

汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	62
7.1 期末基金资产组合情况	62
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	63
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	81
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	81
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	81
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	81

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
7.12 投资组合报告附注.....	82
§ 8 基金份额持有人信息.....	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	83
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.....	83
§ 9 开放式基金份额变动.....	83
§ 10 重大事件揭示.....	84
10.1 基金份额持有人大会决议.....	84
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.....	84
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
10.4 基金投资策略的改变.....	84
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	84
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.....	84
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	84
10.8 其他重大事件.....	89
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
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.....	90
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
§ 12 备查文件目录.....	90
12.1 备查文件目录.....	90
12.2 存放地点.....	90
12.3 查阅方式.....	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	汇添富稳健添益一年持有混合
基金主代码	010219
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 01 月 20 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	2,263,417,852.66
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	本基金将在有效控制风险的前提下，采用科学的资产配置策略和“自下而上”的精选个券策略，定量与定性分析相结合，力争实现基金资产的长期稳定增值。 本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略和融资投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率（经汇率调整）×7%+中债综合指数收益率×85%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95599
传真	021-28932998	010-68121816
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200010	100031
法定代表人	李文	谷澍

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	11,006,730.16
本期利润	-6,326,165.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0026
本期加权平均净值利润率	-0.27%
本期基金份额净值增长率	-0.34%
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	-104,610,887.67
期末可供分配基金份额利润	-0.0462
期末基金资产净值	2,158,806,964.99
期末基金份额净值	0.9538
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	-4.62%

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	1.22%	0.35%	0.66%	0.15%	0.56%	0.20%
过去三个月	-0.74%	0.29%	0.24%	0.14%	-0.98%	0.15%
过去六个月	-0.34%	0.25%	0.98%	0.14%	-1.32%	0.11%
过去一年	-1.95%	0.25%	-0.30%	0.18%	-1.65%	0.07%
自基金合同生效日起至今	-4.62%	0.26%	-1.40%	0.19%	-3.22%	0.07%

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

汇添富稳健添益一年持有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（2021年01月20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		
李超	本基金的基金经理	2022 年 03 月 07 日		11	国籍：中国。 学历：清华大学工学学士，斯坦福大学管理系以及材料系双硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2013 年至 2019 年历任创金合信基金研究员，安邦资产管理有限责任公司研究员、投资经理助理、投资经理，国金基金管理有限公司基金经理（拟任）等，2019 年 7 月至 2021 年 7 月任大家资产管理有限责任公司高级投资经理。2021 年 7 月至 2022 年 3 月任汇添富基金管理有限公司专

					<p>户投资经理。 2022 年 3 月 7 日至今任汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 7 日至今任汇添富稳健添盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 25 日至今任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 21 日至今任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 12 日至今任汇添富稳健汇盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 29 日至今任汇添富双颐债券型证券投资基金的基金经理。</p>
甘信宇	本基金的基金经理	2022 年 11 月 25 日		7	<p>国籍：中国。 学历：南京大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格, 法律职业资格。</p>

				<p>从业经历： 2015年7月至2022年2月任汇添富基金管理股份有限公司固定收益助理分析师、固定收益分析师、固定收益高级分析师，2022年3月至今任汇添富基金管理股份有限公司基金经理助理。2022年3月1日至2022年9月15日任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理助理。2022年3月1日至2022年9月15日任汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2022年3月1日至2022年3月15日至今任汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2022年3月15日至今任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。 2022年4月8日至2023年3</p>
--	--	--	--	---

				<p>月 10 日任汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 4 月 8 日至 2023 年 3 月 10 日任汇添富盛和 66 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 4 月 8 日至 2022 年 8 月 8 日任汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 4 月 8 日至今任汇添富稳健汇盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 5 月 5 日至今任汇添富短债债券型证券投资基金的基金经理助理。2022 年 6 月 27 日至今任汇添富鑫裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理。2022 年 8 月 9 日至 2023 年 3 月 10 日任汇添富鑫汇债券型证券投资</p>
--	--	--	--	--

					<p>基金的基金经理助理。2022 年 10 月 17 日至今任汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 17 日至今任汇添富鑫远债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 4 日至今任汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 4 日至今任汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 25 日至今任汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月 25 日至今任汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 14 日至今任汇添富增强收益债券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、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

股票部分：

报告期内，市场在年初上涨后，出现持续的震荡调整，主要受到国内经济恢复不及预期等因素影响，同时也受到全球地缘政治、美联储加息节奏等影响。而板块间也有较大的分化：在全球人工智能技术进步的大背景下，市场对部分公司的信心得到明显提振，但由于市场的总体增量资金不多，这也对很多其他板块造成了较大冲击，而且在技术演进、商业模式探索的过程中，人工智能等科技板块内部也呈现了越来越大的分化。

总体操作看，本基金基本维持了相对较高的仓位运作。整体行业配置较为均衡，并在消费、新能源、有色、医药、军工、电子、计算机、化工、建材等方向对较优质标的进行了重点布局。基于对估值合理、长期有竞争力的优质公司的中长期认可，本基金逢低逐渐加大了对成长能力较强的优质公司的仓位暴露，因为我们坚信，长期看，筛选出好企业，以合理的估值买入或持有，并赚取公司成长带来的回报，才能创造长期可持续的收益率。

债券部分：

2023 年上半年，债市行情大致分为两个阶段。1-2 月，在宽信用政策持续发力预期及短端利率持续上行影响下，债市整体有所调整，信用债表现明显优于利率债，三年期利率债一季度高点较年初上行 27bp，信用债平均上行 14bp。二季度，国内经济修复动能边际有所减弱，PMI 连续三个月运行偏弱，房地产、基建为代表的旧的增长动能在减弱，经济整体在向高质量发展的方向转变，在此背景下，债券利率基本呈现单边下行走势。

