

汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	21
6.3 净资产（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	23
§ 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股票投资明细	61
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	88
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	90
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	90
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	90
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	90
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	90

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	90
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	90
7.12 投资组合报告附注.....	90
§ 8 基金份额持有人信息.....	91
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	91
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	92
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.....	92
§ 9 开放式基金份额变动.....	93
§ 10 重大事件揭示.....	93
10.1 基金份额持有人大会决议.....	93
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.....	93
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	93
10.4 基金投资策略的改变.....	94
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	94
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.....	94
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	94
10.8 其他重大事件.....	98
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	98
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.....	98
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	98
§ 12 备查文件目录.....	98
12.1 备查文件目录.....	99
12.2 存放地点.....	99
12.3 查阅方式.....	99

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富沪深 300 指数增强	
基金主代码	005530	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 03 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	2,006,173,939.52	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005530	010556
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	1,854,853,390.00	151,320,549.52

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以沪深 300 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力求实现超越标的指数的业绩表现和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 * 95% + 活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	王小飞
	联系电话	021-28932888	021-60637103
	电子邮箱	service@99fund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	021-60637228
传真		021-28932998	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200010	100033
法定代表人		李文	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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)	
	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	91,117,633.86	7,247,355.42
本期利润	30,050,401.12	-10,849,143.52
加权平均基金份额本期利润	0.0171	-0.0519

本期加权平均净值利润率	1.37%	-4.18%
本期基金份额净值增长率	1.69%	1.49%
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	427,639,122.45	32,713,511.12
期末可供分配基金份额利润	0.2306	0.2162
期末基金资产净值	2,282,492,512.45	184,034,060.64
期末基金份额净值	1.2306	1.2162
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	-8.03%	-10.02%

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

汇添富沪深 300 指数增强 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	1.72%	0.76%	1.10%	0.83%	0.62%	-0.07%
过去三个月	-2.95%	0.71%	-4.88%	0.79%	1.93%	-0.08%
过去六个月	1.69%	0.73%	-0.69%	0.80%	2.38%	-0.07%
过去一年	-11.01%	0.87%	-13.60%	0.94%	2.59%	-0.07%
自基金	-8.03%	1.08%	-17.56%	1.09%	9.53%	-0.01%

合同生效日起至今						
汇添富沪深 300 指数增强 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	1.69%	0.76%	1.10%	0.83%	0.59%	-0.07%
过去三个月	-3.05%	0.71%	-4.88%	0.79%	1.83%	-0.08%
过去六个月	1.49%	0.73%	-0.69%	0.80%	2.18%	-0.07%
过去一年	-11.37%	0.87%	-13.60%	0.94%	2.23%	-0.07%
自基金合同生效日起至今	-10.02%	1.08%	-18.49%	1.09%	8.47%	-0.01%

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

汇添富沪深300指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富沪深300指数增强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（2020年11月03日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金由原汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金于2020年11月03日转型而来。

本基金C类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2018 年 03 月 23 日		17	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金

				<p>的基金经理。</p> <p>2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金</p>
--	--	--	--	---

				<p>的基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金</p>
--	--	--	--	--

				<p>经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

					<p>2022 年 1 月 27 日至今任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至今任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。</p>
许一尊	本基金的基金经理	2018 年 03 月 23 日		13	<p>国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。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，现任指数与量化投资部基金经理。2015 年 11 月 24 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300</p>

					<p>指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 2 日至今任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至今任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至今任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 800 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月 19 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规

规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 25 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析,未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2023 年上半年,从基本面角度看,国内经济整体呈现复苏态势,节后复工复产加快,出行运输链持续修复,工业生产逐步复苏,但仍面临内需修复动力不足、外需增长压力较大等挑战。政策层面积极应对,宏观政策调控力度加大,准财政和财政政策逐步落地,旨

在扩大有效需求，做强实体经济，防范化解重点领域风险，推动经济持续回升向好。流动性方面，国内货币政策整体稳中带松，央行通过调降 OMO、SLF、MLF 利率等方式，减轻企业融资成本和居民债务负担压力。外部环境影响复杂，海外加息进入尾声，但贸易争端和汇率波动对市场情绪和资金流动产生一定影响。

受经济复苏节奏、资金边际流向、投资者预期和博弈、ChatGPT 引发的人工智能热潮、央企价值重估等因素的影响，上半年市场区间震荡，行业和风格波动较大：行业板块方面，AI 及中特估相关板块上涨较多，地产链及消费板块跌幅靠前；风格方面，上半年整体仍呈现小盘优于大盘、价值优于成长的特性。量化选股因子方面，低波动、估值、质量等逆向类因子以及交易类因子仍延续之前的较好表现，与此同时，成长、盈利、预期等因子整体表现一般。

报告期内，本基金遵循指数增强基金的投资原则，相对业绩比较基准保持了相对均衡的行业配置和风格配置，在预期、成长、盈利、质量、估值、市场面等各类选股因子上保持了相对均衡的暴露，跟踪误差在预期范围内。团队在新因子开发、因子配置模型上持续努力，一些创新类因子整体表现出色，对超额收益有所贡献。未来仍需要不断推进对量化选股模型的迭代优化，提升组合精细化管理和对市场风格变动的适应能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富沪深 300 指数增强 A 类份额净值增长率为 1.69%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%。本报告期汇添富沪深 300 指数增强 C 类份额净值增长率为 1.49%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%。

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，一些制约市场上涨的不利因素正在逐步消退：疫情造成的冲击正在减弱，消费逐步复苏；地产相关的风险因素得到有效控制；海外通胀有望逐步得到控制，外部流动性边际宽松；海外地区冲突造成的不确定性逐步被市场消化；AI 等科技创新有望推动产业革新和提升生产力。总体来看，投资面临的不确定性可能会降低。然而，我们也需要看到一些中长期的挑战：国内经济面临着需求收缩、供给冲击、预期转弱等“三重压力”，虽然正在缓解，但克服这些问题仍需要时间；疫情带来的“疤痕效应”消退是一个中长期过程，消费将在波折中逐步复苏；地产链的风险在短期内逐步化解，但长期受城镇化程度、人口结构和出生率等因素影响；国际格局方面，中美竞争有边际缓和迹象，但竞争的长期性和多方位性可能使全球供应链更为脆弱，各国相比以往更重视战略安全，不再将效率作为经济发展的首要着眼点。总体来说，机遇大于挑战，我们有理由对市场前景更为乐观。

目前 A 股整体估值仍然处于历史低位，具有较高的估值性价比和安全边际。市场整体波动率和交易活跃度处于历史极低水平，向下空间有限。随着经济复苏和市场信心修复，市场很可能迎来较好的投资机会。在行业方面，科技创新、消费复苏和战略安全相关行业仍可能存在相对长期的投资机会。在风格方面，随着经济的复苏和外部不确定性的降低，投资者可能重新拉长“投资久期”，关注公司的长期成长性和业绩弹性，成长和价值风格间可能出现一定的再平衡。选股因子表现也有望更为均衡，除了上半年表现较好的质量、估值、交易类因子外，基本面趋势相关的成长、盈利、预期类因子也可能出现超额修复。

汇添富沪深 300 指数增强基金使用量化选股模型挑选个股，同时保持风格和行业的相对均衡，具有较鲜明的大盘风格。随着经济企稳，经济关联度高，基本面质地优良，估值合理的大市值公司可能有所表现，给沪深 300 增强带来较好的投资机会。未来，我们将进一步加大量化模型的研究深度，扩展新技术、新数据在量化投资中的应用，提高信息的发掘和利用效率，提升风险管理和组合精细化管理能力。汇添富沪深 300 指数增强基金将继续严格遵守基金合同，追求相对业绩比较基准的较为稳定的超额收益。

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相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	140,630,362.63	111,754,482.06
结算备付金		5,828,947.59	13,436,381.95
存出保证金		588,968.38	558,656.88
交易性金融资产	6.4.7.2	2,315,746,679.52	2,010,461,465.86
其中：股票投资		2,315,746,679.52	2,005,360,417.91
基金投资		-	-

