

# 汇添富民营活力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 .....	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 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	15
§ 5 托管人报告 .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
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 .....	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	15
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	20
§ 7 投资组合报告 .....	58
7.1 期末基金资产组合情况 .....	58
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	58
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 .....	59
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	72
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 .....	73
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 .....	73
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 .....	73
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 .....	73

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
7.12 投资组合报告附注 .....	74
§ 8 基金份额持有人信息 .....	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
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 .....	75
§ 9 开放式基金份额变动 .....	75
§ 10 重大事件揭示 .....	75
10.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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 .....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	76
10.4 基金投资策略的改变 .....	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
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 .....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件 .....	80
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
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 .....	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
§ 12 备查文件目录 .....	80
12.1 备查文件目录 .....	81
12.2 存放地点 .....	81
12.3 查阅方式 .....	81

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富民营活力混合型证券投资基金
基金简称	汇添富民营活力混合
基金主代码	470009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 05 月 05 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）	566,814,305.59
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的方法，精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局，在科学严格管理风险的前提下，力求基金资产的中长期增值。
投资策略	本基金为混合型基金。股票投资的主要策略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，个股精选策略用于挖掘成长性较高且估值有吸引力的优秀民营企业上市公司以获取超额收益。本基金通过投资于具有良好的公司治理结构、灵活的用人和分配机制、独特的核心竞争优势等突出特征的优秀民营企业，以分享优秀民营企业成长所带来的资本增值。本基金的投资策略还包括：债券投资策略、权证投资策略。
业绩比较基准	中证民营企业综合指数*80%+上证国债指数*20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

### 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	《中国证券报》
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	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)
本期已实现收益	81,657,569.24
本期利润	158,773,377.55
加权平均基金份额本期利润	0.2859
本期加权平均净值利润率	5.89%
本期基金份额净值增长率	6.66%
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	2,164,453,760.12
期末可供分配基金份额利润	3.8186
期末基金资产净值	2,731,268,065.71
期末基金份额净值	4.819
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	478.74%

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	3.77%	1.82%	1.84%	0.84%	1.93%	0.98%
过去三个月	-4.08%	1.56%	-3.97%	0.76%	-0.11%	0.80%
过去六个月	6.66%	1.31%	2.03%	0.73%	4.63%	0.58%
过去一年	-3.50%	1.33%	-8.22%	0.89%	4.72%	0.44%
过去三年	7.02%	1.49%	2.98%	1.09%	4.04%	0.40%
自基金合同生效日起至今	478.74%	1.54%	84.87%	1.26%	393.87%	0.28%

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

汇添富民营活力混合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（2010 年 05 月 05 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		
马翔	本基金的基金经理	2016 年 03 月 11 日		12	国籍：中国。学历：清华大学工学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司，历任行业分析师。2016 年 3 月 11 日至今任汇添富民营活力混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月 6 日至今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 3 月 19 日至 2021 年 9 月 22 日任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 22 日至今任汇添富创新增长一年定期开放混合型证券投资基金的基

					<p>金经理。2020 年 7 月 24 日至今任汇添富策略增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 28 日至今任汇添富科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 9 日至今任汇添富成长精选混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月 23 日至今任汇添富北交所创新精选两年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月 2 日至今任汇添富全球汽车产业升级混合型证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富数字经济核心产业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合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2023 年上半年，市场震荡上行，小盘股优于大盘股，以 TMT 为代表的科技成长板块表现较为抢眼。

报告期内，国内疫情快速过峰，人们的生活和企业的经营回归常态，宏观经济呈稳步复苏的态势，投资者对未来的信心在逐渐恢复，证券市场虽有反复，但已经走出了企稳向上的态势。当然，所谓弱周期复苏，并不是一帆风顺的稳步向上，而是以较低斜率的震荡上行。因为经济斜率的中枢下移，震荡的幅度反而加大，每一次短周期震荡，都伴随着消费者信心、企业开支意愿、商品库存等要素的波动，而证券市场的投资者，又会情绪性的放大这种波动。因此，每一次短期震荡下行，都会让人悲观，认为经济增长晦涩，股市前途渺茫；而每一次短期的向上震荡，也可能让人以为，世界尽在掌握，牛市立时可至。这两种想法，都是市场情绪的表现，投资者都知道应该尽可能利用市场情绪扩大收益，但实操过程中又很容易成为情绪的助推器。作为机构投资者，我们既不希望鼓噪市场波动，也不期待收割市场情绪，唯盼通过研究创造价值，把握经济大周期和产业长期脉络，少做择时，中长期持股。

我们维持年初的判断，经济复苏背景下，市场参与者对未来的信心在逐渐恢复，证券市场虽有反复，但是正在走出企稳向上的态势。我们继续看好成长股，因为正在恢复的“信心”是长期现金流折现的重要因素，估值修复的过程虽有反复，但趋势不变。成长股之中，我们关注两类股票，一类是消费、医药等稳定成长公司，另一类是 TMT、新能源、新材料等科技成长公司。

本基金一向致力于自下而上发掘各个细分领域的成长股，寻找有潜力成为新兴行业领袖的企业。我们在过去的投资实践中发现，单纯的自下而上选股，固然可以找到好股票，但如果能够把握市场主线投资脉络，则可以事半功倍的获取收益。尤其在成长股领域，把握产业发展脉络，会更容易发现牛股，例如过去几年的新能源汽车行业，以及更早的智能手机和移动互联网行业。当行业处于成长快车道时，往往意味着产业规模的迅速膨胀，新龙头企业的快速形成，是比较容易给投资者带来奖励的。

