69

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	326,429.48
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	39,364.59
其他	4,175.71
合计	369,969.78

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	3,092,972,163.29
减：卖出股票成本总额	3,163,887,177.77
减：交易费用	8,011,797.76
买卖股票差价收入	-78,926,812.24

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	75.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	46,118.44
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	46,194.03

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	321,209.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	275,000.00
减：应计利息总额	77.75
减：交易费用	12.88
买卖债券差价收入	46,118.44

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	7,690,803.37
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	7,690,803.37

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	18,583,833.00
——股票投资	18,583,833.00
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
——期货投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	18,583,833.00

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	26,752.45
替代损益	—
其他	—
合计	26,752.45

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	9,000.00
银行费用	657.00
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	1,969.29
合计	105,845.84

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, 基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人, 基金代销机构

东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构
--------------------	------------------

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	138,221,141.51	2.40	2,013,397,460.32	12.97

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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	100,135.79	2.39	-	-
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	1,494,751.50	13.27	351,016.25	6.55

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	8,051,829.88	15,859,427.36
其中：支付销售机构的客户维护费	2,083,949.41	3,057,940.80

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。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款指令，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	1,341,971.65	2,643,237.89

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，经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、休息日等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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	添富红利增长混合 A	添富红利增长混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	110,916.36	110,916.36
东方证券股份有限公司	-	12,990.07	12,990.07
汇添富基金管理股份有限公司	-	32,349.15	32,349.15
合计	-	156,255.58	156,255.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	添富红利增长混合 A	添富红利增长混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	155,241.33	155,241.33
东方证券股份有限公司	-	16,668.36	16,668.36
汇添富基金管理股份有限公司	-	54,200.12	54,200.12
合计	-	226,109.81	226,109.81

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值 0.80%年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，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登记机构，由登记机构代付给销售机构。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。

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	143,897,725.10	326,429.48	310,706,752.71	792,170.59

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	1,374	16,323.12	28,881.48	
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	
001360	南矿集	2023 年 03 月	6 个月	新股流	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	

	团	月 31 日		通 受 限						
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 威 股 份	2023 年 06 月 28	6 个 月	新 股 流 通 受	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	

		日		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	2,437	75,181.45	57,586.31	
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	海看股份	2023年06月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	
301281	科	2023	6	新	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	

	源 制 药	年 03 月 28 日	个 月	股 流 通 受 限						
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 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	
301310	鑫 宏 业	2023 年 05 月	6 个 月	新 股 流	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	

		月 26 日		通 受 限						
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	湖南裕能	2023 年 02 月 01	6 个 月	新 股 流 通 受	23.77	42.89	1,622	38,554.94	69,567.58	

		日		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	英特科技	2023年05月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	
301428	世	2023	6	新	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	

	纪恒通	年 05 月 10 日	个 月	股 流 通 受 限						
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	3,259	21,444.22	24,703.22	
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	柏诚系统股份公司	2023 年 03 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	

603125	江苏常青树科技	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	
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	855	30,908.25	32,601.15	
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	颀中科技	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	2023	6	新	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	

	曙高科	年 04 月 07 日	个 月	股 流 通 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	1,500	56,820.00	44,235.00	
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	3,061	33,977.10	52,159.44	
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	916	36,630.84	33,626.36	
688507	索辰科技	2023 年 04 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	

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	安凯微电子	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	
688623	双	2023	6	新	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	

	元科技	2023年05月31日	6个月	新股流通受限						
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 2023 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	143,897,725.10	-	-	-	-	-	143,897,725.10
结算备付金	5,094,346.06	-	-	-	-	-	5,094,346.06
存出保证金	409,182.11	-	-	-	-	-	409,182.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	730,077,142.08	730,077,142.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	18,828,370.98	18,828,370.98
应收股利	-	-	-	-	-	114,060.62	114,060.62
应收申购款	-	-	-	-	-	51,876.49	51,876.49
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-

产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	149,401,253.27	-	-	-	-	749,071,450.17	898,472,703.44
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	-	-	-	-	-	6.34	6.34
应付赎回款	-	-	-	-	-	425,235.99	425,235.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,097,683.23	1,097,683.23
应付托管费	-	-	-	-	-	182,947.26	182,947.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	87,294.73	87,294.73
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	-	-