债券投资		-	5,101,047.95
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		9,076,158.30	23,056,239.13
应收股利		-	-
应收申购款		28,214,626.06	639,404.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,500,085,742.48	2,159,906,630.30
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		-	24,796,307.12
应付赎回款		27,661,369.64	112,906.17
应付管理人报酬		1,632,278.85	1,433,137.39
应付托管费		408,069.72	358,284.37
应付销售服务费		69,642.63	20,052.72
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	6.4.7.7	3,787,808.55	3,235,723.02
负债合计		33,559,169.39	29,956,410.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	2,006,173,939.52	1,760,736,099.19
未分配利润	6.4.7.9	460,352,633.57	369,214,120.32
净资产合计		2,466,526,573.09	2,129,950,219.51
负债和净资产总计		2,500,085,742.48	2,159,906,630.30

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,006,173,939.52 份。本基金下属汇添富沪深 300 指数增强 A 基金份额净值 1.2306 元，基金份额总额 1,854,853,390.00 份；本基金下属汇添富沪深 300 指数增强 C 基金份额净值 1.2162 元，基金份额总额 151,320,549.52

份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金

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		32,208,226.17	-10,343,092.58
1. 利息收入		307,797.74	62,714.79
其中：存款利息收入	6.4.7.10	307,797.74	62,714.79
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）		110,151,501.78	-25,078,765.57
其中：股票投资收益	6.4.7.11	79,511,227.16	-30,051,759.46
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	325,525.83	295,198.84
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	30,314,748.79	4,677,795.05
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	-79,163,731.68	14,583,155.89
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	912,658.33	89,802.31
减：二、营业总支出		13,006,968.57	2,240,055.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,757,916.95	1,618,999.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,439,479.26	404,749.83
3. 销售服务费		508,363.80	21,662.89
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		0.22	0.87
8. 其他费用	6.4.7.21	301,208.34	194,642.56
三、利润总额（亏损总额以“-”		19,201,257.60	-12,583,148.16

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,201,257.60	-12,583,148.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19,201,257.60	-12,583,148.16

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金

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）	1,760,736,099.19	369,214,120.32	2,129,950,219.51
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,760,736,099.19	369,214,120.32	2,129,950,219.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	245,437,840.33	91,138,513.25	336,576,353.58
（一）、综合收益总额	-	19,201,257.60	19,201,257.60
（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）	245,437,840.33	71,937,255.65	317,375,095.98
其中：1. 基金申购款	777,249,767.72	197,872,482.35	975,122,250.07
2. 基金赎回款	-531,811,927.39	-125,935,226.70	-657,747,154.09
（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）	2,006,173,939.52	460,352,633.57	2,466,526,573.09

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)	240,097,259.73	171,103,746.21	411,201,005.94
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	240,097,259.73	171,103,746.21	411,201,005.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,685,316.75	11,464,961.41	62,150,278.16
（一）、综合收益总额	-	-12,583,148.16	-12,583,148.16
（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）	50,685,316.75	24,048,109.57	74,733,426.32
其中：1. 基金申购款	102,919,643.25	53,065,244.16	155,984,887.41
2. 基金赎回款	-52,234,326.50	-29,017,134.59	-81,251,461.09
（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)	290,782,576.48	182,568,707.62	473,351,284.10

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：

张暉	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），是由汇添富价值多因

子量化策略股票型证券投资基金变更而来。原汇添富价值多因子量化策略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[2017]1062 号文《关于准予汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2018 年 3 月 23 日生效。首次设立基金募集规模为 361,461,540.37 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2018）验字第 60466941_B17 号验资报告予以验证。

根据《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会于 2020 年 11 月 2 日表决通过了《关于汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金转型的议案》。自 2020 年 11 月 3 日起，本基金名称变更为“汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金”。《汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 3 日起生效，原《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于同一日起失效。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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

自 2020 年 11 月 3 日起，本基金增设 C 类基金份额，原基金份额变更为 A 类基金份额，基金注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司。

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（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产及存托凭证占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，

基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 95%+活期存款利率（税后） \times 5%。

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	140, 630, 362. 63
等于: 本金	140, 615, 995. 86

加：应计利息	14,366.77
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	140,630,362.63

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	2,390,487,154.67	-	2,315,746,679.52	-74,740,475.15
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	2,390,487,154.67	-	2,315,746,679.52	-74,740,475.15

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	22,114.38
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,516,650.44
其中：交易所市场	3,516,100.44
银行间市场	550.00
应付利息	-
应付审计费	84,712.18
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	104,824.18
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	3,787,808.55

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富沪深 300 指数增强 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	1,686,363,362.39	1,686,363,362.39
本期申购	377,183,715.57	377,183,715.57

本期赎回（以“-”号填列）	-208,693,687.96	-208,693,687.96
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,854,853,390.00	1,854,853,390.00
汇添富沪深 300 指数增强 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	74,372,736.80	74,372,736.80
本期申购	400,066,052.15	400,066,052.15
本期赎回（以“-”号填列）	-323,118,239.43	-323,118,239.43
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	151,320,549.52	151,320,549.52

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

汇添富沪深 300 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	362,623,216.23	-8,167,066.47	354,456,149.76
本期利润	91,117,633.86	-61,067,232.74	30,050,401.12
本期基金份额交易产生的变动数	48,103,480.40	-4,970,908.83	43,132,571.57
其中：基金申购款	98,848,947.11	1,583,796.72	100,432,743.83
基金赎回款	-50,745,466.71	-6,554,705.55	-57,300,172.26
本期已分配利润	-	-	-

本期末	501,844,330.49	-74,205,208.04	427,639,122.45
汇添富沪深 300 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	26,815,170.40	-12,057,199.84	14,757,970.56
本期利润	7,247,355.42	-18,096,498.94	-10,849,143.52
本期基金份额交易产生的变动数	28,440,710.15	363,973.93	28,804,684.08
其中：基金申购款	162,459,136.56	-65,019,398.04	97,439,738.52
基金赎回款	-134,018,426.41	65,383,371.97	-68,635,054.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,503,235.97	-29,789,724.85	32,713,511.12

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	239,219.52
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	62,406.37
其他	6,171.85
合计	307,797.74

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	5,010,336,195.82
减：卖出股票成本总额	4,917,566,624.19
减：交易费用	13,258,344.47
买卖股票差价收入	79,511,227.16

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	150,393.91
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	175,131.92
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	325,525.83

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	75,533,437.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	74,823,605.00
减：应计利息总额	534,128.22
减：交易费用	572.34
买卖债券差价收入	175,131.92

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	30,314,748.79
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	30,314,748.79

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	-79,163,731.68
——股票投资	-79,163,341.68
——债券投资	-390.00
——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	-79,163,731.68

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	912,658.33
替代损益	-
其他	-
合计	912,658.33

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	2,830.45
指数使用费	195,158.34
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	301,208.34

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
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	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	1,684,241,024.34	16.34	137,811,929.96	6.31

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	-	-	82,323.30	4.81

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	1,214,837.41	16.34	645,633.91	18.36
关联方名	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			

称	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	99,801.74	6.37	67,894.03	6.81

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	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	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	9,757,916.95	1,618,999.43
其中：支付销售机构的客户维护费	957,626.34	174,886.38

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	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	2,439,479.26	404,749.83

注：托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人

核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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		
	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	462,408.67	462,408.67
合计	-	462,408.67	462,408.67
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		
	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	7,808.65	7,808.65
合计	-	7,808.65	7,808.65

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 0.40%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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
建设银行	140,630,362.63	239,219.52	33,945,862.93	50,267.88

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	
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	2023年	6个月	新股	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	

	药业	03月30日	月	流通受限						
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	6个月	新股流通	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	

		28 日		受 限						
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	236	7,131.92	6,018.00	
301281	科 源 制 药	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	

301292	海科新源	2023年06月29日	6个交易日	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04
301305	朗坤环境	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57
301307	美利信	2023年04月14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26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87
301315	威士	2023年	6个	新股	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12