报告期内，本基金债券资产以配置高等级信用债为主，并对信用类资产进行结构方面的优化。

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-0.34%。同期业绩比较基准收益率为 0.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票部分：

从全年维度看，我们对市场的判断仍然较为积极。企业与居民负债表的修复需要时间但终将到来，中国经济的潜力也有望得到进一步释放。同时，全球加息周期也进入后半程，风险资产的压力也将逐渐缓解。市场由于短期经济的压力在定价上显得过度悲观，而一系列龙头公司整体处于很低的估值区间。

在板块配置与个股选择上，我们看好中国先进制造业：通过拥有完整的产业链积累、工程师红利、优秀的管理层、狼性的机制与文化等，一大批优秀的制造业企业在全中国具备越来越强的竞争力。其次，基于看好部分具有较高成长性 or 较强品牌力的公司，也对消费医药等龙头公司进一步增持。同时，我们认为国内经济将逐渐触底修复，也对周期类行业的潜在投资机会进行重点关注。

债券部分：

展望下半年，随着经济社会全面恢复常态化运行，推动经济持续回升向好的一批政策措施逐步落地，预计全年经济社会发展预期目标任务可顺利达成。同时，在高质量发展的基调下，旧的增长动能将逐步被科技创新等现代化产业体系取代。在此背景下，预计经济修复节奏保持平稳，央行货币政策将配合经济转型进行跨周期调节，银行体系流动性继续维持合理充裕，债券利率大幅上行的风险较低。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；以红利再投资方式取得的基金份额的持有到期时间与投资者

原持有的基金份额最短持有期到期时间一致，因多笔认购、申购导致原持有基金份额最短持有期不一致的，分别计算；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司本报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	17,476,630.78	31,397,492.27
结算备付金		40,421,101.08	27,684,649.34
存出保证金		124,485.39	158,179.66
交易性金融资产	6.4.7.2	2,503,133,310.46	2,748,897,109.75
其中：股票投资		535,693,904.93	508,113,981.26
基金投资		-	-
债券投资		1,967,439,405.53	2,240,783,128.49
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		1,206,865.46	549,211.13
应收股利		404,989.89	14,533.67
应收申购款		2,254.89	2,517.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,562,769,637.95	2,808,703,693.64
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		393,881,567.15	324,451,610.26
应付清算款		6,110,414.42	5,691,344.93
应付赎回款		1,829,296.08	5,872,323.25
应付管理人报酬		1,073,236.58	1,272,563.43
应付托管费		268,309.11	318,140.86
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		90,092.43	100,545.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	709,757.19	698,902.33

负债合计		403,962,672.96	338,405,430.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	2,263,417,852.66	2,580,978,259.06
未分配利润	6.4.7.9	-104,610,887.67	-110,679,995.73
净资产合计		2,158,806,964.99	2,470,298,263.33
负债和净资产总计		2,562,769,637.95	2,808,703,693.64

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9538 元，基金份额总额 2,263,417,852.66 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		6,980,140.48	47,178,669.06
1. 利息收入		376,212.46	3,227,312.43
其中：存款利息收入	6.4.7.10	341,663.61	458,008.14
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		34,548.85	2,769,304.29
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		23,936,823.92	-1,948,224.23
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-14,742,639.73	-47,866,274.85
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	34,261,764.46	43,328,795.61
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	4,417,699.19	2,589,255.01
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	-17,332,895.90	45,899,580.86
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	-	-
减：二、营业总支出		13,306,306.22	13,796,245.26

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,916,253.89	9,479,759.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,729,063.53	2,369,939.97
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,453,697.26	1,705,425.59
其中：卖出回购金融资产支出		4,453,697.26	1,705,425.59
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		54,411.51	81,793.82
8. 其他费用	6.4.7.21	152,880.03	159,326.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,326,165.74	33,382,423.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,326,165.74	33,382,423.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,326,165.74	33,382,423.80

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富稳健添益一年持有期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）	2,580,978,259.06	-110,679,995.73	2,470,298,263.33
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,580,978,259.06	-110,679,995.73	2,470,298,263.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-317,560,406.40	6,069,108.06	-311,491,298.34
（一）、综合收益总额	-	-6,326,165.74	-6,326,165.74
（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）	-317,560,406.40	12,395,273.80	-305,165,132.60
其中：1. 基金申购款	1,829,730.27	-65,294.90	1,764,435.37

2. 基金赎回款	-319,390,136.67	12,460,568.70	-306,929,567.97
(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)	2,263,417,852.66	-104,610,887.67	2,158,806,964.99
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)	4,119,479,366.22	-178,932,849.06	3,940,546,517.16
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	4,119,479,366.22	-178,932,849.06	3,940,546,517.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,140,176,075.64	97,970,131.16	-1,042,205,944.48
(一)、综合收益总额	-	33,382,423.80	33,382,423.80
(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)	-1,140,176,075.64	64,587,707.36	-1,075,588,368.28
其中: 1. 基金申购款	2,607,434.64	-144,861.45	2,462,573.19
2. 基金赎回款	-1,142,783,510.28	64,732,568.81	-1,078,050,941.47
(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)	2,979,303,290.58	-80,962,717.90	2,898,340,572.68