从今年开始，本基金加大力度布局自上而下的投资主线。在科技成长领域，我们看到人工智能行业正在发生巨变，产业规模迅速膨胀，从底层算力建设，到基础大模型研发，再到上层应用改造，都在快速推进中。类比 20 年前的互联网和 10 年前的移动互联网，人工智能技术也可能在未来的 5~10 年，重塑我们的生活。回顾移动互联网，在智能手机诞生

后的十年，就是不停的渗透、改造和重塑，直到最近还有“短视频”这样的应用横空出世占据我们的视野。人工智能对世界的改变，对各行各业的渗透，也会是一个徐徐推进的过程。创新不会一蹴而就，但创新也不会停歇脚步，资本市场对这种产业变革，一定会有持续的反馈。我们重视人工智能产业，并非急于抓住短期涨的最好的股票，而是要在此时代浪潮之中深入研究，发现价值。移动互联网行业的十年，年年都有相关的股票机会，但每次机会的逻辑和细分行业又有所不同。这就是科技成长股的魅力，我们只能看清大致方向，却难言自己一眼望到终点。惟有投身其中，与时俱进，争取在产业波浪前行的过程中，跟上时代浪潮，把握机会。

报告期内，我们对人工智能板块投资力度较大，主要集中在计算机软件板块，获得了一定的超额收益。但也要客观承认，今年表现更好的是与海外算力建设相关的通信板块，而我们对此的投资力度略显不足。我们一直认为，人工智能作为 IT 行业创新，软件和应用的长期空间是最大的，但不可否认，在发展初期，最确定的产业逻辑是军备竞赛和算力不足，从而带来相关硬件板块机会；在这个阶段，软件和应用的最后赢家是谁，反而并不清晰。当前时点，我们也不急于在戴维斯双击后的制造业成长股上扩大头寸。深入思考后，可以在人工智能板块找到更多机会：模型训练是 AI 行业的一阶导，模型训练相关的算力投资是 AI 行业的二阶导，如果行业二阶导都如此汹涌澎湃，后续的产业机会更可想而知。

软件公司在二季度的震荡中表现不好，也因其订单恢复受制于经济复苏的力度，很多股票仍然在低位徘徊。我们认为，随着经济企稳态势逐渐明朗，叠加 AI 技术发展对软件行业的升级改造，该行业可能会迎来新一轮的成长周期，带动相关企业的盈利和估值水平突破箱体震荡，站上一个更高的台阶。在报告期内，我们也布局了一些新方向：高性能计算的国产化、人工智能的娱乐应用、汽车智能驾驶的新技术等。我们将在这些领域持续投入研究精力，期待找到新的龙头企业。

#### 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 6.66%。同期业绩比较基准收益率为 2.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济逐步恢复，我们对资本市场保持乐观。虽然当前经济运行面临一些困难挑战，但中国经济具有巨大的发展韧性和潜力，长期向好的基本面没有改变。经历了上半年的曲折式前进，未来经济发展的方向越来越清晰，我们看到“国内大循环为主体，国内国际双循环相互促进”新格局正在逐渐展开，政策方向越来越明确。

首先是对国内需求新形势的一些判断：房地产市场供求关系发生重大变化，促进行业

平稳健康发展成了主基调，房地产对经济增长的贡献度将有序回归；地方政府投资，是 GDP 总需求的重要组成部分，现阶段要防范化解地方债务风险，其投资增速也会降低；消费作为拉动经济增长的基础，重要性继续提升，增加居民收入成为经济工作的重中之重。

在这种格局下，国内国际双循环的重要意义凸显：一方面，我们国家制造业竞争优势非常显著，无论是直接出口还是以海外投资建厂的方式参与国际分工，都可以实现价值扩张，有效助力经济总量增长；另一方面，国际市场往往盈利丰厚，企业出海过程中获得的收益，都可以直接或间接的方式有效提高本国居民收入，从而促进国内消费。

需要注意的是，现在的外部环境复杂严峻，贸易摩擦、科技封锁和经济脱钩等逆风行为甚嚣尘上。我们积极参与国际产业分工，想要提高自己在全球产业链的价值地位，这是条必由之路，却不是一条易行之路。需要克服很多困难，补齐各类短板，必须打造现代化产业体系，在科技创新领域有所建树，培育壮大战略新兴产业。

在上述分析框架下，本基金所要投资的成长方向非常清晰，即包括三个重要领域：

一、全球科技创新方向，中国企业参与其中，在产业链快速发展的过程中，延伸自己的价值。当前，以新一代人工智能技术为核心的全球科技创新如火如荼，我们重点投资能够参与相关产业链分工的中国制造企业，以及快速复刻追赶，推动国内应用落地的软件互联网公司。

二、国内科技行业补短板，打造现代化产业体系。在半导体、基础软件、新材料、高端装备、核心零部件等领域，有一批中国企业，不断实现从零到一的突破，我们紧密跟踪，在合理的估值价位积极布局。

三、国内大消费方向。经历了疫情转段和经济波动的双重压力，这些稳定成长类企业的盈利增速和估值都处于相对低位，现在布局有收获戴维斯双击的机会，我们积极寻找有望成为新行业领袖的企业。