	顿	06 月 13 日	月	流 通 受 限						
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 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	6 个 月	新 股 流 通	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	

		17 日		受 限						
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	豪恩光电	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	豪恩光电	2023年06月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36
601061	中信金属	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28
601065	江西省盐业集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	88	911.68	1,041.92
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
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

		日		限						
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	
688146	中船派瑞特气	2023年04月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	
688334	西高院	2023年06月09日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	
688352	硕中科技	2023年04月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	
688361	中科飞测	2023年05月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	
688433	华曙高科	2023年04月07日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	
688443	智翔金泰	2023年06月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	
688458	美	2023	6	新	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	

	芯晟科技	年 05 月 15 日	个 月	股 流 通 受 限						
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	
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	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	

	料									
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	2023	6	新	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	

	斯 信 息	年 06 月 19 日	个 月	股 流 通 受 限						
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代 码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位 ： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代 码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位 ： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“科源制药”（证券代码：301281）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 96 股（根据山东科源制药股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告，科源制药以公司现有总股本 77,350,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 4 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 4 股，除权除息日为 2023 年 5 月 26 日。）。本基金持有的流通受限股票“索辰科技”（证券代码：688507）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 72 股（根据上海索辰信息科技股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告，索辰科技以公司现有总股本 41,333,400 股为基数，向全体股东每股派 0.15 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每股转增 0.48 股，除权除息日为 2023 年 6 月 20 日。）。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	140,630,362.63	-	-	-	-	-	140,630,362.63
结算备付金	5,828,947.59	-	-	-	-	-	5,828,947.59
存出保证金	588,968.38	-	-	-	-	-	588,968.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,315,746,679.52	2,315,746,679.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	9,076,158.30	9,076,158.30
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	28,214,626.06	28,214,626.06
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	147,048,278.60	-	-	-	-	2,353,037,463.88	2,500,085,742.48
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	27,661,369.64	27,661,369.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,632,278.85	1,632,278.85
应付托管费	-	-	-	-	-	408,069.72	408,069.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	69,642.63	69,642.63
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	-	-	-	-	-	3,787,808.55	3,787,808.55
负债总计	-	-	-	-	-	33,559,169.39	33,559,169.39
利率敏感	147,048,278.60	-	-	-	-	2,319,478,294.49	2,466,526,573.09

度缺口							
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	111,754,482.06	-	-	-	-	-	111,754,482.06
结算备付金	13,436,381.95	-	-	-	-	-	13,436,381.95
存出保证金	558,656.88	-	-	-	-	-	558,656.88
交易性金融资产	5,101,047.95	-	-	-	-	2,005,360,417.91	2,010,461,465.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	23,056,239.13	23,056,239.13
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	639,404.42	639,404.42
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	130,850,568.84	-	-	-	-	2,029,056,061.46	2,159,906,630.30
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	-	-	-	-	-	24,796,307.12	24,796,307.12
应付赎回款	-	-	-	-	-	112,906.17	112,906.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,433,137.39	1,433,137.39
应付托管费	-	-	-	-	-	358,284.37	358,284.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	20,052.72	20,052.72
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	-	-	-	-	-	3,235,723.02	3,235,723.02
负债总计	-	-	-	-	-	29,956,410.79	29,956,410.79
利率敏感度缺口	130,850,568.84	-	-	-	-	1,999,099,650.67	2,129,950,219.51

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	-	444.99
	基准利率增加 25 个基点	-	-444.92

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	2,315,746,679.52	93.89	2,005,360,417.91	94.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	5,101,047.95	0.24
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	2,315,746,679.52	93.89	2,010,461,465.86	94.39

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数 上涨 5%	106,718,065.98	96,114,714.11
	沪深 300 指数 下跌 5%	-106,718,065.98	-96,114,714.11

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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	2,314,112,804.18
第二层次	404,401.74
第三层次	1,229,473.60
合计	2,315,746,679.52

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售等情况，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	2,315,746,679.52	92.63
	其中：股票	2,315,746,679.52	92.63
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	146,459,310.22	5.86
8	其他各项资产	37,879,752.74	1.52
9	合计	2,500,085,742.48	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,732,240.00	0.07
B	采矿业	56,463,842.80	2.29
C	制造业	1,050,091,081.26	42.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,924,302.00	2.19
E	建筑业	28,034,631.00	1.14
F	批发和零售业	7,656,645.17	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	73,565,287.60	2.98
H	住宿和餐饮业	8,730,635.02	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,231,129.30	3.21

J	金融业	483,652,451.23	19.61
K	房地产业	13,375,295.00	0.54
L	租赁和商务服务业	3,747,365.12	0.15
M	科学研究和技术服务业	19,312,014.31	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,258,259.90	0.54
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,892,775,179.71	76.74

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,916,929.00	0.24
C	制造业	330,197,121.48	13.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,871,062.47	0.44
E	建筑业	5,685,899.15	0.23
F	批发和零售业	18,760,707.50	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	6,417,523.00	0.26
H	住宿和餐饮业	8,275,476.00	0.34
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,596,352.76	0.84
J	金融业	1,698,961.14	0.07
K	房地产业	1,163,137.00	0.05
L	租赁和商务服务业	2,219,025.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	657,832.48	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	10,487,689.97	0.43
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	422,971,499.81	17.15

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	72,867	123,218,097.00	5.00
2	601318	中国平安	1,325,704	61,512,665.60	2.49
3	300750	宁德时代	229,137	52,424,254.23	2.13
4	600036	招商银行	1,515,642	49,652,431.92	2.01
5	000858	五粮液	229,313	37,508,727.41	1.52
6	002415	海康威视	1,091,280	36,132,280.80	1.46
7	002129	TCL 中环	923,575	30,662,690.00	1.24
8	601166	兴业银行	1,788,273	27,986,472.45	1.13
9	002142	宁波银行	1,032,721	26,127,841.30	1.06
10	600900	长江电力	1,172,900	25,874,174.00	1.05
11	688981	中芯国际	495,500	25,032,660.00	1.01
12	601688	华泰证券	1,781,660	24,533,458.20	0.99
13	600406	国电南瑞	1,003,778	23,187,271.80	0.94
14	600887	伊利股份	779,600	22,078,272.00	0.90
15	601229	上海银行	3,661,721	21,054,895.75	0.85
16	002179	中航光电	457,748	20,758,871.80	0.84
17	601169	北京银行	4,412,200	20,428,486.00	0.83

18	601211	国泰君安	1,424,400	19,927,356.00	0.81
19	600309	万华化学	225,400	19,799,136.00	0.80
20	601006	大秦铁路	2,627,600	19,523,068.00	0.79
21	601328	交通银行	3,287,000	19,064,600.00	0.77
22	601225	陕西煤业	1,042,800	18,968,532.00	0.77
23	300408	三环集团	634,400	18,619,640.00	0.75
24	600690	海尔智家	790,100	18,551,548.00	0.75
25	000725	京东方 A	4,465,700	18,264,713.00	0.74
26	600030	中信证券	905,576	17,912,293.28	0.73
27	000538	云南白药	338,553	17,767,261.44	0.72
28	300760	迈瑞医疗	58,006	17,390,198.80	0.71
29	300316	晶盛机电	242,000	17,157,800.00	0.70
30	600741	华域汽车	917,400	16,935,204.00	0.69
31	002736	国信证券	1,870,859	16,332,599.07	0.66
32	601816	京沪高铁	3,004,800	15,805,248.00	0.64
33	600875	东方电气	843,600	15,733,140.00	0.64
34	600585	海螺水泥	658,700	15,637,538.00	0.63
35	600660	福耀玻璃	428,400	15,358,140.00	0.62
36	600362	江西铜业	796,100	15,109,978.00	0.61
37	603259	药明康德	242,401	15,104,006.31	0.61
38	600884	杉杉股份	981,800	14,864,452.00	0.60
39	601898	中煤能源	1,735,050	14,643,822.00	0.59