利润							
递延 所得 税负 债	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	2,712,931.57	2,712,931.57
负债 总计	-	-	-	-	-	4,506,099.12	4,506,099.12
利率 敏感 度缺 口	149,401,253.27	-	-	-	-	744,565,351.05	893,966,604.32
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	217,851,332.29	-	-	-	-	-	217,851,332.29
结算 备付 金	11,959,314.74	-	-	-	-	-	11,959,314.74
存出 保证 金	778,985.68	-	-	-	-	-	778,985.68
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	1,199,203,897.08	1,199,203,897.08
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	-	-	-	-	-	97,859.14	97,859.14
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	230,589,632.71	-	-	-	-	1,199,301,756.22	1,429,891,388.93
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	-	-	-	-	-	4,816,825.62	4,816,825.62
应付赎回款	-	-	-	-	-	763,372.09	763,372.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,839,637.35	1,839,637.35
应付托管费	-	-	-	-	-	306,606.24	306,606.24
应付销售服务	-	-	-	-	-	110,782.44	110,782.44

费							
应付 投资 顾问 费	-	-	-	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-	-	5.17	5.17
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税负 债	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	2,744,759.04	2,744,759.04
负债 总计	-	-	-	-	-	10,581,987.95	10,581,987.95
利率 敏感 度缺 口	230,589,632.71	-	-	-	-	1,188,719,768.27	1,419,309,400.98

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

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

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			
	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	-	28,694,778.00	-	28,694,778.00
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	-	114,060.62	-	114,060.62
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	28,808,838.62	-	28,808,838.62
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	-	28,808,838.62	-	28,808,838.62
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	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	-	29,411,647.23	-	29,411,647.23
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	-	29,411,647.23	-	29,411,647.23
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	-	29,411,647.23	-	29,411,647.23

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%	1,440,441.93	1,470,582.36
	港币相对人民币贬值 5%	-1,440,441.93	-1,470,582.36

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	730,077,142.08	81.67	1,199,203,897.08	84.49
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	730,077,142.08	81.67	1,199,203,897.08	84.49

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
	中证红利指数上涨 5%	22,183,738.84	36,973,384.19
	中证红利指数下跌 5%	-22,183,738.84	-36,973,384.19

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	728,566,809.74
第二层次	404,401.74
第三层次	1,105,930.60
合计	730,077,142.08

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业等情况，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	730,077,142.08	81.26
	其中：股票	730,077,142.08	81.26
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	148,992,071.16	16.58
8	其他各项资产	19,403,490.20	2.16
9	合计	898,472,703.44	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 28,694,778.00 元，占期末净值比例为 3.21%。

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	1,066,732.20	0.12
B	采矿业	33,016,041.49	3.69
C	制造业	501,748,564.84	56.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,076,786.47	6.50
E	建筑业	4,946,351.15	0.55
F	批发和零售业	7,534,760.12	0.84
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	3,412,971.12	0.38
J	金融业	48,673,699.65	5.44
K	房地产业	8,068,371.45	0.90
L	租赁和商务服务业	12,279,792.00	1.37
M	科学研究和技术服务业	16,977,274.16	1.90
N	水利、环境和公共设施管理业	4,091,226.57	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,466,010.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	701,382,364.08	78.46

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	2,710,289.29	0.30
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	6,905,698.42	0.77
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	19,078,790.29	2.13
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	28,694,778.00	3.21

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	600519	贵州茅	19,001	32,130,691.00	3.59

		台			
2	600309	万华化学	364,541	32,021,281.44	3.58
3	000333	美的集团	508,200	29,943,144.00	3.35
4	000858	五粮液	158,600	25,942,202.00	2.90
5	600765	中航重机	954,096	25,293,084.96	2.83
6	600872	中炬高新	665,300	24,476,387.00	2.74
7	002050	三花智控	796,400	24,099,064.00	2.70
8	600529	山东药玻	865,500	23,558,910.00	2.64
9	002608	江苏国信	3,004,700	22,745,579.00	2.54
10	600312	平高电气	1,648,300	20,422,437.00	2.28
11	002966	苏州银行	2,840,291	18,603,906.05	2.08
12	300750	宁德时代	80,523	18,422,857.17	2.06
13	600900	长江电力	814,300	17,963,458.00	2.01
14	600276	恒瑞医药	366,700	17,564,930.00	1.96
15	300258	精锻科技	1,204,300	17,450,307.00	1.95
16	600023	浙能电力	3,418,600	17,332,302.00	1.94
17	00700	腾讯控股	55,800	17,059,654.09	1.91
18	003031	中瓷电子	127,849	17,019,258.88	1.90
19	300416	苏试试验	786,719	16,961,661.64	1.90
20	300274	阳光电源	141,559	16,510,026.17	1.85
21	603806	福斯特	404,400	15,039,636.00	1.68
22	002046	国机精工	1,172,600	14,962,376.00	1.67
23	600079	人福医药	540,500	14,561,070.00	1.63