#### 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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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信息的真实、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：汇添富民营活力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
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	138,091,736.97	42,970,833.08
结算备付金		4,685,250.18	4,735,353.45
存出保证金		533,913.08	576,648.58
交易性金融资产	6.4.7.2	2,588,668,800.78	2,397,864,726.49
其中：股票投资		2,523,094,325.08	2,288,823,833.16
基金投资		-	-
债券投资		65,574,475.70	109,040,893.33
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		17,398,736.72	8,609,870.41
应收股利		-	-
应收申购款		508,726.27	336,114.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,749,887,164.00	2,455,093,546.28
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		11,367,193.88	641,584.13
应付赎回款		508,346.87	289,297.80
应付管理人报酬		3,381,328.94	3,164,883.71
应付托管费		563,554.84	527,480.61
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		42.01	4.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	2,798,631.75	2,023,887.73



负债合计		18,619,098.29	6,647,138.84
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	566,814,305.59	541,941,339.14
未分配利润	6.4.7.9	2,164,453,760.12	1,906,505,068.30
净资产合计		2,731,268,065.71	2,448,446,407.44
负债和净资产总计		2,749,887,164.00	2,455,093,546.28

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.819 元，基金份额总额

566,814,305.59 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富民营活力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
<b>一、营业总收入</b>		<b>182,318,207.44</b>	<b>-417,982,256.93</b>
1. 利息收入		220,346.19	502,775.35
其中：存款利息收入	6.4.7.10	220,346.19	502,775.35
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）		104,909,327.57	-341,183,974.10
其中：股票投资收益	6.4.7.11	88,877,221.85	-356,750,282.28
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	894,390.41	-
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	15,137,715.31	15,566,308.18
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	77,115,808.31	-77,396,905.93
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	72,725.37	95,847.75

<b>减：二、营业总支出</b>		<b>23,544,829.89</b>	<b>22,904,993.05</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,079,057.28	19,528,235.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,346,509.61	3,254,705.86
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		10.11	-
8. 其他费用	6.4.7.21	119,252.89	122,052.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>158,773,377.55</b>	<b>-440,887,249.98</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>158,773,377.55</b>	<b>-440,887,249.98</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>158,773,377.55</b>	<b>-440,887,249.98</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富民营活力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）	541,941,339.14	1,906,505,068.30	2,448,446,407.44
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	541,941,339.14	1,906,505,068.30	2,448,446,407.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	24,872,966.45	257,948,691.82	282,821,658.27
（一）、综合收益总额	-	158,773,377.55	158,773,377.55
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	24,872,966.45	99,175,314.27	124,048,280.72

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	59,165,201.22	232,604,750.99	291,769,952.21
2. 基金赎回款	-34,292,234.77	-133,429,436.72	-167,721,671.49
(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)	566,814,305.59	2,164,453,760.12	2,731,268,065.71
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)	552,711,127.76	2,648,052,872.11	3,200,763,999.87
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	552,711,127.76	2,648,052,872.11	3,200,763,999.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,554,341.23	-470,661,425.84	-478,215,767.07
(一)、综合收益总额	-	-440,887,249.98	-440,887,249.98
(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)	-7,554,341.23	-29,774,175.86	-37,328,517.09
其中：1. 基金申购款	34,833,043.25	132,026,945.74	166,859,988.99
2. 基金赎回款	-42,387,384.48	-161,801,121.60	-204,188,506.08
(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）	545,156,786.53	2,177,391,446.27	2,722,548,232.80
-----------------	----------------	------------------	------------------

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

汇添富民营活力混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），是由汇添富民营活力股票型证券投资基金变更而来。原汇添富民营活力股票型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]308 号文《关于核准汇添富民营活力股票型证券投资基金募集的批复》准予注册，由汇添富基金管理有限公司（现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 2010 年 5 月 5 日生效。首次设立基金募集规模为 1,407,531,401.75 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（2010）验字第 60466941\_B06 号验资报告予以验证。

根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，汇添富基金管理股份有限公司决定自 2015 年 8 月 5 日起将本基金变更为混合基金，并相应修改本基金的《基金合同》。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、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本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 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于到期日

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。本基金以民营企业上市公司为股票及存托凭证主要投资对象，投资于民营企业上市公司股票及存托凭证的资产占股票及存托凭证资产的比例不低于 80%。本基金主要依据上市公司招股说明书、定期报告和股权变动公告判断该上市公司是否为民营企业上市公司，判断的主要标准为上市公司实际控制人。实际控制人是实际控制上市公司的自然人、法人或其他组织，具体而言，只要拥有下列情形之一的，即视为拥有上市公司控制权：投资者为上市公司持股 50%以上的控股股东；投资者可以实际支配上市公司股份表决权超过 30%；投资者通过实际支配上市公司股份表决权能够决定公司董事会半数以上成员选任；投资者依其可实际支配的上市公司股份表决权足以对公司股东大会的决议产生重大影响；中国证监会认定的其他情形。本基金将实际控制人为境内自然人（不包括港澳台）控股的上市公司定义为民营企业上市公司。本基金拟投资的民营企业上市公司股票包括符合本基金定义的中证民营企业综合指数成份股、新股、发生股权变动后的已上市公司。当市场出现符合本基金定义的更合适、更权威的表征民营企业上市公司的指数或中证民营企业综合指数停止发布时，基金管理人有权选用新指数的成份股或按本基金有关民营企业上市公司的定义自行选择股票来替换中证民营企业综合指数的成份股，并及时公告。本基金采用自下而上的方法，精选与中国经济发展密切相关的优秀民营企业上市公司股票进行投资布局，在科学严格管理风险的前提下，力求基金资产的中长期增值。本基金的业绩比较基准为：中证民营企业综合指数×80%+上证国债指数×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。

#### 6.4.7 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	138,091,736.97
等于：本金	138,077,518.62
加：应计利息	14,218.35
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	138,091,736.97