40	000895	双汇发展	588,304	14,407,564.96	0.58
41	601668	中国建筑	2,506,500	14,387,310.00	0.58
42	300124	汇川技术	222,700	14,299,567.00	0.58
43	600018	上港集团	2,712,400	14,240,100.00	0.58
44	002001	新和成	917,140	14,123,956.00	0.57
45	000166	申万宏源	3,020,500	13,954,710.00	0.57
46	601288	农业银行	3,848,500	13,585,205.00	0.55
47	002352	顺丰控股	299,500	13,504,455.00	0.55
48	603369	今世缘	255,537	13,492,353.60	0.55
49	601838	成都银行	1,079,700	13,183,137.00	0.53
50	000001	平安银行	1,161,597	13,044,734.31	0.53
51	600219	南山铝业	4,167,500	12,585,850.00	0.51
52	601088	中国神华	403,600	12,410,700.00	0.50
53	688187	时代电气	295,600	12,373,816.00	0.50
54	002410	广联达	377,580	12,267,574.20	0.50
55	300433	蓝思科技	1,027,700	12,085,752.00	0.49
56	688396	华润微电子	224,631	11,772,910.71	0.48
57	000708	中信特钢	732,100	11,596,464.00	0.47
58	600000	浦发银行	1,566,457	11,341,148.68	0.46
59	300142	沃森生物	428,600	11,336,470.00	0.46
60	600050	中国联通	2,335,300	11,209,440.00	0.45
61	600926	杭州银行	945,020	11,103,985.00	0.45
62	601818	光大银	3,586,000	11,009,020.00	0.45

		行			
63	000768	中航西飞	410,200	10,972,850.00	0.44
64	601601	中国太保	420,868	10,934,150.64	0.44
65	600837	海通证券	1,181,500	10,893,430.00	0.44
66	000596	古井贡酒	43,604	10,786,757.52	0.44
67	000651	格力电器	295,270	10,780,307.70	0.44
68	300015	爱尔眼科	571,138	10,594,609.90	0.43
69	600919	江苏银行	1,428,490	10,499,401.50	0.43
70	600941	中国移动	111,000	10,356,300.00	0.42
71	000568	泸州老窖	49,386	10,349,824.02	0.42
72	000877	天山股份	1,208,001	9,833,128.14	0.40
73	002304	洋河股份	73,700	9,680,495.00	0.39
74	688363	华熙生物	108,500	9,673,860.00	0.39
75	600600	青岛啤酒	92,500	9,585,775.00	0.39
76	600015	华夏银行	1,771,400	9,583,274.00	0.39
77	603288	海天味业	204,300	9,571,455.00	0.39
78	600048	保利发展	692,700	9,025,881.00	0.37
79	300014	亿纬锂能	147,100	8,899,550.00	0.36
80	600754	锦江酒店	206,203	8,730,635.02	0.35
81	002311	海大集团	185,500	8,688,820.00	0.35
82	601877	正泰电器	301,200	8,328,180.00	0.34
83	000776	广发证券	561,100	8,253,781.00	0.33

84	000338	潍柴动力	657,500	8,192,450.00	0.33
85	601728	中国电信	1,452,600	8,178,138.00	0.33
86	600104	上汽集团	574,700	8,143,499.00	0.33
87	601615	明阳智能	480,200	8,105,776.00	0.33
88	601985	中国核电	1,143,100	8,058,855.00	0.33
89	601766	中国中车	1,230,900	8,000,850.00	0.32
90	300601	康泰生物	291,372	7,397,935.08	0.30
91	600674	川投能源	491,400	7,395,570.00	0.30
92	000100	TCL 科技	1,847,510	7,279,189.40	0.30
93	600028	中国石化	1,111,730	7,070,602.80	0.29
94	603799	华友钴业	152,441	6,998,566.31	0.28
95	000800	一汽解放	834,788	6,987,175.56	0.28
96	600809	山西汾酒	37,400	6,921,618.00	0.28
97	600893	航发动力	162,081	6,849,543.06	0.28
98	002202	金风科技	640,500	6,802,110.00	0.28
99	601398	工商银行	1,365,800	6,583,156.00	0.27
100	601336	新华保险	166,459	6,120,697.43	0.25
101	600999	招商证券	450,022	6,106,798.54	0.25
102	600760	中航沈飞	135,480	6,096,600.00	0.25
103	002601	龙佰集团	358,100	5,908,650.00	0.24
104	002938	鹏鼎控股	234,700	5,700,863.00	0.23
105	601009	南京银行	712,000	5,696,000.00	0.23

106	600009	上海机场	121,900	5,536,698.00	0.22
107	300122	智飞生物	124,150	5,487,430.00	0.22
108	688126	上海硅产业集团	262,000	5,475,800.00	0.22
109	601600	中国铝业	951,700	5,224,833.00	0.21
110	600745	闻泰科技	103,600	5,066,040.00	0.21
111	600588	用友网络	246,800	5,059,400.00	0.21
112	002271	东方雨虹	180,166	4,911,325.16	0.20
113	600085	同仁堂	84,000	4,835,040.00	0.20
114	300450	先导智能	132,789	4,802,978.13	0.19
115	603659	璞泰来	123,424	4,717,265.28	0.19
116	000963	华东医药	107,800	4,675,286.00	0.19
117	600196	复星医药	150,844	4,661,079.60	0.19
118	601618	中国中冶	1,165,600	4,627,432.00	0.19
119	600436	片仔癀	16,100	4,610,396.00	0.19
120	600886	国投电力	358,100	4,529,965.00	0.18
121	002180	纳思达	131,388	4,500,039.00	0.18
122	600845	宝信软件	88,500	4,496,685.00	0.18
123	003816	中国广核	1,411,400	4,389,454.00	0.18
124	001979	招商蛇口	333,800	4,349,414.00	0.18
125	300347	泰格医药	65,200	4,208,008.00	0.17
126	300919	中伟股份	69,500	4,187,375.00	0.17
127	002064	华峰化学	610,100	4,185,286.00	0.17
128	000157	中联重科	607,900	4,103,325.00	0.17

129	600029	南方航空	660,100	3,980,403.00	0.16
130	000425	徐工机械	567,200	3,839,944.00	0.16
131	601066	中信建投	157,500	3,811,500.00	0.15
132	300896	爱美客	8,500	3,782,075.00	0.15
133	601888	中国中免	33,902	3,747,188.06	0.15
134	002074	国轩高科	132,100	3,648,602.00	0.15
135	601117	中国化学	439,100	3,635,748.00	0.15
136	000333	美的集团	61,643	3,632,005.56	0.15
137	600989	宝丰能源	269,234	3,395,040.74	0.14
138	601901	方正证券	492,400	3,220,296.00	0.13
139	600039	四川路桥	323,600	3,174,516.00	0.13
140	600460	士兰微	103,800	3,142,026.00	0.13
141	002414	高德红外	401,700	3,121,209.00	0.13
142	002648	卫星化学	202,100	3,023,416.00	0.12
143	300207	欣旺达	184,400	3,009,408.00	0.12
144	002007	华兰生物	133,800	2,998,458.00	0.12
145	601607	上海医药	133,037	2,981,359.17	0.12
146	300999	金龙鱼	71,800	2,871,282.00	0.12
147	002252	上海莱士	367,400	2,759,174.00	0.11
148	600332	白云山	85,300	2,719,364.00	0.11
149	600763	通策医疗	27,500	2,663,650.00	0.11
150	688561	奇安信集团	50,100	2,595,681.00	0.11
151	002916	深南电路	33,952	2,558,962.24	0.10
152	601699	潞安环能	144,645	2,360,606.40	0.10