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

汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]2092 号文《关于准予汇添富稳健添益一年持有期混合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 2021 年 1 月 20 日生效。首次设立基金募集规模为 4,112,764,550.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2021）验字第 60466941_B13 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、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相关规定）。本基金还可根据法律法规参与融资。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-30%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。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，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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。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。本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率

(经汇率调整) × 7% + 中债综合指数收益率 × 85%。

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

增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

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

6. 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	17,476,630.78

等于：本金	17,471,195.98
加：应计利息	5,434.80
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	17,476,630.78

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	591,691,048.10	-	535,693,904.93	-55,997,143.17	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	646,668,834.82	8,673,334.75	654,292,090.96	-1,050,078.61
	银行间市场	1,283,231,930.18	17,925,914.57	1,313,147,314.57	11,989,469.82
	其他	-	-	-	-
	合计	1,929,900,765.00	26,599,249.32	1,967,439,405.53	10,939,391.21
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,521,591,813.10	26,599,249.32	2,503,133,310.46	-45,057,751.96	

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	515,618.84
其中：交易所市场	501,513.84
银行间市场	14,105.00
应付利息	-
应付审计费	134,630.98
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	709,757.19

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	2,580,978,259.06	2,580,978,259.06
本期申购	1,829,730.27	1,829,730.27
本期赎回（以“-”号	-319,390,136.67	-319,390,136.67

填列)		
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	2,263,417,852.66	2,263,417,852.66

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	-86,930,428.91	-23,749,566.82	-110,679,995.73
本期利润	11,006,730.16	-17,332,895.90	-6,326,165.74
本期基金份额交易产生的变动数	9,790,798.14	2,604,475.66	12,395,273.80
其中：基金申购款	-56,996.17	-8,298.73	-65,294.90
基金赎回款	9,847,794.31	2,612,774.39	12,460,568.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-66,132,900.61	-38,477,987.06	-104,610,887.67

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	118,551.50
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	221,951.25
其他	1,160.86
合计	341,663.61

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	520,711,571.36
减：卖出股票成本总额	533,817,045.41

减：交易费用	1,637,165.68
买卖股票差价收入	-14,742,639.73

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	32,290,387.67
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	1,971,376.79
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	34,261,764.46

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	2,963,346,680.01
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	2,910,867,525.33
减：应计利息总额	50,472,131.06
减：交易费用	35,646.83
买卖债券差价收入	1,971,376.79

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,417,699.19
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,417,699.19

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	-17,332,895.90
——股票投资	-36,448,774.50
——债券投资	19,115,878.60
——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	-17,332,895.90

6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00

银行费用	28,453.67
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	2,288.01
合计	152,880.03

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
中国农业银行股份有限公司 (“农业银行”)	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	成交金额	占当期股票成交总额的

		比例 (%)		比例 (%)
东方证券	32,735,662.80	2.98	24,633,123.94	1.52

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	833,857,272.44	99.12	948,935,003.18	96.93

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
东方证券	748,400,000.00	2.00	668,000,000.00	2.40

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	23,863.88	2.75	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	17,725.88	1.46	17,725.88	2.58

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	6,916,253.89	9,479,759.87
其中：支付销售机构的客户维护费	3,380,150.92	4,637,151.44

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,729,063.53	2,369,939.97

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	17,476,630.78	118,551.50	124,131,622.73	269,762.52

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	692	20,912.24	17,646.00	
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						
30137 3	凌 玮 科 技	202 3 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	
30137 6	致 欧 科 技	202 3 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	
30138 2	蜂 助 手	202 3 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	
30138 3	天 键 股 份	202 3 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	
30139 7	溯 联 股 份	202 3 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	
30139 9	英 特 科 技	202 3 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	
30142 8	世 纪 恒 通	202 3 年 05 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	

301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个交易日	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36
601061	中信金属	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28
601065	江西省盐业集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00
601133	柏诚系统股份公司	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64
603125	江苏常青树	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80

	科技	日		限						
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	
688146	中船派瑞特气	2023年04月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	
688334	西高院	2023年06月09日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	
688352	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
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	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

	技	日		限						
688535	华海诚科新材料	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	
688552	航天南湖	2023年05月08日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	
688562	航天软件股份	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	
688581	安杰思医学	2023年05月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	
688620	安凯微电子	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	
688623	双元科技	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	
300763	锦浪科技	2023年02月10日	6个月	非公开发行流通受限	150.00	101.14	40,000	6,000,000.00	4,045,600.00	
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, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款共人民币 393, 881, 567.15 元, 于 2023 年 07 月 03 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

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于每份基金份额的最短持有期限之后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 20 23 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	17,476,630.78	-	-	-	-	-	17,476,630.78
结算备付金	40,421,101.08	-	-	-	-	-	40,421,101.08
存出保证金	124,485.39	-	-	-	-	-	124,485.39
交易性金融资产	3,238,022.86	20,496,512.88	559,892,309.70	1,383,812,560.09	-	535,693,904.93	2,503,133,310.46

产							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,206,865.46	1,206,865.46
应收股利	-	-	-	-	-	404,989.89	404,989.89
应收申购款	-	-	-	-	-	2,254.89	2,254.89
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	61,260,240 .11	20,496,51 2.88	559,892,3 09.70	1,383,812, 560.09	-	537,308,0 15.17	2,562,769, 637.95
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	393,881,56 7.15	-	-	-	-	-	393,881,56 7.15
应付清算款	-	-	-	-	-	6,110,414 .42	6,110,414. 42
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,829,296 .08	1,829,296. 08
应付	-	-	-	-	-	1,073,236 .58	1,073,236. 58

管理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	268,309.11	268,309.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	90,092.43	90,092.43
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	709,757.19	709,757.19
负	393,881.56	-	-	-	-	10,081.10	403,962.67