##### 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		2,516,417,203.69	—	2,523,094,325.08	6,677,121.39
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	64,166,803.67	1,063,425.70	65,574,475.70	344,246.33
	银行间市场	—	—	—	—
	其他	—	—	—	—



	合计	64,166,803.67	1,063,425.70	65,574,475.70	344,246.33
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,580,584,007.36	1,063,425.70	2,588,668,800.78	7,021,367.72

### 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	444.59
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,617,512.27
其中：交易所市场	2,617,512.27
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	121,167.52
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	2,798,631.75

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	541,941,339.14	541,941,339.14
本期申购	59,165,201.22	59,165,201.22
本期赎回（以“-”号填列）	-34,292,234.77	-34,292,234.77
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	566,814,305.59	566,814,305.59

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	2,272,822,447.34	-366,317,379.04	1,906,505,068.30
本期利润	81,657,569.24	77,115,808.31	158,773,377.55
本期基金份额交易产生的变动数	106,713,338.49	-7,538,024.22	99,175,314.27
其中：基金申购款	254,029,593.01	-21,424,842.02	232,604,750.99
基金赎回款	-147,316,254.52	13,886,817.80	-133,429,436.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,461,193,355.07	-296,739,594.95	2,164,453,760.12

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	176,821.69
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	39,059.10
其他	4,465.40
合计	220,346.19

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	3,723,178,960.63
减：卖出股票成本总额	3,624,422,326.13
减：交易费用	9,879,412.65
买卖股票差价收入	88,877,221.85

#### 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	947,570.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-53,179.81
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	894,390.41

##### 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	72,453,008.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	71,055,021.70
减：应计利息总额	1,451,008.80
减：交易费用	158.11
买卖债券差价收入	-53,179.81

#### 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	15,137,715.31
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	15,137,715.31

#### 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	77,115,808.31
——股票投资	76,862,733.78
——债券投资	253,074.53
——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	77,115,808.31
----	---------------

#### 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	72,725.37
替代损益	-
其他	-
合计	72,725.37

#### 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	40,167.52
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	978.00
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	-
合计	119,252.89

#### 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
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

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	841,661,385.32	11.28	313,639,031.59	4.78

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 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	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	8,085,582.00	29.25	-	-

##### 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	607,094.06	10.91	143,952.99	5.50
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	200,701.13	4.21	90,502.07	3.01

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	20,079,057.28	19,528,235.19
其中：支付销售机构的客户维护费	6,775,944.57	6,667,149.28

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

##### 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	3,346,509.61	3,254,705.86

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比



		例 (%)		例 (%)
上海汇添富公益基金会	1,984,126.98	0.35	1,984,126.98	0.37

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

#### 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	138,091,736.97	176,821.69	304,825,960.92	465,879.75

#### 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	2023	6 个	新股	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	

	锻造	年 05 月 15 日	月	流 通 受 限						
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	
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	6个月	新股流通	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	

		月 09 日		受 限						
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日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	
301203	国泰环保	2023年03月28	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	

		日								
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	3,121	96,282.85	73,749.23	
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	
30128	科	202	6	新	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	

1	源制 药	3 年 03 月 28 日	个 月	股 流 通 受 限						
30129 2	海科 新源	202 3 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	
30129 2	海科 新源	202 3 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	
30129 3	三博 脑科	202 3 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	
30130 1	川宁 生物	202 2 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	
30130 5	朗坤 环境	202 3 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	
30130 7	美利 信	202 3 年	6 个 月	新 股 流	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	

		04 月 14 日		通 受 限						
30131 0	鑫 宏 业	202 3 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	
30131 5	威 士 顿	202 3 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	
30131 7	鑫 磊 股 份	202 3 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	
30132 0	豪 江 智 能	202 3 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	
30133 7	亚 华 电 子	202 3 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	
30134 5	涛 涛 车 业	202 3 年 03 月	6 个 月	新 股 流 通 受	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	

		10 日		限						
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日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	
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	2023	6个	新股	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	



	汽 电	年 06 月 26 日	月	流 通 受 限						
60106 1	中 信 金 属	202 3 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	
60106 5	江 西 省 盐 业 集 团	202 3 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	
60113 3	柏 诚 系 统 股 份 公 司	202 3 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	
60312 5	江 苏 常 青 树 科 技	202 3 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	
60313 5	中 重 科 技	202 3 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	
60313 7	恒 尚 节	202 3 年	6 个 月	新 股 流	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	

	能	04 月 10 日		通 受 限						
68814 6	中 船 派 瑞 特 气	202 3 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	
68833 4	西 高 院	202 3 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	
68835 2	顾 中 科 技	202 3 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	
68836 1	中 科 飞 测	202 3 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	
68843 3	华 曙 高 科	202 3 年 04 月 07 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	
68844 3	智 翔 金 泰	202 3 年 06 月	6 个 月	新 股 流 通 受	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	

		13 日		限						
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	6,261	69,497.10	106,687.44	
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	1,008	40,309.92	37,003.68	
688486	龙迅股份	2023年02月10日	6个月	新股流通受限	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	
688506	百利天恒药业	2022年12月28	6个月	新股流通受限	24.70	71.38	15,622	385,863.40	1,115,098.36	

		日								
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	
68858	芯	202	6	新	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	

2	动联科	3 年 06 月 21 日	个月	股流通受限						
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	
300442	润泽科技	2023 年 02 月 14 日	6 个月	非公开发行流通受限	19.57	29.60	766,609	14,999,986.68	22,691,626.40	
30076	锦	202	6	非	150.0	101.1	100,00	15,000,000.	10,114,000.	