153	300661	圣邦股份	28,700	2,357,131.00	0.10
154	600918	中泰证券	337,000	2,328,670.00	0.09
155	600606	绿地控股	803,500	2,209,625.00	0.09
156	600061	国投资本	308,713	2,198,036.56	0.09
157	300628	亿联网络	61,800	2,167,326.00	0.09
158	600803	新奥股份	112,400	2,133,352.00	0.09
159	688005	容百科技	38,300	2,068,966.00	0.08
160	600183	生益科技	144,900	2,057,580.00	0.08
161	603899	晨光股份	45,400	2,026,656.00	0.08
162	601238	广汽集团	181,000	1,886,020.00	0.08
163	300454	深信服	16,300	1,845,975.00	0.07
164	601878	浙商证券	178,100	1,759,628.00	0.07
165	300498	温氏股份	94,400	1,732,240.00	0.07
166	601100	恒立液压	26,800	1,724,044.00	0.07
167	601216	君正集团	408,100	1,673,210.00	0.07
168	002841	视源股份	23,398	1,563,922.32	0.06
169	600025	华能水电	216,400	1,542,932.00	0.06
170	601377	兴业证券	251,100	1,536,732.00	0.06
171	000876	新希望	129,400	1,511,392.00	0.06
172	600276	恒瑞医药	31,100	1,489,690.00	0.06
173	300957	贝泰妮	15,600	1,386,528.00	0.06
174	603195	公牛集团	13,800	1,325,628.00	0.05
175	603392	万泰生	18,320	1,223,226.40	0.05

		物			
176	600016	民生银行	324,700	1,217,625.00	0.05
177	601808	中海油服	70,745	981,940.60	0.04
178	600233	圆通速递	60,760	884,665.60	0.04
179	601236	红塔证券	115,400	859,730.00	0.03
180	605499	东鹏饮料	2,700	466,830.00	0.02
181	601319	中国人保	42,100	245,864.00	0.01
182	000733	振华科技	1,000	95,850.00	0.00
183	600031	三一重工	5,700	94,791.00	0.00
184	002920	德赛西威	449	69,958.69	0.00
185	600115	中国东航	11,800	56,168.00	0.00
186	601021	春秋航空	600	34,482.00	0.00
187	600570	恒生电子	700	31,003.00	0.00
188	601857	中国石油	3,700	27,639.00	0.00
189	601658	邮储银行	5,300	25,917.00	0.00
190	601998	中信银行	3,800	22,724.00	0.00
191	300274	阳光电源	100	11,663.00	0.00
192	002821	凯莱英	43	5,067.98	0.00
193	300496	中科创达	38	3,661.30	0.00
194	600438	通威股份	25	857.75	0.00
195	600426	华鲁恒升	10	306.30	0.00
196	002027	分众传媒	26	177.06	0.00
197	002709	天赐材	3	123.57	0.00

		料			
--	--	---	--	--	--

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002412	汉森制药	1,280,000	8,409,600.00	0.34
2	601007	金陵饭店	971,300	8,275,476.00	0.34
3	300439	美康生物	639,700	7,235,007.00	0.29
4	600829	人民同泰	1,009,200	7,104,768.00	0.29
5	000919	金陵药业	850,900	6,654,038.00	0.27
6	002661	克明食品	578,300	6,367,083.00	0.26
7	603528	多伦科技	833,200	6,365,648.00	0.26
8	603189	网达软件	403,100	5,921,539.00	0.24
9	300193	佳士科技	736,500	5,626,860.00	0.23
10	002540	亚太科技	901,700	5,211,826.00	0.21
11	300388	节能国祯	731,460	4,908,096.60	0.20
12	002296	辉煌科技	545,700	4,693,020.00	0.19
13	300245	天玑科技	444,000	4,240,200.00	0.17
14	600742	一汽富维	507,200	4,153,968.00	0.17
15	600114	东睦股份	536,000	4,084,320.00	0.17
16	002688	金河生物	826,100	3,899,192.00	0.16
17	000968	蓝焰控股	509,300	3,850,308.00	0.16

18	601956	东贝集团	646,300	3,826,096.00	0.16
19	603989	艾华集团	175,900	3,704,454.00	0.15
20	002614	奥佳华	443,900	3,613,346.00	0.15
21	002635	安洁科技	256,400	3,538,320.00	0.14
22	002940	昂利康	178,465	3,428,312.65	0.14
23	001696	宗申动力	461,600	3,268,128.00	0.13
24	002479	富春环保	683,800	3,186,508.00	0.13
25	002551	尚荣医疗	812,800	3,129,280.00	0.13
26	688330	宏力达信息	87,260	3,061,080.80	0.12
27	002449	国星光电	339,100	3,014,599.00	0.12
28	600523	贵航股份	209,100	3,002,676.00	0.12
29	603897	长城科技	147,100	2,950,826.00	0.12
30	300318	博晖创新	544,800	2,947,368.00	0.12
31	605196	华通线缆	412,572	2,937,512.64	0.12
32	603366	日出东方	489,100	2,841,671.00	0.12
33	300076	GQY 视讯	556,400	2,837,640.00	0.12
34	600231	凌钢股份	1,248,900	2,772,558.00	0.11
35	603309	维力医疗	178,600	2,762,942.00	0.11
36	600184	光电股份	205,877	2,703,165.01	0.11
37	600192	长城电工	464,700	2,690,613.00	0.11
38	002752	昇兴股份	563,100	2,674,725.00	0.11
39	000541	佛山照明	463,400	2,646,014.00	0.11
40	688227	品高股份	106,500	2,644,395.00	0.11

41	601616	广电电气	774,000	2,616,120.00	0.11
42	002855	捷荣技术	242,700	2,545,923.00	0.10
43	000632	三木集团	598,200	2,530,386.00	0.10
44	002350	北京科锐	347,200	2,520,672.00	0.10
45	002566	益盛药业	297,000	2,471,040.00	0.10
46	603020	爱普股份	265,100	2,428,316.00	0.10
47	002391	长青股份	348,600	2,394,882.00	0.10
48	300694	蠡湖股份	221,100	2,350,293.00	0.10
49	000900	现代投资	583,000	2,349,490.00	0.10
50	002082	万邦德	331,000	2,346,790.00	0.10
51	002879	长缆科技	141,500	2,330,505.00	0.09
52	002593	日上集团	598,900	2,317,743.00	0.09
53	600590	泰豪科技	319,982	2,281,471.66	0.09
54	605058	澳弘电子	101,400	2,276,430.00	0.09
55	600894	广日股份	300,100	2,259,753.00	0.09
56	002160	常铝股份	556,400	2,247,856.00	0.09
57	600990	四创电子	70,500	2,230,620.00	0.09
58	603289	泰瑞机器	197,500	2,215,950.00	0.09
59	603689	皖天然气	250,000	2,192,500.00	0.09
60	300195	长荣股份	346,700	2,177,276.00	0.09
61	600261	阳光照明	589,700	2,152,405.00	0.09
62	603106	恒银科技	380,900	2,148,276.00	0.09

63	300817	双飞股份	143,300	2,142,335.00	0.09
64	600668	尖峰集团	184,493	2,125,359.36	0.09
65	002161	远望谷	407,700	2,124,117.00	0.09
66	002580	圣阳股份	226,100	2,123,079.00	0.09
67	002224	三力士	446,800	2,122,300.00	0.09
68	002308	威创股份	450,500	2,121,855.00	0.09
69	000055	方大集团	424,400	2,100,780.00	0.09
70	002783	凯龙股份	235,000	1,959,900.00	0.08
71	002861	瀛通通讯	168,100	1,923,064.00	0.08
72	002977	天箭科技	59,160	1,896,669.60	0.08
73	000705	浙江震元	235,100	1,892,555.00	0.08
74	300375	鹏翎股份	490,200	1,887,270.00	0.08
75	000850	华茂股份	506,800	1,880,228.00	0.08
76	000570	苏常柴A	332,600	1,852,582.00	0.08
77	002676	顺威股份	459,300	1,850,979.00	0.08
78	002282	博深股份	241,100	1,829,949.00	0.07
79	000959	首钢股份	521,600	1,825,600.00	0.07
80	002578	闽发铝业	493,800	1,812,246.00	0.07
81	002333	罗普斯金	297,700	1,801,085.00	0.07
82	603615	茶花股份	189,600	1,789,824.00	0.07
83	000407	胜利股份	490,200	1,789,230.00	0.07
84	002492	恒基达鑫	310,800	1,787,100.00	0.07