		药			
24	002128	电投能源	1,091,300	14,426,986.00	1.61
25	002068	黑猫股份	1,062,100	12,607,127.00	1.41
26	002027	分众传媒	1,803,200	12,279,792.00	1.37
27	601899	紫金矿业	1,075,714	12,230,868.18	1.37
28	603338	浙江鼎力	212,200	11,885,322.00	1.33
29	601318	中国平安	224,100	10,398,240.00	1.16
30	600426	华鲁恒升	321,800	9,856,734.00	1.10
31	300820	英杰电气	111,800	9,210,084.00	1.03
32	600036	招商银行	258,480	8,467,804.80	0.95
33	600048	保利发展	619,215	8,068,371.45	0.90
34	600998	九州通	719,819	7,471,721.22	0.84
35	002993	奥海科技	219,800	7,455,616.00	0.83
36	600398	海澜之家	1,077,360	7,412,236.80	0.83
37	000066	中国长城	528,800	7,313,304.00	0.82
38	002142	宁波银行	278,356	7,042,406.80	0.79
39	603305	旭升集团	230,120	6,413,444.40	0.72
40	600489	中金黄金	615,507	6,358,187.31	0.71
41	603173	福斯达深冷	205,676	6,057,158.20	0.68
42	600176	中国巨石	406,600	5,757,456.00	0.64
43	300394	天孚通信	49,800	5,320,134.00	0.60
44	603596	伯特利	65,800	5,215,308.00	0.58
45	601186	中国铁建	501,100	4,935,835.00	0.55

46	300580	贝斯特	198,138	4,812,772.02	0.54
47	03690	美团-W	42,680	4,812,518.01	0.54
48	601636	旗滨集团	539,300	4,648,766.00	0.52
49	002262	恩华药业	145,300	4,479,599.00	0.50
50	601865	福莱特	107,900	4,155,229.00	0.46
51	603136	天目湖	157,700	4,068,660.00	0.46
52	000938	紫光股份	121,900	3,882,515.00	0.43
53	002472	双环传动	78,800	2,860,440.00	0.32
54	002737	葵花药业	116,100	2,825,874.00	0.32
55	01138	中远海能	374,000	2,710,289.29	0.30
56	688111	金山办公	5,090	2,403,599.80	0.27
57	000063	中兴通讯	48,700	2,217,798.00	0.25
58	01368	特步国际	284,500	2,093,180.41	0.23
59	00728	中国电信	584,000	2,019,136.20	0.23
60	601288	农业银行	565,400	1,995,862.00	0.22
61	002180	纳思达	53,900	1,846,075.00	0.21
62	002371	北方华创	5,200	1,651,780.00	0.18
63	603986	兆易创新	15,000	1,593,750.00	0.18
64	000719	中原传媒	125,300	1,466,010.00	0.16
65	601988	中国银行	326,000	1,274,660.00	0.14
66	002714	牧原股份	25,308	1,066,732.20	0.12
67	600919	江苏银行	121,200	890,820.00	0.10
68	601698	中国卫通	39,800	791,224.00	0.09
69	002475	立讯精密	18,700	606,815.00	0.07

		密			
70	688525	佰维存 储	4,614	368,612.46	0.04
71	688582	芯动联 科	6,476	299,402.44	0.03
72	688496	清越科 技	12,000	238,560.00	0.03
73	301397	溯联股 份	3,618	152,606.80	0.02
74	301292	海科新 源	5,824	116,421.76	0.01
75	688631	莱斯信 息	3,357	108,400.08	0.01
76	301488	豪恩汽 电	2,618	104,144.04	0.01
77	301202	朗威股 份	3,060	79,009.20	0.01
78	301261	恒工精 密	1,973	72,803.70	0.01
79	301358	湖南裕 能	1,622	69,567.58	0.01
80	301260	格力博	2,437	57,586.31	0.01
81	688361	中科飞 测	831	53,740.77	0.01
82	688472	阿特斯 阳光电 力	3,061	52,159.44	0.01
83	688443	智翔金 泰	1,500	44,235.00	0.00
84	001286	陕西能 源	3,767	35,447.47	0.00
85	688484	南芯科 技	916	33,626.36	0.00
86	688146	中船派 瑞特气	855	32,601.15	0.00
87	301301	川宁生 物	3,574	32,023.04	0.00
88	001287	中电港	1,374	28,881.48	0.00
89	688352	颀中科 技	2,361	28,497.27	0.00
90	688507	索辰科 技	222	27,108.42	0.00
91	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00