3	浪科技	3 年 02 月 10 日	个月	公开发 行流 通受 限	0	4	0	00	00	
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 97 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。）。本基金持有的流通受限股票“润泽科技”（证券代码：300442）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 340,715 股（根据润泽智算科技集团股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告，润泽科技以公司现有总股本 953,867,583 股为基数，向全体股东每 10 股转增 8 股，除权除息日为 2023 年 5 月 24 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券收和款项清算，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	138,091,736.97	-	-	-	-	-	138,091,736.97
结 算 备 付 金	4,685,250.18	-	-	-	-	-	4,685,250.18
存 出 保 证 金	533,913.08	-	-	-	-	-	533,913.08
交 易 性 金 融 资 产	28,944,159.81	-	36,630,315.89	-	-	2,523,094,325.08	2,588,668,800.78
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
买	-	-	-	-	-	-	-

入 返 售 金 融 资 产							
债 权 投 资	-	-	-	-	-	-	-
应 收 清 算 款	-	-	-	-	-	17,398,736.72	17,398,736.72
应 收 股 利	-	-	-	-	-	-	-
应 收 申 购 款	-	-	-	-	-	508,726.27	508,726.27
递 延 所 得 税 资 产	-	-	-	-	-	-	-
其 他 资 产	-	-	-	-	-	-	-
资 产 总 计	172,255,060.04	-	36,630,315.89	-	-	2,541,001,788.07	2,749,887,164.00
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	-	-	-	-	-	11,367,193.88	11,367,193.88
应付赎回款	-	-	-	-	-	508,346.87	508,346.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,381,328.94	3,381,328.94
应付托	-	-	-	-	-	563,554.84	563,554.84

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	42.01	42.01
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,798,631.75	2,798,631.75
负债总计	-	-	-	-	-	18,619,098.29	18,619,098.29
利率敏感度	172,255,060.04	-	36,630,315.89	-	-	2,522,382,689.78	2,731,268,065.71

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	42,970,833.08	-	-	-	-	-	42,970,833.08
结算备付金	4,735,353.45	-	-	-	-	-	4,735,353.45
存出保证金	576,648.58	-	-	-	-	-	576,648.58
交易性金融资产	25,811,302.60	4,992,775.12	78,236,815.61	-	-	2,288,823,833.16	2,397,864,726.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入	-	-	-	-	-	-	-

返售金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	8,609,870.41	8,609,870.41
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	336,114.27	336,114.27
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	74,094,137.71	4,992,775.12	78,236,815.61	-	-	2,297,769,817.84	2,455,093,546.28
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	-	-	-	-	-	641,584.13	641,584.13
应付赎回款	-	-	-	-	-	289,297.80	289,297.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,164,883.71	3,164,883.71
应付托管	-	-	-	-	-	527,480.61	527,480.61

费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	4.86	4.86
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,023,887.73	2,023,887.73
负债总计	-	-	-	-	-	6,647,138.84	6,647,138.84
利率敏感度缺	74,094,137.71	4,992,775.12	78,236,815.61	-	-	2,291,122,679.00	2,448,446,407.44



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	29,879.06	105,964.03
	基准利率增加 25 个基点	-29,834.06	-105,652.33

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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	2,523,094,325.08	92.38	2,288,823,833.16	93.48
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	65,574,475.70	2.40	109,040,893.33	4.45
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,588,668,800.78	94.78	2,397,864,726.49	97.93

#### 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
	中证民营企业综合指数上涨 5%	138,083,354.05	114,194,166.15
	中证民营企业综合指数下跌 5%	-138,083,354.05	-114,194,166.15

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	2,492,880,686.12
第二层次	60,414,640.01
第三层次	35,373,474.65
合计	2,588,668,800.78

### 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	2,523,094,325.08	91.75
	其中：股票	2,523,094,325.08	91.75
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	65,574,475.70	2.38
	其中：债券	65,574,475.70	2.38
	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	142,776,987.15	5.19
8	其他各项资产	18,441,376.07	0.67
9	合计	2,749,887,164.00	100.00

## 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	110,055.00	0.00
B	采矿业	99,185.23	0.00
C	制造业	1,404,508,480.37	51.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	9,263,653.02	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	30,864.63	0.00
H	住宿和餐饮业	11,777.40	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	862,802,665.62	31.59
J	金融业	155,712,494.20	5.70
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	71,630,391.14	2.62
N	水利、环境和公共设施管理业	138,441.65	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	18,718,673.56	0.69
R	文化、体育和娱乐业	21,679.64	0.00
S	综合	—	—
	合计	2,523,094,325.08	92.38

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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	300003	乐普医疗	6,120,991	138,395,606.51	5.07
2	300033	同花顺	760,500	133,300,440.00	4.88
3	002236	大华股份	5,777,400	114,103,650.00	4.18
4	300170	汉得信息	7,396,300	85,353,302.00	3.13
5	603039	泛微网络	1,023,165	83,520,958.95	3.06
6	002230	科大讯飞	1,212,756	82,418,897.76	3.02
7	600872	中炬高新	2,096,300	77,122,877.00	2.82
8	300825	阿尔特	3,912,500	71,559,625.00	2.62
9	603613	国联股份	1,880,785	69,457,390.05	2.54
10	688111	金山办公	127,013	59,978,078.86	2.20
11	688099	晶晨半导体	594,579	50,134,901.28	1.84
12	688301	奕瑞科技股份有限公司	173,819	49,091,700.17	1.80
13	603000	人民网	1,616,639	47,205,858.80	1.73
14	688212	澳华内镜	684,000	46,443,600.00	1.70
15	688290	景业智能	690,966	46,094,341.86	1.69
16	002174	游族网络	2,668,400	44,829,120.00	1.64
17	601233	桐昆股份	3,213,599	42,580,186.75	1.56
18	600570	恒生电子	960,076	42,521,766.04	1.56
19	300633	开立医疗	776,358	42,311,511.00	1.55
20	688231	隆达超合金股份	1,456,401	41,551,120.53	1.52
21	688181	八亿时空液晶股份	1,465,551	41,313,882.69	1.51