85	300719	安达维尔	125,200	1,767,824.00	0.07
86	002666	德联集团	340,400	1,759,868.00	0.07
87	002114	罗平锌电	262,600	1,735,786.00	0.07
88	300932	三友联众	112,300	1,733,912.00	0.07
89	601101	昊华能源	294,700	1,715,154.00	0.07
90	600783	鲁信创投	131,000	1,693,830.00	0.07
91	600513	联环药业	173,400	1,675,044.00	0.07
92	002483	润邦股份	288,033	1,670,591.40	0.07
93	000626	远大控股	223,700	1,666,565.00	0.07
94	600419	天润乳业	102,200	1,657,684.00	0.07
95	301040	中环海陆	80,500	1,654,275.00	0.07
96	000698	沈阳化工	400,300	1,645,233.00	0.07
97	300231	银信科技	184,200	1,641,222.00	0.07
98	300889	爱克股份	108,492	1,624,125.24	0.07
99	002206	海利得	302,000	1,618,720.00	0.07
100	603637	镇海股份	194,300	1,602,975.00	0.06
101	603158	腾龙股份	195,300	1,495,998.00	0.06
102	002480	新筑股份	318,800	1,491,984.00	0.06
103	603817	海峡环保	241,000	1,486,970.00	0.06
104	002381	双箭股份	188,600	1,455,992.00	0.06
105	002322	理工能科	139,800	1,453,920.00	0.06
106	002952	亚世光电	81,700	1,448,541.00	0.06

107	002753	永东股份	197,500	1,439,775.00	0.06
108	002361	神剑股份	351,600	1,423,980.00	0.06
109	002890	弘宇股份	96,340	1,422,941.80	0.06
110	002278	神开股份	261,400	1,393,262.00	0.06
111	300155	安居宝	272,700	1,374,408.00	0.06
112	002922	伊戈尔	95,200	1,366,120.00	0.06
113	600448	华纺股份	457,000	1,357,290.00	0.06
114	002363	隆基机械	179,000	1,342,500.00	0.05
115	603987	康德莱	103,300	1,334,636.00	0.05
116	603316	诚邦股份	216,900	1,331,766.00	0.05
117	002774	快意电梯	166,300	1,322,085.00	0.05
118	300289	利德曼	235,900	1,321,040.00	0.05
119	300281	金明精机	245,900	1,318,024.00	0.05
120	002495	佳隆股份	532,100	1,298,324.00	0.05
121	603002	宏昌电子	250,568	1,290,425.20	0.05
122	002963	豪尔赛	87,900	1,278,945.00	0.05
123	605507	国邦医药	58,400	1,242,168.00	0.05
124	603577	汇金通	122,400	1,201,968.00	0.05
125	688135	利扬芯片	54,709	1,199,768.37	0.05
126	002616	长青集团	234,100	1,198,592.00	0.05
127	002494	华斯股份	258,800	1,198,244.00	0.05
128	603266	天龙股份	85,800	1,193,478.00	0.05
129	000973	佛塑科技	262,800	1,172,088.00	0.05
130	603321	梅轮电梯	147,400	1,148,246.00	0.05
131	600571	信雅达	123,700	1,130,618.00	0.05

132	002981	朝阳科技	46,900	1,130,290.00	0.05
133	300004	南风股份	208,200	1,124,280.00	0.05
134	002364	中恒电气	132,200	1,109,158.00	0.04
135	000619	海螺新材	181,400	1,106,540.00	0.04
136	300241	瑞丰光电	220,700	1,105,707.00	0.04
137	002998	优彩资源	154,300	1,095,530.00	0.04
138	002144	宏达高科	97,500	1,091,025.00	0.04
139	600980	北矿科技	68,700	1,085,460.00	0.04
140	002420	毅昌科技	175,400	1,075,202.00	0.04
141	600697	欧亚集团	86,000	1,058,660.00	0.04
142	001218	丽臣实业	46,800	1,058,148.00	0.04
143	603900	莱绅通灵	166,200	1,043,736.00	0.04
144	603367	辰欣药业	68,400	1,038,312.00	0.04
145	002887	绿茵生态	114,000	1,036,260.00	0.04
146	600883	博闻科技	136,400	1,035,276.00	0.04
147	603729	龙韵股份	68,100	1,016,733.00	0.04
148	603602	纵横通信	81,800	1,005,322.00	0.04
149	300006	莱美药业	293,300	1,003,086.00	0.04
150	600292	远达环保	171,900	1,002,177.00	0.04
151	688360	德马科技	44,800	994,112.00	0.04
152	688669	聚石化学股份	54,200	982,646.00	0.04
153	688038	武汉中科通达	65,670	982,423.20	0.04

154	600724	宁波富达	266,700	978,789.00	0.04
155	300239	东宝生物	156,400	963,424.00	0.04
156	002842	翔鹭钨业	111,900	954,507.00	0.04
157	300283	温州宏丰	160,200	945,180.00	0.04
158	603012	创力集团	152,100	938,457.00	0.04
159	600368	五洲交通	251,700	916,188.00	0.04
160	600300	维维股份	300,200	912,608.00	0.04
161	002923	润都股份	66,700	907,787.00	0.04
162	600232	金鹰股份	164,500	898,170.00	0.04
163	600681	百川能源	192,000	896,640.00	0.04
164	300515	三德科技	54,300	875,316.00	0.04
165	605259	绿田机械	22,400	869,568.00	0.04
166	603488	展鹏科技	107,900	866,437.00	0.04
167	000969	安泰科技	89,900	851,353.00	0.03
168	688571	杭华油墨股份	133,200	840,492.00	0.03
169	600356	恒丰纸业	103,300	808,839.00	0.03
170	300018	中元股份	113,300	771,573.00	0.03
171	000096	广聚能源	95,300	764,306.00	0.03
172	603980	吉华集团	178,300	761,341.00	0.03
173	600569	安阳钢铁	378,200	752,618.00	0.03
174	300099	精准信息	117,800	749,208.00	0.03
175	601366	利群股份	138,000	738,300.00	0.03

176	300808	久量股份	52,800	712,800.00	0.03
177	300279	和晶科技	126,800	708,812.00	0.03
178	603421	鼎信通讯	67,600	706,420.00	0.03
179	002724	海洋王	79,400	689,192.00	0.03
180	603706	东方环宇	45,200	680,260.00	0.03
181	600429	三元股份	140,700	671,139.00	0.03
182	603192	汇得科技	34,100	650,969.00	0.03
183	605001	威奥股份	93,000	650,070.00	0.03
184	603839	安正时尚	85,600	643,712.00	0.03
185	603167	渤海轮渡	90,500	642,550.00	0.03
186	603036	如通股份	60,700	642,206.00	0.03
187	600526	菲达环保	133,200	642,024.00	0.03
188	300865	大宏立	29,600	639,952.00	0.03
189	688689	常州银河微电	24,600	634,680.00	0.03
190	605255	天普股份	40,000	632,000.00	0.03
191	300958	建工修复	35,500	629,770.00	0.03
192	688199	久日新材料	21,100	629,202.00	0.03
193	300137	先河环保	111,000	628,260.00	0.03
194	002620	瑞和股份	120,500	626,600.00	0.03
195	300272	开能健康	118,100	625,930.00	0.03
196	600302	标准股份	116,900	616,063.00	0.02
197	000608	阳光股份	225,000	609,750.00	0.02
198	603041	美思德	49,900	599,798.00	0.02