债总计	7.15					5.81	2.96
利率敏感度缺口	-332,621,327.04	20,496,512.88	559,892,309.70	1,383,812,560.09	-	527,226,909.36	2,158,806,964.99
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	31,397,492.27	-	-	-	-	-	31,397,492.27
结算备付金	27,684,649.34	-	-	-	-	-	27,684,649.34
存出保证金	158,179.66	-	-	-	-	-	158,179.66
交易性金融资产	3,040,085.19	358,295,400.74	957,884,201.78	921,563,440.78	-	508,113,981.26	2,748,897,109.75

衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	549,211.13	549,211.13
应收股利	-	-	-	-	-	14,533.67	14,533.67
应收申购款	-	-	-	-	-	2,517.82	2,517.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资	62,280,406	358,295,4	957,884,2	921,563,44	-	508,680,2	2,808,703,

产总计	.46	00.74	01.78	0.78		43.88	693.64
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	324,451,610.26	-	-	-	-	-	324,451,610.26
应付清算款	-	-	-	-	-	5,691,344.93	5,691,344.93
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,872,323.25	5,872,323.25
应付管	-	-	-	-	-	1,272,563.43	1,272,563.43

理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	318,140.86	318,140.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	100,545.25	100,545.25
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	698,902.33	698,902.33
负债	324,451,610.26	-	-	-	-	13,953,820.05	338,405,430.31

总计							
利率 敏 感 度 缺 口	-262,171,203.80	358,295,400.74	957,884,201.78	921,563,440.78	-	494,726,423.83	2,470,298,263.33

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	8,078,180.02	6,140,629.56
	基准利率增加 25 个基点	-8,011,467.33	-6,095,801.72

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	91,515,512.63	-	91,515,512.63
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	404,989.89	-	404,989.89
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	91,920,502.52	-	91,920,502.52
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理	-	-	-	-

人报酬				
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	91,920,502.52	-	91,920,502.52
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	26,906,190.15	-	26,906,190.15
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	14,533.67	-	14,533.67
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-

资产合计	-	26,920,723.82	-	26,920,723.82
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	26,920,723.82	-	26,920,723.82

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	港币相对人民	4,596,025.13	1,346,036.19

	币升值 5%		
	港币相对人民币贬值 5%	-4,596,025.13	-1,346,036.19

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	535,693,904.93	24.81	508,113,981.26	20.57
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,967,439,405.53	91.14	2,240,783,128.49	90.71
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	2,503,133,310.46	115.95	2,748,897,109.75	111.28

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%	22,171,061.03	18,574,028.40
	沪深 300 指数下跌 5%	-22,171,061.03	-18,574,028.40

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	533,336,414.61
第二层次	1,964,496,951.37
第三层次	5,299,944.48
合计	2,503,133,310.46

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	535,693,904.93	20.90
	其中：股票	535,693,904.93	20.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,967,439,405.53	76.77
	其中：债券	1,967,439,405.53	76.77
	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	57,897,731.86	2.26
8	其他各项资产	1,738,595.63	0.07
9	合计	2,562,769,637.95	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 91,515,512.63 元，占期末净值比例为 4.24%。

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	11,197,880.00	0.52
B	采矿业	2,456,336.23	0.11
C	制造业	376,842,889.48	17.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,689.56	0.00
E	建筑业	40,185.78	0.00
F	批发和零售业	1,263,168.44	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	13,305,711.07	0.62
H	住宿和餐饮业	1,248,100.40	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,653,819.10	0.86
J	金融业	4,188,813.72	0.19

K	房地产业	1,998,066.00	0.09
L	租赁和商务服务业	9,345,464.41	0.43
M	科学研究和技术服务业	2,809,702.67	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	217,380.88	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	85,098.56	0.00
R	文化、体育和娱乐业	471,086.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	444,178,392.30	20.58

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	702,179.97	0.03
15 原材料	-	-
20 工业	663,641.20	0.03
25 可选消费	49,935,049.01	2.31
30 日常消费	1,155,056.55	0.05
35 医疗保健	9,085,836.31	0.42
40 金融	-	-
45 信息技术	7,305,838.67	0.34
50 电信服务	20,091,188.87	0.93
55 公用事业	1,548,041.30	0.07
60 房地产	1,028,680.75	0.05
合计	91,515,512.63	4.24

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	15,800	26,717,800.00	1.24
2	300750	宁德时代	81,708	18,693,973.32	0.87
3	600765	中航重机	696,400	18,461,564.00	0.86
4	002541	鸿路钢	574,080	16,539,244.80	0.77

		构			
5	02331	李宁	424,500	16,496,688.50	0.76
6	00700	腾讯控 股	52,400	16,020,176.96	0.74
7	601677	明泰铝 业	1,097,542	15,233,882.96	0.71
8	03690	美团一 W	123,930	13,974,118.03	0.65
9	002384	东山精 密	522,763	13,539,561.70	0.63
10	000568	泸州老 窖	57,800	12,113,146.00	0.56
11	600702	舍得酒 业	80,100	9,928,395.00	0.46
12	300014	亿纬锂 能	161,500	9,770,750.00	0.45
13	603198	迎驾贡 酒	149,746	9,553,794.80	0.44
14	000858	五 粮 液	55,900	9,143,563.00	0.42
15	000661	长春高 新	63,800	8,695,940.00	0.40
16	603806	福斯特	226,224	8,413,270.56	0.39
17	600399	抚顺特 钢	817,000	8,333,400.00	0.39
18	002532	天山铝 业	1,341,800	8,037,382.00	0.37
19	002352	顺丰控 股	173,500	7,823,115.00	0.36
20	300855	图南股 份	219,900	7,766,868.00	0.36
21	601636	旗滨集 团	896,162	7,724,916.44	0.36
22	02269	药明生 物	221,000	7,651,097.13	0.35
23	002271	东方雨 虹	279,000	7,605,540.00	0.35
24	002714	牧原股 份	175,700	7,405,755.00	0.34
25	002709	天赐材 料	174,900	7,204,131.00	0.33
26	603799	华友钴 业	155,300	7,129,823.00	0.33