92	601061	中信金属	3,259	24,703.22	0.00
93	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
94	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
95	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
96	688458	美芯晟科技	221	20,057.96	0.00
97	688581	安杰思医学	163	19,238.89	0.00
98	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
99	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
100	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
101	688562	航天软件股份	726	16,197.06	0.00
102	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
103	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
104	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
105	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
106	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
107	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
108	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
109	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
110	688629	四川华丰科技	708	13,161.72	0.00
111	688620	安凯微电子	1,016	12,537.44	0.00
112	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
113	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
114	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
115	688523	航天环	472	11,257.20	0.00

		宇科技			
116	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
117	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
118	601065	江西省盐业集团	875	10,360.00	0.00
119	688479	用友汽车信息科技	332	9,790.68	0.00
120	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
121	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
122	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
123	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
124	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
125	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
126	688535	华海诚科新材料	161	8,248.03	0.00
127	601133	柏诚系统股份公司	664	8,140.64	0.00
128	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
129	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
130	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
131	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
132	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
133	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
134	603125	江苏常青树科技	160	3,924.80	0.00

135	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
136	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
137	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
138	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
139	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
140	301335	天元宠物	88	2,097.92	0.00
141	301398	星源卓镁	55	2,062.50	0.00
142	301365	矩阵股份	74	1,218.04	0.00
143	301277	新天地	59	1,151.09	0.00
144	301290	东星医疗	30	961.50	0.00
145	301265	华新环保	19	220.78	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	603305	旭升集团	70,617,799.57	4.98
2	600023	浙能电力	68,167,047.13	4.80
3	601899	紫金矿业	66,753,272.08	4.70
4	000858	五粮液	64,598,221.70	4.55
5	00700	腾讯控股	63,722,619.15	4.49
6	601318	中国平安	58,078,161.84	4.09
7	002050	三花智控	55,033,778.08	3.88
8	601988	中国银行	54,294,022.09	3.83
9	003031	中瓷电子	47,297,764.46	3.33
10	000333	美的集团	38,594,681.00	2.72
11	600256	广汇能源	38,416,030.33	2.71
12	600702	舍得酒业	36,701,571.73	2.59
13	600872	中炬高新	35,503,914.00	2.50

14	000568	泸州老窖	34,953,774.60	2.46
15	300274	阳光电源	34,206,125.17	2.41
16	603806	福斯特	33,911,464.24	2.39
17	601688	华泰证券	33,149,315.00	2.34
18	601636	旗滨集团	32,951,385.00	2.32
19	000933	神火股份	31,807,302.36	2.24
20	600398	海澜之家	31,409,303.20	2.21
21	600529	山东药玻	31,230,793.00	2.20
22	600276	恒瑞医药	29,957,640.65	2.11
23	603993	洛阳钼业	29,914,373.00	2.11
24	300068	南都电源	29,303,038.00	2.06
25	002463	沪电股份	29,122,247.68	2.05
26	601601	中国太保	28,559,744.35	2.01

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	000858	五粮液	95,920,395.60	6.76
2	601899	紫金矿业	77,478,513.24	5.46
3	603305	旭升集团	63,088,278.20	4.44
4	00700	腾讯控股	61,259,951.73	4.32
5	601988	中国银行	55,645,225.00	3.92
6	600702	舍得酒业	54,935,406.51	3.87
7	600023	浙能电力	52,893,782.00	3.73
8	600048	保利发展	52,599,577.00	3.71
9	002142	宁波银行	51,385,272.47	3.62
10	002050	三花智控	50,432,219.00	3.55
11	601888	中国中免	47,184,366.64	3.32
12	600309	万华化学	46,556,161.00	3.28
13	600519	贵州茅台	46,398,573.50	3.27
14	601318	中国平安	46,086,720.51	3.25
15	603806	福斯特	45,078,746.37	3.18
16	300274	阳光电源	45,032,249.15	3.17
17	300750	宁德时代	43,239,944.83	3.05
18	601288	农业银行	42,165,381.00	2.97
19	300059	东方财富	41,475,724.60	2.92
20	300124	汇川技术	41,408,540.49	2.92
21	600256	广汇能源	39,422,472.21	2.78