199	603797	联泰环 保	107,700	598,812.00	0.02
200	002346	柘中股 份	48,100	598,364.00	0.02
201	600735	新华锦	101,202	597,091.80	0.02
202	600113	浙江东 日	81,800	593,050.00	0.02
203	603579	荣泰健 康	28,200	589,944.00	0.02
204	600824	益民集 团	165,200	588,112.00	0.02
205	600843	上工申 贝	100,600	583,480.00	0.02
206	002969	嘉美包 装	148,700	581,417.00	0.02
207	603677	奇精机 械	42,100	569,613.00	0.02
208	603037	凯众股 份	41,600	568,672.00	0.02
209	603166	福达股 份	84,200	567,508.00	0.02
210	002802	洪汇新 材	51,060	564,723.60	0.02
211	002133	广宇集 团	163,100	552,909.00	0.02
212	300611	美力科 技	57,100	550,444.00	0.02
213	003002	壶化股 份	34,100	539,462.00	0.02
214	688011	新光光 电科技 股份	20,700	534,474.00	0.02
215	300658	延江股 份	80,100	524,655.00	0.02
216	002811	郑中设 计	65,300	517,829.00	0.02
217	300968	格林精 密	58,100	516,509.00	0.02
218	300642	透景生 命	25,600	516,352.00	0.02
219	600235	民丰特 纸	94,700	513,274.00	0.02
220	600493	凤竹纺 织	91,500	512,400.00	0.02

221	300883	龙利得	82,000	507,580.00	0.02
222	300512	中亚股份	55,700	504,642.00	0.02
223	300190	维尔利	124,820	498,031.80	0.02
224	603226	菲林格尔	95,000	484,500.00	0.02
225	000605	渤海股份	74,300	469,576.00	0.02
226	600130	波导股份	106,800	464,580.00	0.02
227	002691	冀凯股份	73,300	458,125.00	0.02
228	300717	华信新材	25,600	436,480.00	0.02
229	605378	野马电池	18,700	435,897.00	0.02
230	002826	易明医药	39,500	434,895.00	0.02
231	000913	钱江摩托	23,600	430,228.00	0.02
232	601010	文峰股份	175,200	429,240.00	0.02
233	000417	合肥百货	89,700	419,796.00	0.02
234	603937	丽岛新材	36,200	419,558.00	0.02
235	300126	锐奇股份	63,300	410,817.00	0.02
236	600802	福建水泥	82,900	408,697.00	0.02
237	600796	钱江生化	77,300	405,052.00	0.02
238	300868	杰美特	22,200	404,040.00	0.02
239	300797	钢研纳克	20,400	376,176.00	0.02
240	688096	江苏京源环保	38,000	373,920.00	0.02
241	300210	森远股份	120,200	370,216.00	0.02
242	603682	锦和商管	70,400	369,600.00	0.01
243	001211	双枪科技	16,700	366,231.00	0.01

244	603023	威帝股份	88,000	359,040.00	0.01
245	002674	兴业科技	29,000	358,150.00	0.01
246	300400	劲拓股份	22,000	352,880.00	0.01
247	000655	金岭矿业	55,700	351,467.00	0.01
248	300417	南华仪器	32,300	346,902.00	0.01
249	301190	善水科技	17,900	336,341.00	0.01
250	300412	迦南科技	54,800	324,964.00	0.01
251	300992	泰福泵业	15,400	309,848.00	0.01
252	603339	四方科技	18,200	289,562.00	0.01
253	300411	金盾股份	43,600	285,580.00	0.01
254	002633	申科股份	27,200	285,056.00	0.01
255	300414	中光防雷	28,600	283,140.00	0.01
256	000599	青岛双星	66,200	282,674.00	0.01
257	603916	苏博特	21,200	280,688.00	0.01
258	603948	建业股份	12,700	273,050.00	0.01
259	300941	创识科技	13,200	268,488.00	0.01
260	300074	华平股份	62,200	268,082.00	0.01
261	603787	新日股份	15,600	262,236.00	0.01
262	301228	实朴检测	16,600	258,628.00	0.01
263	600628	新世界	35,300	255,219.00	0.01
264	688219	会通股份	26,400	252,120.00	0.01
265	300929	华骐环保	22,100	250,393.00	0.01
266	300173	福能东	50,000	234,500.00	0.01

		方			
267	300386	飞天诚信	21,200	225,568.00	0.01
268	600830	香溢融通	36,700	224,237.00	0.01
269	300909	汇创达	8,400	221,928.00	0.01
270	603095	越剑智能	14,000	216,300.00	0.01
271	002651	利君股份	27,500	213,675.00	0.01
272	000429	粤高速 A	27,200	213,248.00	0.01
273	605060	联德股份	7,300	200,458.00	0.01
274	002392	北京利尔	53,800	194,756.00	0.01
275	603758	秦安股份	18,300	194,712.00	0.01
276	600033	福建高速	60,800	190,304.00	0.01
277	300230	永利股份	53,000	187,620.00	0.01
278	600284	浦东建设	28,900	176,868.00	0.01
279	603535	嘉诚国际	10,600	172,144.00	0.01
280	603928	兴业股份	14,200	171,394.00	0.01
281	688178	万德斯环保	7,800	151,242.00	0.01
282	605081	太和水	10,100	150,389.00	0.01
283	002671	龙泉股份	35,600	149,876.00	0.01
284	300055	万邦达	19,500	140,400.00	0.01
285	300107	建新股份	28,600	139,854.00	0.01
286	603969	银龙股份	30,100	139,062.00	0.01
287	603739	蔚蓝生物	10,400	136,344.00	0.01
288	688312	燕麦科技	7,000	135,870.00	0.01
289	603053	成都燃	13,300	133,931.00	0.01

		气			
290	300933	中辰股份	16,900	130,130.00	0.01
291	603967	中创物流	14,200	129,788.00	0.01
292	300583	赛托生物	4,800	124,080.00	0.01
293	605056	咸亨国际	8,300	117,611.00	0.00
294	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
295	603313	梦百合	11,330	113,639.90	0.00
296	688472	阿特斯阳光电力	6,261	106,687.44	0.00
297	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
298	603890	春秋电子	11,400	97,584.00	0.00
299	688685	迈信林航空股份	4,514	95,516.24	0.00
300	002106	莱宝高科	11,001	93,508.50	0.00
301	688026	洁特生物股份	5,100	93,177.00	0.00
302	000576	甘化科工	8,600	91,160.00	0.00
303	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
304	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
305	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
306	600774	汉商集团	6,100	77,226.00	0.00
307	002203	海亮股份	6,400	76,864.00	0.00
308	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
309	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
310	600237	铜峰电子	8,100	66,663.00	0.00

311	000559	万向钱潮	11,800	64,310.00	0.00
312	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
313	300566	激智科技	2,900	53,476.00	0.00
314	603886	元祖股份	2,900	53,186.00	0.00
315	603960	克来机电	2,800	52,220.00	0.00
316	300771	智莱科技	4,600	50,094.00	0.00
317	002768	国恩股份	2,000	48,380.00	0.00
318	002438	江苏神通	4,200	48,216.00	0.00
319	603386	骏亚科技	3,600	40,860.00	0.00
320	002801	微光股份	1,500	40,590.00	0.00
321	688146	中船派瑞特气	1,011	38,549.43	0.00
322	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
323	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
324	603228	景旺电子	1,293	33,165.45	0.00
325	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
326	002899	英派斯	2,100	31,437.00	0.00
327	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
328	002310	东方园林	17,200	29,240.00	0.00
329	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
330	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
331	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
332	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
333	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00

334	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
335	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
336	603788	宁波高发	1,820	22,422.40	0.00
337	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
338	601567	三星医疗	1,600	20,208.00	0.00
339	688458	美芯晟科技	221	20,057.96	0.00
340	688581	安杰思医学	163	19,238.89	0.00
341	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
342	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
343	600377	宁沪高速	1,700	16,711.00	0.00
344	002440	闰土股份	2,500	16,675.00	0.00
345	688562	航天软件股份	726	16,197.06	0.00
346	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
347	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
348	600826	兰生股份	1,500	15,405.00	0.00
349	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
350	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
351	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
352	300127	银河磁体	800	14,504.00	0.00
353	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
354	603380	易德龙	600	13,572.00	0.00
355	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
356	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
357	688433	华曙高	418	13,167.00	0.00