27	09922	九毛九	596,000	7,055,581.03	0.33
28	603986	兆易创新	62,200	6,608,750.00	0.31
29	003022	联泓新科	253,000	6,299,700.00	0.29
30	601233	桐昆股份	450,200	5,965,150.00	0.28
31	06862	海底捞	369,000	5,865,231.09	0.27
32	300274	阳光电源	49,700	5,796,511.00	0.27
33	300662	科锐国际	161,600	5,715,792.00	0.26
34	002043	兔宝宝	512,000	5,585,920.00	0.26
35	688239	贵州航宇科技	79,556	5,564,942.20	0.26
36	02382	舜宇光学科技	74,900	5,396,750.00	0.25
37	600426	华鲁恒升	169,600	5,194,848.00	0.24
38	01368	特步国际	698,000	5,135,465.48	0.24
39	300337	银邦股份	765,200	5,103,884.00	0.24
40	002508	老板电器	177,700	4,494,033.00	0.21
41	300763	锦浪科技	44,100	4,472,410.00	0.21
42	688111	金山办公	9,116	4,304,757.52	0.20
43	000651	格力电器	111,300	4,063,563.00	0.19
44	600233	圆通速递	269,200	3,919,552.00	0.18
45	300666	江丰电子	57,100	3,880,516.00	0.18
46	600570	恒生电子	86,790	3,843,929.10	0.18
47	603737	三棵树	57,560	3,765,575.20	0.17
48	000596	古井贡酒	14,700	3,636,486.00	0.17
49	002484	江海股份	170,200	3,623,558.00	0.17

50	002092	中泰化学	556,800	3,591,360.00	0.17
51	300498	温氏股份	186,300	3,418,605.00	0.16
52	002311	海大集团	70,300	3,292,852.00	0.15
53	01024	快手-W	66,400	3,278,302.73	0.15
54	603517	绝味食品	81,100	3,012,865.00	0.14
55	002236	大华股份	152,000	3,002,000.00	0.14
56	002493	荣盛石化	253,600	2,951,904.00	0.14
57	601888	中国中免	26,197	2,895,554.41	0.13
58	688301	奕瑞科技股份	9,888	2,792,667.84	0.13
59	600036	招商银行	80,997	2,653,461.72	0.12
60	002439	启明星辰	86,936	2,587,215.36	0.12
61	688066	北京航天宏图	40,096	2,441,846.40	0.11
62	002648	卫星化学	155,520	2,326,579.20	0.11
63	600760	中航沈飞	51,152	2,301,840.00	0.11
64	605399	晨光新材	127,400	2,267,720.00	0.11
65	300347	泰格医药	34,200	2,207,268.00	0.10
66	002001	新和成	130,920	2,016,168.00	0.09
67	688390	固德威电源	11,850	1,977,291.00	0.09
68	01415	高伟电子	143,000	1,909,088.67	0.09
69	300896	爱美客	4,100	1,824,295.00	0.08
70	600256	广汇能源	249,300	1,710,198.00	0.08
71	600941	中国移动	12,000	1,119,600.00	0.05

71	00941	中国移动	10,000	590,528.19	0.03
72	001979	招商蛇口	125,800	1,639,174.00	0.08
73	601865	福莱特	42,100	1,621,271.00	0.08
74	002068	黑猫股份	136,400	1,619,068.00	0.07
75	688031	星环科技	12,047	1,605,142.28	0.07
76	600690	海尔智家	67,600	1,587,248.00	0.07
77	300122	智飞生物	35,604	1,573,696.80	0.07
78	300911	亿田智能	41,302	1,568,236.94	0.07
79	02380	中国电力	583,000	1,548,041.30	0.07
80	300260	新莱应材	36,480	1,441,689.60	0.07
81	002142	宁波银行	53,300	1,348,490.00	0.06
82	002594	比亚迪	5,100	1,317,177.00	0.06
83	601111	中国国航	151,800	1,250,832.00	0.06
84	000860	顺鑫农业	33,550	1,130,299.50	0.05
85	300068	南都电源	56,800	1,099,648.00	0.05
86	603225	新凤鸣	97,800	1,080,690.00	0.05
87	603369	今世缘	19,500	1,029,600.00	0.05
88	06049	保利物业	29,400	1,028,680.75	0.05
89	600276	恒瑞医药	21,400	1,025,060.00	0.05
90	002121	科陆电子	136,500	1,000,545.00	0.05
91	000301	东方盛虹	83,100	982,242.00	0.05
92	688443	智翔金泰	30,329	933,162.53	0.04
93	600529	山东药玻	34,200	930,924.00	0.04
94	01548	金斯瑞	54,000	876,249.79	0.04