22	002180	纳思达	38,989,651.00	2.75
23	002352	顺丰控股	37,305,514.69	2.63
24	002475	立讯精密	37,281,305.81	2.63
25	603259	药明康德	36,881,281.00	2.60
26	000568	泸州老窖	33,397,718.70	2.35
27	601688	华泰证券	33,076,723.00	2.33
28	600809	山西汾酒	32,704,486.90	2.30
29	003031	中瓷电子	32,347,100.78	2.28
30	600036	招商银行	31,346,962.00	2.21
31	000933	神火股份	31,328,270.28	2.21
32	601601	中国太保	30,384,110.00	2.14
33	600028	中国石化	30,076,490.00	2.12
34	002463	沪电股份	29,566,577.20	2.08
35	001322	箭牌家居	29,226,826.40	2.06
36	603993	洛阳钼业	29,142,795.00	2.05
37	688032	禾迈股份	28,773,041.62	2.03

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	2,676,176,589.77
卖出股票收入（成交）总额	3,092,972,163.29

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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	409,182.11
2	应收清算款	18,828,370.98
3	应收股利	114,060.62
4	应收利息	—
5	应收申购款	51,876.49
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	19,403,490.20

7.12.4 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。

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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
添富红利增长混合 A	21,801	24,927.25	48,978,237.48	9.01	494,460,762.12	90.99
添富红利增长混合 C	19,647	5,019.26	277,067.98	0.28	98,336,399.86	99.72
合计	41,448	15,490.55	49,255,305.46	7.67	592,797,161.98	92.33

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	添富红利增长混合 A	166,317.76	0.03
	添富红利增长混合 C	134,270.81	0.14
	合计	300,588.57	0.05

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金	添富红利增长混合 A	0

投资和研究部门负责人持有 本开放式基金	添富红利增长混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	添富红利增长混合 A	0
	添富红利增长混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	添富红利增长混合 A	添富红利增长混合 C
基金合同生效日 (2019 年 04 月 26 日) 基金份额总额	6,242,874,888.73	839,045,804.42
本报告期期初基金份 额总额	837,452,948.79	110,966,571.47
本报告期基金总申购 份额	10,243,292.85	4,272,294.88
减：本报告期基金总 赎回份额	304,257,242.04	16,625,398.51
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期末基金份 额总额	543,438,999.60	98,613,467.84

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(%)	
中信证券	2	1,106,661,393.15	19.22	808,934.30	19.31	
中信建投证券	1	747,537,330.58	12.98	539,199.97	12.87	
长江证券	1	580,465,968.56	10.08	418,691.67	9.99	
东方财富	2	367,177,891.18	6.38	256,827.55	6.13	
招商	2	306,986,907.94	5.33	222,559.44	5.31	

证券						
华泰 证券	1	278,141,480.91	4.83	200,623.06	4.79	
银河 证券	2	243,662,327.43	4.23	176,160.10	4.20	
方正 证券	2	211,690,522.82	3.68	154,902.41	3.70	
安信 证券	2	206,274,221.71	3.58	149,584.96	3.57	
西南 证券	2	169,574,728.05	2.95	123,701.42	2.95	
长城 证券	1	165,901,548.63	2.88	119,663.88	2.86	
西部 证券	1	157,010,647.17	2.73	113,252.23	2.70	
兴业 证券	2	155,219,542.02	2.70	112,285.75	2.68	
东方 证券	3	138,221,141.51	2.40	100,135.79	2.39	
德邦 证券	1	129,285,080.18	2.25	93,253.03	2.23	
国泰 君安	2	117,364,281.30	2.04	85,342.43	2.04	
上海 证券	1	110,015,556.91	1.91	102,456.76	2.45	
浙商 证券	1	103,284,542.82	1.79	76,792.02	1.83	
申万 宏源 证券	2	84,410,995.41	1.47	60,883.97	1.45	
信达 证券	1	77,404,966.05	1.34	55,831.97	1.33	
瑞银 证券	1	75,741,158.59	1.32	54,631.43	1.30	
中泰 证券	2	64,227,103.31	1.12	46,764.33	1.12	
东北 证券	2	56,699,663.53	0.98	41,551.99	0.99	
平安 证券	1	48,773,404.33	0.85	35,328.64	0.84	
海通 证券	1	41,027,224.00	0.71	29,592.94	0.71	
高盛 中国	1	14,568,498.75	0.25	10,508.11	0.25	

渤海 证券	1	-	-	-	-	
诚通 证券	1	-	-	-	-	
第一 创业 证券	1	-	-	-	-	
光大 证券	1	-	-	-	-	
国联 证券	1	-	-	-	-	
国元 证券	1	-	-	-	-	
首创 证券	2	-	-	-	-	
中金 公司	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(%)
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	321,209.07	100.00	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛 中国	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

诚通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一 创业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元:首创证券(上交所单元,深交所单

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	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
2	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 20 日
5	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

§ 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红利增长混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富红利增长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富红利增长混合型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、报告期内汇添富红利增长混合型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。

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