		科			
358	688629	四川华丰科技	708	13,161.72	0.00
359	688620	安凯微电子	1,016	12,537.44	0.00
360	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
361	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
362	000967	盈峰环境	2,400	12,120.00	0.00
363	603678	火炬电子	347	11,957.62	0.00
364	603901	永创智能	800	11,648.00	0.00
365	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
366	688523	航天环宇科技	472	11,257.20	0.00
367	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
368	300898	熊猫乳品	496	11,100.48	0.00
369	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
370	600143	金发科技	1,200	10,476.00	0.00
371	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
372	688479	用友汽车信息科技	332	9,790.68	0.00
373	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
374	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
375	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
376	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
377	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
378	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00

379	688535	华海诚科新材料	161	8,248.03	0.00
380	601133	柏诚系统股份公司	664	8,140.64	0.00
381	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
382	000788	北大医药	1,148	7,794.92	0.00
383	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
384	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
385	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
386	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
387	300887	谱尼测试	160	6,332.80	0.00
388	301262	海看股份	236	6,018.00	0.00
389	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
390	300892	品渥食品	227	5,198.30	0.00
391	600643	爱建集团	948	4,740.00	0.00
392	002048	宁波华翔	300	4,020.00	0.00
393	002032	苏泊尔	79	3,950.00	0.00
394	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
395	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
396	300162	雷曼光电	400	2,808.00	0.00
397	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
398	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
399	603060	国检集团	220	2,301.20	0.00

400	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
401	300073	当升科技	31	1,560.23	0.00
402	300679	电连技术	43	1,421.15	0.00
403	300196	长海股份	98	1,357.30	0.00
404	601065	江西省盐业集团	88	1,041.92	0.00
405	300101	振芯科技	50	969.50	0.00
406	300639	凯普生物	75	751.50	0.00
407	603387	基蛋生物	46	592.94	0.00
408	600997	开滦股份	85	507.45	0.00
409	600848	上海临港	40	478.00	0.00
410	002158	汉钟精机	17	424.32	0.00
411	000488	晨鸣纸业	54	261.90	0.00
412	601128	常熟银行	37	252.34	0.00
413	603456	九洲药业	9	246.42	0.00
414	300232	洲明科技	22	201.08	0.00
415	000686	东北证券	20	138.80	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	002415	海康威视	60,093,820.82	2.82
2	601012	隆基绿能	55,003,380.92	2.58

3	600893	航发动力	54,872,016.28	2.58
4	000333	美的集团	52,182,651.75	2.45
5	300760	迈瑞医疗	51,943,236.52	2.44
6	600519	贵州茅台	50,439,873.72	2.37
7	300059	东方财富	47,817,602.85	2.25
8	601318	中国平安	45,055,187.20	2.12
9	300750	宁德时代	42,568,948.80	2.00
10	002475	立讯精密	41,460,471.70	1.95
11	600900	长江电力	38,231,560.00	1.79
12	600309	万华化学	37,009,962.00	1.74
13	601328	交通银行	36,242,355.00	1.70
14	600036	招商银行	35,640,500.00	1.67
15	002129	TCL 中环	35,408,260.50	1.66
16	000725	京东方 A	35,118,946.00	1.65
17	601816	京沪高铁	33,780,680.00	1.59
18	601668	中国建筑	33,135,723.00	1.56
19	600028	中国石化	32,332,615.30	1.52
20	688981	中芯国际	32,278,264.90	1.52

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	300750	宁德时代	65,250,558.06	3.06
2	000333	美的集团	61,683,847.96	2.90
3	002475	立讯精密	57,898,555.39	2.72
4	300059	东方财富	55,900,297.18	2.62
5	600519	贵州茅台	49,265,282.83	2.31
6	002594	比亚迪	48,726,710.42	2.29
7	600893	航发动力	48,683,775.01	2.29
8	000651	格力电器	45,785,828.59	2.15
9	601012	隆基绿能	45,295,175.75	2.13
10	601328	交通银行	43,227,290.00	2.03
11	601899	紫金矿业	42,096,243.00	1.98
12	600030	中信证券	41,671,484.50	1.96
13	601318	中国平安	39,740,238.80	1.87
14	601601	中国太保	39,112,699.99	1.84
15	002049	紫光国微	38,257,054.84	1.80
16	603288	海天味业	34,535,208.72	1.62

17	300760	迈瑞医疗	32,451,330.00	1.52
18	000157	中联重科	31,676,380.00	1.49
19	000063	中兴通讯	31,631,621.39	1.49
20	601336	新华保险	28,930,742.57	1.36

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	5,307,116,227.48
卖出股票收入（成交）总额	5,010,336,195.82

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：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、TCL 中环新能源科技

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

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	588,968.38
2	应收清算款	9,076,158.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,214,626.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,879,752.74

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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	

				(%)		(%)
汇添富沪深 300 指数增强 A	21,755	85,261.02	1,677,661,008.72	90.45	177,192,381.28	9.55
汇添富沪深 300 指数增强 C	4,721	32,052.65	130,131,557.07	86.00	21,188,992.45	14.00
合计	26,476	75,773.30	1,807,792,565.79	90.11	198,381,373.73	9.89

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	汇添富沪深 300 指数增强 A	466,104.87	0.03
	汇添富沪深 300 指数增强 C	7,319.53	0.00
	合计	473,424.40	0.02

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	汇添富沪深 300 指数增强 A	0
	汇添富沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富沪深 300 指数增强 A	0~10
	汇添富沪深 300 指数增强 C	0

	合计	0~10
--	----	------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日 (2020 年 11 月 03 日) 基金份额总额	194,012,600.68	-
本报告期期初基金份 额总额	1,686,363,362.39	74,372,736.80
本报告期基金总申购 份额	377,183,715.57	400,066,052.15
减：本报告期基金总 赎回份额	208,693,687.96	323,118,239.43
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	1,854,853,390.00	151,320,549.52

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。

本报告期内，本基金基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

注：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 (%)	
中信建投证券	4	1,796,478,454.46	17.43	1,295,798.59	17.43	
东方证券	2	1,684,241,024.34	16.34	1,214,837.41	16.34	
东吴证券	3	1,295,145,913.71	12.57	934,171.90	12.57	
申万宏源证券	3	1,053,550,056.13	10.22	759,932.62	10.22	
太平洋证券	1	945,769,210.36	9.18	682,191.19	9.18	
海通证券	4	936,523,138.91	9.09	675,510.19	9.09	

方正证券	2	833,376,710.96	8.09	601,118.63	8.09	
国金证券	2	596,701,693.28	5.79	430,382.09	5.79	
浙商证券	1	578,962,787.07	5.62	417,608.91	5.62	
西部证券	2	392,331,759.03	3.81	282,978.59	3.81	
中泰证券	2	142,558,714.45	1.38	102,828.30	1.38	
中信证券	3	48,761,490.19	0.47	35,171.27	0.47	
安信证券	2	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
川财证券	2	-	-	-	-	
东北证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
华兴证券	2	-	-	-	-	
开源证券	2	-	-	-	-	
上海证券	2	-	-	-	-	
天风证券	2	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
野村东方国际	2	-	-	-	-	
粤开证券	1	-	-	-	-	
招商证券	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 (%)
中信建投证券	2,704,590.00	6.12	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	13,604,421.00	30.80	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	558,326.16	1.26	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	4,999,650.00	11.32	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	8,897,643.00	20.15	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	3,703,626.00	8.39	-	-	-	-	-	-
中泰证券	9,698,463.00	21.96	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村 东方 国际	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 3 家证券公司的 5 个交易单元：广发证券（深交所单元）、开源证券

（上交所单元，深交所单元）、长江证券（上交所单元，深交所单元）；不再租用 1 家证券公司的 1 个交易单元：太平洋证券（上交所单元）。

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价值多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 指数增强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、报告期内汇添富沪深 300 指数增强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