		生物科技			
95	688439	振华风光	7,096	779,282.72	0.04
96	00291	华润啤酒	16,000	761,186.69	0.04
97	600258	首旅酒店	39,100	740,945.00	0.03
98	600546	山煤国际	51,200	740,864.00	0.03
99	002463	沪电股份	35,100	734,994.00	0.03
100	002027	分众传媒	107,800	734,118.00	0.03
101	00883	中国海洋石油	68,000	702,179.97	0.03
102	002335	科华数据	19,000	683,050.00	0.03
103	002371	北方华创	2,100	667,065.00	0.03
104	00868	信义玻璃	59,000	663,641.20	0.03
105	601899	紫金矿业	56,900	646,953.00	0.03
106	688523	航天环宇科技	23,720	636,395.92	0.03
107	002840	华统股份	39,800	622,472.00	0.03
108	03998	波司登	198,000	602,421.73	0.03
109	002410	广联达	18,480	600,415.20	0.03
110	300124	汇川技术	9,200	590,732.00	0.03
111	300737	科顺股份	63,200	578,912.00	0.03
112	06078	海吉亚医疗	14,000	547,287.33	0.03
113	688271	联影医疗	3,727	514,363.27	0.02
114	600754	锦江酒店	11,700	495,378.00	0.02
115	300413	芒果超媒	13,500	461,835.00	0.02
116	300782	卓胜微	4,600	444,498.00	0.02

117	002179	中航光电	9,748	442,071.80	0.02
118	688021	奥福环保	16,947	439,266.24	0.02
119	688235	百济神州	3,901	425,638.11	0.02
120	603596	伯特利	5,300	420,078.00	0.02
121	00667	中国东方教育	149,000	413,498.81	0.02
122	300769	德方纳米	3,680	405,646.40	0.02
123	603995	甬金股份	16,900	404,079.00	0.02
124	002415	海康威视	12,200	403,942.00	0.02
125	00168	青岛啤酒股份	6,000	393,869.86	0.02
126	01361	361度	114,000	392,044.34	0.02
127	002475	立讯精密	11,600	376,420.00	0.02
128	603477	巨星农牧	11,200	373,520.00	0.02
129	600641	万业企业	18,800	358,892.00	0.02
130	603267	鸿远电子	5,400	352,620.00	0.02
131	300203	聚光科技	17,200	348,644.00	0.02
132	002230	科大讯飞	5,100	346,596.00	0.02
133	688680	海优新材	2,838	345,725.16	0.02
134	688147	微导纳米科技	6,293	332,144.54	0.02
135	000063	中兴通讯	6,600	300,564.00	0.01
136	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
137	688507	索辰科技	2,213	287,192.75	0.01
138	002505	鹏都农牧	146,000	275,940.00	0.01

139	688630	芯碁微装	3,011	252,984.22	0.01
140	301356	天振股份	11,038	241,732.20	0.01
141	688212	澳华内窥镜	3,496	237,378.40	0.01
142	000425	徐工机械	34,900	236,273.00	0.01
143	688072	拓荆科技	535	227,893.95	0.01
144	688231	隆达超合金股份	7,835	223,532.55	0.01
145	688037	芯源微电子	1,286	219,841.70	0.01
146	601872	招商轮船	35,200	203,808.00	0.01
147	301031	中熔电气	1,500	203,565.00	0.01
148	002036	联创电子	19,615	190,461.65	0.01
149	301262	海看股份	6,917	190,389.75	0.01
150	688116	天奈科技	4,119	188,444.25	0.01
151	603589	口子窖	3,800	187,530.00	0.01
152	301383	天键股份	4,925	183,366.76	0.01
153	688789	杭州宏华数码科技	1,997	176,395.01	0.01
154	688690	纳微科技	4,481	174,086.85	0.01
155	002812	恩捷股份	1,800	173,430.00	0.01
156	603787	新日股份	10,000	168,100.00	0.01
157	688179	阿拉丁科技	5,591	166,947.26	0.01
158	688459	哈铁科技	17,259	166,376.76	0.01
159	688152	麒麟信安	1,772	163,520.16	0.01
160	301139	元道通	5,651	163,257.39	0.01

		信			
161	688623	双元科技	1,776	162,256.88	0.01
162	688629	四川华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
163	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.01
164	688325	赛微电子	4,039	157,722.95	0.01
165	301396	宏景科技	4,752	155,152.80	0.01
166	688363	华熙生物	1,727	153,979.32	0.01
167	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.01
168	301280	珠城科技	4,174	149,262.24	0.01
169	601601	中国太保	5,500	142,890.00	0.01
170	688433	华曙高科	4,171	140,769.00	0.01
171	301335	天元宠物	5,869	139,916.96	0.01
172	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.01
173	688184	帕瓦股份	4,358	136,231.08	0.01
174	688620	安凯微电子	10,157	135,209.66	0.01
175	603613	国联股份	3,625	133,871.25	0.01
176	688553	汇宇制药	8,928	133,295.04	0.01
177	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.01
178	603501	韦尔股份	1,350	132,354.00	0.01
179	301365	矩阵股份	7,740	127,400.40	0.01
180	301345	涛涛车业	2,652	126,242.30	0.01
181	301379	天山电子	4,481	125,154.33	0.01
182	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.01

183	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
184	301148	嘉戎技术	5,153	110,171.14	0.01
185	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
186	688472	阿特斯阳光电力	6,261	106,687.44	0.00
187	301290	东星医疗	3,291	105,476.55	0.00
188	02400	心动公司	5,800	105,345.43	0.00
189	301488	豪恩汽车电	2,618	104,144.04	0.00
190	688479	用友汽车信息科技	3,318	103,760.10	0.00
191	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.00
192	301232	飞沃科技	1,643	99,339.12	0.00
193	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.00
194	301306	西测测试	2,543	98,795.55	0.00
195	09626	哔哩哔哩-W	900	96,835.56	0.00
196	688535	华海诚科新材料	1,607	96,642.01	0.00
197	301398	星源卓镁	2,549	95,587.50	0.00
198	301265	华新环保	8,181	95,063.22	0.00
199	688143	长盈通光电	2,519	94,966.30	0.00
200	301176	逸豪新材	5,431	93,304.58	0.00
201	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.00
202	301373	凌玮科技	2,764	89,376.38	0.00
203	600004	白云机	6,200	88,908.00	0.00