22	688182	灿勤科技	1,605,381	40,503,762.63	1.48
23	002242	九阳股份	2,512,133	37,556,388.35	1.38
24	688363	华熙生物	398,222	35,505,473.52	1.30
25	002558	巨人网络	1,961,495	35,169,605.35	1.29
26	002955	鸿合科技	1,468,190	34,575,874.50	1.27
27	002315	焦点科技	841,500	33,660,000.00	1.23
28	002463	沪电股份	1,592,700	33,351,138.00	1.22
29	000063	中兴通讯	732,083	33,339,059.82	1.22
30	000938	紫光股份	1,023,760	32,606,756.00	1.19
31	688256	寒武纪科技	170,338	32,023,544.00	1.17
32	000066	中国长城	2,282,100	31,561,443.00	1.16
33	603383	顶点软件	542,000	30,037,640.00	1.10
34	600330	天通股份	2,472,904	29,477,015.68	1.08
35	688158	优刻得科技	1,519,289	28,684,176.32	1.05
36	300260	新莱应材	704,320	27,834,726.40	1.02
37	688095	福昕软件开发	217,804	27,526,069.52	1.01
38	600446	金证股份	1,881,600	27,358,464.00	1.00
39	002332	仙琚制药	2,063,300	27,338,725.00	1.00
40	002438	江苏神通	2,380,925	27,333,019.00	1.00
41	688387	中信科移动	3,143,731	26,250,153.85	0.96
42	301061	匠心家居	699,578	25,849,407.10	0.95
43	300773	拉卡拉	1,407,000	24,538,080.00	0.90

44	002675	东诚药业	1,599,100	23,522,761.00	0.86
45	300442	润泽科技	766,609	22,691,626.40	0.83
46	600063	皖维高新	4,470,691	22,576,989.55	0.83
47	688498	源杰科技	72,936	20,786,760.00	0.76
48	002993	奥海科技	594,880	20,178,329.60	0.74
49	688271	联影医疗	145,092	20,024,146.92	0.73
50	002043	兔宝宝	1,688,300	18,419,353.00	0.67
51	601318	中国平安	361,400	16,768,960.00	0.61
52	002044	美年健康	2,307,500	16,406,325.00	0.60
53	002555	三七互娱	439,000	15,312,320.00	0.56
54	603283	赛腾股份	342,700	15,250,150.00	0.56
55	688575	亚辉龙生物	804,911	14,850,607.95	0.54
56	000333	美的集团	242,900	14,311,668.00	0.52
57	600276	恒瑞医药	298,100	14,278,990.00	0.52
58	000513	丽珠集团	359,400	13,984,254.00	0.51
59	000682	东方电子	1,310,009	12,733,287.48	0.47
60	002068	黑猫股份	1,057,700	12,554,899.00	0.46
61	000503	国新健康	910,100	10,912,099.00	0.40
62	300763	锦浪科技	100,000	10,114,000.00	0.37
63	300308	中际旭创	66,200	9,761,190.00	0.36
64	688420	天津美腾科技	206,797	8,009,247.81	0.29
65	688031	星环科技	59,878	7,978,144.72	0.29

66	300451	创业慧康	894,600	7,496,748.00	0.27
67	603889	新澳股份	979,580	7,356,645.80	0.27
68	000988	华工科技	180,000	6,841,800.00	0.25
69	688195	腾景科技	122,136	6,525,726.48	0.24
70	301177	迪阿股份	147,866	5,682,490.38	0.21
71	002436	兴森科技	364,600	5,651,300.00	0.21
72	300059	东方财富	397,401	5,643,094.20	0.21
73	688630	芯碁微装	64,362	5,407,695.24	0.20
74	301085	亚康股份	49,300	3,477,622.00	0.13
75	000821	京山轻机	159,700	3,267,462.00	0.12
76	603699	纽威股份	210,400	3,130,752.00	0.11
77	688058	宝兰德软件	52,632	2,999,497.68	0.11
78	300092	科新机电	177,800	2,915,920.00	0.11
79	002281	光迅科技	75,400	2,796,586.00	0.10
80	003031	中瓷电子	20,600	2,742,272.00	0.10
81	600498	烽火通信	132,900	2,707,173.00	0.10
82	300502	新易盛	39,400	2,678,018.00	0.10
83	603882	金域医学	29,500	2,227,250.00	0.08
84	688378	奥来德光电	44,566	2,201,560.40	0.08
85	301325	曼恩斯特	14,100	1,614,450.00	0.06
86	688506	百利天恒药业	15,622	1,115,098.36	0.04
87	688410	山外山血液净化	4,853	254,782.50	0.01



88	688403	汇成股份	18,553	226,717.66	0.01
89	688458	美芯晟科技	2,206	210,955.41	0.01
90	688581	安杰思医学	1,629	198,809.23	0.01
91	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.01
92	301262	海看股份	6,917	190,389.75	0.01
93	688152	麒麟信安	1,772	163,520.16	0.01
94	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.01
95	688433	华曙高科	4,171	140,769.00	0.01
96	688259	创耀通信科技	1,595	126,244.25	0.00
97	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.00
98	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
99	603477	巨星农牧	3,300	110,055.00	0.00
100	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.00
101	688472	阿特斯阳光电力	6,261	106,687.44	0.00
102	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
103	688479	用友汽车信息科技	3,318	103,760.10	0.00
104	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.00
105	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.00
106	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
107	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
108	688307	中润光学	2,455	80,253.95	0.00