		场			
204	301281	科源制药	3,366	88,363.72	0.00
205	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
206	301203	国泰环保	2,243	79,964.22	0.00
207	603218	日月股份	4,200	79,758.00	0.00
208	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
209	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.00
210	301227	森鹰窗业	2,840	78,753.20	0.00
211	301388	欣灵电气	2,920	78,402.00	0.00
212	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
213	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
214	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
215	688193	仁度生物	1,635	70,435.80	0.00
216	301233	盛帮股份	1,576	68,193.52	0.00
217	688448	南京磁谷科技	1,985	67,946.55	0.00
218	301165	锐捷网络	1,077	66,472.44	0.00
219	603456	九洲药业	2,400	65,712.00	0.00
220	301309	万得凯	2,271	62,543.34	0.00
221	301267	华夏眼科	1,006	61,315.70	0.00
222	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.00
223	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.00
224	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
225	300568	星源材质	2,870	49,335.30	0.00

226	603866	桃李面包	4,800	48,576.00	0.00
227	688356	键凯科技	453	48,267.15	0.00
228	688146	中船派瑞特气	1,011	38,549.43	0.00
229	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
230	301162	国能日新	468	36,915.84	0.00
231	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
232	301200	大族数控	857	34,177.16	0.00
233	301367	怡和嘉业	223	33,079.82	0.00
234	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
235	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
236	301177	迪阿股份	792	30,436.56	0.00
237	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
238	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
239	300529	健帆生物	1,200	27,816.00	0.00
240	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
241	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.00
242	301327	华宝新能	315	24,919.65	0.00
243	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.00
244	301311	昆船智能	832	24,527.36	0.00
245	001308	康冠科技	867	23,807.82	0.00
246	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
247	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
248	688552	航天南	956	22,466.00	0.00

		湖			
249	601336	新华保险	600	22,062.00	0.00
250	601166	兴业银行	1,400	21,910.00	0.00
251	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
252	601933	永辉超市	6,900	21,597.00	0.00
253	688349	三一重能	669	21,555.18	0.00
254	688458	美芯晟科技	221	20,057.96	0.00
255	301363	美好医疗	445	19,575.55	0.00
256	001323	慕思股份	573	19,459.08	0.00
257	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.00
258	301058	中粮科工	1,386	19,334.70	0.00
259	688581	安杰思医学	163	19,238.89	0.00
260	301091	深城交	1,021	18,908.92	0.00
261	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
262	603235	天新药业	572	17,937.92	0.00
263	301179	泽宇智能	531	17,894.70	0.00
264	603173	福斯达深冷	588	17,316.60	0.00
265	301123	奕东电子	656	16,754.24	0.00
266	688562	航天软件股份	726	16,197.06	0.00
267	301187	欧圣电气	876	16,179.72	0.00
268	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
269	603282	亚光科技股份	457	15,771.07	0.00
270	300834	星辉环材	635	15,494.00	0.00

271	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
272	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
273	301201	诚达药业	353	14,543.60	0.00
274	603070	万控智造	775	14,484.75	0.00
275	001298	好上好	584	14,454.00	0.00
276	603190	烟台亚通精工机械	470	14,382.00	0.00
277	301093	华兰股份	409	14,151.40	0.00
278	301338	凯格精机	360	14,004.00	0.00
279	603237	五芳斋实业	455	13,800.15	0.00
280	603057	上海紫燕食品	549	13,796.37	0.00
281	301069	凯盛新材	539	13,712.16	0.00
282	301212	联盛化学	416	13,619.84	0.00
283	301349	信德新材	270	13,537.80	0.00
284	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
285	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
286	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
287	603153	上海建科集团	740	13,135.00	0.00
288	301277	新天地	658	12,837.58	0.00
289	301088	戎美股份	704	12,580.48	0.00
290	301073	君亭酒店	324	11,777.40	0.00
291	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.00
292	603170	宝立食品科技	542	11,522.92	0.00
293	001278	一彬科	473	11,247.94	0.00

		技			
294	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
295	001319	铭科精技	536	11,234.56	0.00
296	02252	微创机器人-B	500	11,202.06	0.00
297	603130	云中马股份	480	10,900.80	0.00
298	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
299	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
300	601065	江西省盐业集团	875	10,360.00	0.00
301	301110	青木股份	202	10,186.86	0.00
302	301181	标榜股份	334	10,050.06	0.00
303	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
304	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
305	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
306	001268	联合精密	409	9,492.89	0.00
307	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
308	301135	瑞德智能	338	9,267.96	0.00
309	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
310	301196	唯科科技	271	9,200.45	0.00
311	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.00
312	001222	源飞宠物	607	9,183.91	0.00
313	301197	工大科雅	380	9,158.00	0.00
314	603280	南方路面机械	363	8,922.54	0.00