109	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
110	688793	倍轻松科技	1,454	78,370.60	0.00
111	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
112	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
113	688480	赛恩斯环保	2,302	71,269.92	0.00
114	688193	仁度生物	1,635	70,435.80	0.00
115	688517	金冠电气	2,892	63,508.32	0.00
116	301267	华夏眼科	1,006	61,315.70	0.00
117	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.00
118	001380	华伟科技	1,694	54,899.76	0.00
119	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
120	600588	用友网络	2,200	45,100.00	0.00
121	688146	中船派瑞特气	1,011	38,549.43	0.00
122	001311	多利科技	649	37,272.07	0.00
123	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
124	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
125	301162	国能日新	468	36,915.84	0.00
126	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
127	301200	大族数控	857	34,177.16	0.00
128	301367	怡和嘉业	223	33,079.82	0.00
129	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
130	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00

131	301109	军信股份	1,838	30,345.38	0.00
132	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
133	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
134	301207	华兰疫苗	854	28,404.04	0.00
135	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
136	301268	铭利达	641	26,838.67	0.00
137	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
138	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
139	301263	泰恩康	1,228	25,640.64	0.00
140	603255	鼎际得股份	488	24,770.88	0.00
141	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.00
142	301311	昆船智能	832	24,527.36	0.00
143	301356	天振股份	1,105	24,199.50	0.00
144	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
145	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
146	301286	侨源股份	784	23,128.00	0.00
147	301389	隆扬电子	1,269	23,070.42	0.00
148	301339	通行宝	913	22,943.69	0.00
149	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
150	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
151	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.00
152	301366	一博科技	482	20,942.90	0.00
153	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.00
154	301185	鸥玛软件	578	19,085.56	0.00
155	301317	鑫磊股	694	18,161.98	0.00

		份			
156	301179	泽宇智能	531	17,894.70	0.00
157	301377	鼎泰高科	770	17,710.00	0.00
158	603209	兴通股份	833	17,667.93	0.00
159	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
160	301096	百诚医药	272	16,485.92	0.00
161	688562	航天软件股份	726	16,197.06	0.00
162	301187	欧圣电气	876	16,179.72	0.00
163	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
164	603282	亚光科技股份	457	15,771.07	0.00
165	301396	宏景科技	475	15,508.75	0.00
166	300834	星辉环材	635	15,494.00	0.00
167	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
168	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
169	301280	珠城科技	419	14,983.44	0.00
170	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
171	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
172	301201	诚达药业	353	14,543.60	0.00
173	603070	万控智造	775	14,484.75	0.00
174	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
175	301335	天元宠物	588	14,017.92	0.00
176	301338	凯格精机	360	14,004.00	0.00
177	301212	联盛化	416	13,619.84	0.00

		学			
178	301349	信德新材	270	13,537.80	0.00
179	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
180	301235	华康医疗	418	13,300.76	0.00
181	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
182	688629	四川华丰科技	708	13,161.72	0.00
183	603153	上海建科集团	740	13,135.00	0.00
184	603097	江苏华辰	577	13,074.82	0.00
185	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
186	301199	迈赫股份	402	12,799.68	0.00
187	301365	矩阵股份	774	12,740.04	0.00
188	603051	鹿山新材	272	12,737.76	0.00
189	301379	天山电子	449	12,540.57	0.00
190	688620	安凯微电子	1,016	12,537.44	0.00
191	301052	果麦文化	252	12,428.64	0.00
192	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
193	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
194	301073	君亭酒店	324	11,777.40	0.00
195	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
196	603170	宝立食品科技	542	11,522.92	0.00
197	301180	万祥科技	654	11,464.62	0.00
198	688523	航天环宇科技	472	11,257.20	0.00
199	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
200	603135	中重科	628	11,234.92	0.00

		技			
201	301148	嘉戎技术	516	11,032.08	0.00
202	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
203	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
204	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
205	601065	江西省盐业集团	875	10,360.00	0.00
206	301110	青木股份	202	10,186.86	0.00
207	301181	标榜股份	334	10,050.06	0.00
208	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
209	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
210	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
211	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
212	301176	逸豪新材	544	9,345.92	0.00
213	301135	瑞德智能	338	9,267.96	0.00
214	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
215	301196	唯科科技	271	9,200.45	0.00
216	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
217	301116	益客食品	577	8,885.80	0.00
218	301126	达嘉维康	662	8,870.80	0.00
219	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
220	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
221	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00

222	301092	争光股份	323	8,456.14	0.00
223	301118	恒光股份	315	8,419.95	0.00
224	301283	聚胶股份	235	8,337.80	0.00
225	688535	华海诚科新材料	161	8,248.03	0.00
226	301285	鸿日达	565	8,186.85	0.00
227	601133	柏诚系统股份公司	664	8,140.64	0.00
228	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
229	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
230	301227	森鹰窗业	284	7,875.32	0.00
231	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
232	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
233	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
234	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
235	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
236	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
237	301300	远翔新材	211	6,667.60	0.00
238	301309	万得凯	228	6,279.12	0.00
239	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
240	603125	江苏常青树科技	160	3,924.80	0.00
241	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
242	300854	中兰环保	203	3,227.70	0.00
243	603589	口子窖	65	3,207.75	0.00

244	300595	欧普康视	100	3,019.00	0.00
245	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
246	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
247	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
248	871245	威博液压	200	1,712.00	0.00
249	300347	泰格医药	11	709.94	0.00
250	301062	上海艾录	47	497.73	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	300033	同花顺	159,590,222.70	6.52
2	002230	科大讯飞	140,035,126.78	5.72
3	002236	大华股份	117,241,919.60	4.79
4	600872	中炬高新	91,884,154.69	3.75
5	000063	中兴通讯	87,899,259.68	3.59
6	603000	人民网	73,245,995.92	2.99
7	002174	游族网络	70,351,135.00	2.87
8	300059	东方财富	69,547,672.15	2.84
9	000938	紫光股份	65,756,147.00	2.69
10	600771	广誉远	64,528,589.30	2.64
11	600446	金证股份	63,560,668.53	2.60
12	688261	东微半导体	61,355,520.43	2.51
13	002955	鸿合科技	60,508,605.48	2.47
14	688111	金山办公	56,230,274.26	2.30
15	002315	焦点科技	55,514,782.35	2.27
16	301177	迪阿股份	54,996,176.61	2.25
17	688099	晶晨半导体	54,569,759.91	2.23
18	688158	优刻得科	52,553,401.14	2.15



		技		
19	600570	恒生电子	52,369,557.38	2.14
20	688131	皓元医药	47,560,430.14	1.94

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	300059	东方财富	207,839,845.34	8.49
2	002410	广联达	121,533,467.87	4.96
3	000683	远兴能源	105,149,929.44	4.29
4	002230	科大讯飞	101,700,297.00	4.15
5	600399	抚顺特钢	84,062,548.50	3.43
6	300748	金力永磁	77,305,701.57	3.16
7	688111	金山办公	72,898,049.79	2.98
8	600771	广誉远	65,458,375.95	2.67
9	000063	中兴通讯	65,115,743.54	2.66
10	688208	道通科技	64,723,266.51	2.64
11	600330	天通股份	61,357,268.71	2.51
12	300598	诚迈科技	52,373,562.52	2.14
13	300229	拓尔思	49,902,933.58	2.04
14	300856	科思股份	48,850,235.85	2.00
15	688261	东微半导体	48,233,521.19	1.97
16	300003	乐普医疗	47,918,373.70	1.96
17	600872	中炬高新	47,609,599.00	1.94
18	603000	人民网	46,140,813.00	1.88
19	301177	迪阿股份	40,877,270.80	1.67
20	688131	皓元医药	39,345,942.21	1.61

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	3,781,830,084.27
卖出股票收入（成交）总额	3,723,178,960.63

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	60,010,238.27	2.20
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）	5,564,237.43	0.20
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	65,574,475.70	2.40

## 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	019663	21 国债 15	254,000	25,911,674.30	0.95
2	019638	20 国债 09	125,000	12,792,941.78	0.47
3	019688	22 国债 23	106,000	10,718,641.59	0.39
4	019679	22 国债 14	104,000	10,586,980.60	0.39
5	110077	洪城转债	29,000	4,180,154.55	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

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	533,913.08
2	应收清算款	17,398,736.72
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	508,726.27
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	18,441,376.07

### 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	110077	洪城转债	4,180,154.55	0.15
2	118025	奕瑞转债	1,384,082.88	0.05

### 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（%）
113,054	5,013.66	15,419,366.25	2.72	551,394,939.34	97.28

### 8.2 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	1,422,098.52	0.25

### 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年05月05日）基金份额总额	1,407,531,401.75
本报告期期初基金份额总额	541,941,339.14
本报告期基金总申购份额	59,165,201.22
减：本报告期基金总赎回份额	34,292,234.77
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	566,814,305.59

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(%)	
国盛证券	2	1,345,809,569.04	18.04	970,732.04	17.44	

中金 财富	2	893,925,593.16	11.98	826,872.25	14.86	
东方 证券	3	841,661,385.32	11.28	607,094.06	10.91	
民生 证券	1	837,007,948.48	11.22	603,732.44	10.85	
光大 证券	2	640,984,552.31	8.59	462,344.73	8.31	
银河 证券	1	624,025,558.03	8.36	450,112.36	8.09	
东方 财富	2	481,496,450.65	6.45	347,806.46	6.25	
方正 证券	2	451,030,574.91	6.04	325,330.37	5.85	
华创 证券	1	326,242,662.48	4.37	235,320.37	4.23	
天风 证券	2	258,717,537.27	3.47	186,610.75	3.35	
信达 证券	2	231,860,232.22	3.11	167,243.12	3.01	
汇丰 前海 证券	2	130,422,161.04	1.75	94,073.62	1.69	
国信 证券	2	128,831,035.22	1.73	92,922.94	1.67	
海通 证券	2	104,470,658.15	1.40	75,351.73	1.35	
招商 证券	2	83,478,973.69	1.12	60,213.53	1.08	
国金 证券	2	45,654,232.69	0.61	32,930.30	0.59	
广发 证券	2	30,314,481.73	0.41	21,865.26	0.39	
太平 洋证 券	2	5,762,988.40	0.08	4,156.87	0.07	
诚通 证券	2	—	—	—	—	
华龙 证券	1	—	—	—	—	
万联 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 (%)
国盛 证券	15,602,964.00	56.44	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	8,085,582.00	29.25	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	3,956,812.96	14.31	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰 前海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华龙 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联 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	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	中证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 11 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 16 日
4	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
5	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
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	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 05 月 26 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民营活力股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富民营活力混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富民营活力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、报告期内汇添富民营活力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](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日