315	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
316	301116	益客食品	577	8,885.80	0.00
317	301126	达嘉维康	662	8,870.80	0.00
318	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
319	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
320	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
321	301092	争光股份	323	8,456.14	0.00
322	001231	农心科技	355	8,445.45	0.00
323	603182	嘉华生物科技股份有限公司	546	8,255.52	0.00
324	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
325	601133	柏诚系统股份公司	664	8,140.64	0.00
326	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
327	001336	楚环科技	274	7,666.52	0.00
328	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
329	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
330	301300	远翔新材	211	6,667.60	0.00
331	603209	兴通股份	297	6,299.37	0.00
332	301098	金埔园林	460	5,543.00	0.00
333	301062	上海艾录	523	5,538.57	0.00
334	301068	大地海洋	144	4,839.84	0.00
335	301072	中捷精工	181	4,534.05	0.00
336	301063	海锅股	153	4,262.58	0.00

		份			
337	603125	江苏常青树科技	160	3,924.80	0.00
338	301057	汇隆新材	218	3,758.32	0.00
339	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
340	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
341	300854	中兰环保	203	3,227.70	0.00
342	603151	邦基科技股份有限公司	194	3,169.96	0.00
343	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
344	001367	海森药业	55	2,171.40	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	02331	李宁	18,808,957.44	0.76
2	002384	东山精密	18,532,685.60	0.75
3	03690	美团-W	18,270,943.08	0.74
4	002352	顺丰控股	16,845,565.00	0.68
5	601677	明泰铝业	16,327,039.60	0.66
6	600702	舍得酒业	13,239,899.00	0.54
7	00700	腾讯控股	13,083,236.00	0.53
8	603198	迎驾贡酒	12,740,850.72	0.52
9	600765	中航重机	12,527,452.00	0.51
10	600570	恒生电子	11,279,301.74	0.46
11	02269	药明生物	11,181,644.23	0.45
12	300763	锦浪科技	9,962,647.00	0.40
13	603806	福斯特	9,572,616.66	0.39
14	000661	长春高新	9,178,001.44	0.37
15	000858	五粮液	9,047,749.00	0.37
16	09922	九毛九	8,257,208.94	0.33
17	002541	鸿路钢构	8,036,036.00	0.33

18	000568	泸州老窖	7,992,805.00	0.32
19	002439	启明星辰	7,875,979.04	0.32
20	601636	旗滨集团	7,740,022.46	0.31

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	001979	招商蛇口	17,657,198.00	0.71
2	300274	阳光电源	17,492,386.00	0.71
3	600048	保利发展	15,195,067.00	0.62
4	600760	中航沈飞	14,407,715.77	0.58
5	300750	宁德时代	14,191,913.00	0.57
6	688390	固德威电源	11,646,868.47	0.47
7	300763	锦浪科技	10,457,173.76	0.42
8	002475	立讯精密	10,436,448.86	0.42
9	002384	东山精密	10,425,273.07	0.42
10	002352	顺丰控股	10,148,122.00	0.41
11	300498	温氏股份	10,038,810.68	0.41
12	002025	航天电器	9,213,165.80	0.37
13	300911	亿田智能	8,233,042.00	0.33
14	600256	广汇能源	8,165,455.00	0.33
15	002179	中航光电	7,855,697.23	0.32
16	300919	中伟股份	7,763,803.39	0.31
17	600153	建发股份	7,734,122.00	0.31
18	600570	恒生电子	7,216,296.00	0.29
19	300014	亿纬锂能	7,109,648.96	0.29
20	300413	芒果超媒	6,999,520.00	0.28

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	597,845,743.58
卖出股票收入（成交）总额	520,711,571.36

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	763,177,538.62	35.35
	其中：政策性金融债	121,867,594.52	5.65
4	企业债券	650,945,235.06	30.15
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	549,969,775.95	25.48
7	可转债（可交换债）	3,346,855.90	0.16
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,967,439,405.53	91.14

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	2120107	21 浙商银行永续债	1,500,000	154,861,684.93	7.17
2	102380694	23 首旅 MTN003	900,000	91,984,190.16	4.26
3	2028048	20 中国银行永续债 02	600,000	63,908,284.93	2.96
4	175272	20 银河 G2	600,000	61,467,304.11	2.85
5	210202	21 国开 02	600,000	61,134,361.64	2.83

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，浙商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、国家开发银行、中国进出口银行、徽商银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、招商证券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	124,485.39
2	应收清算款	1,206,865.46
3	应收股利	404,989.89
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,254.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,738,595.63

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	123107	温氏转债	1,248,424.51	0.06
2	127045	牧原转债	1,236,503.56	0.06
3	127073	天赐转债	694,040.59	0.03
4	118025	奕瑞转债	59,054.20	0.00

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（%）
32,419	69,817.63	10,809,595.29	0.48	2,252,608,257.37	99.52

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	39.88	0.00

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年01月20日）基金份额总额	4,112,764,550.00
本报告期期初基金份额总额	2,580,978,259.06
本报告期基金总申购份额	1,829,730.27
减：本报告期基金总赎回份额	319,390,136.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,263,417,852.66

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 (%)	
华西证券	2	271,096,233.14	24.69	197,422.85	22.77	

东海证券	2	148,378,190.97	13.51	139,189.99	16.06	
华宝证券	1	109,899,718.05	10.01	99,737.54	11.51	
长江证券	2	98,775,672.53	9.00	71,892.21	8.29	
民生证券	2	70,663,541.37	6.44	52,121.26	6.01	
财通证券	1	66,098,569.78	6.02	62,010.62	7.15	
华创证券	1	64,708,974.66	5.89	47,319.29	5.46	
中信建投证券	2	56,817,269.14	5.18	41,633.47	4.80	
中泰证券	1	50,733,286.06	4.62	36,591.64	4.22	
兴业证券	2	39,728,891.19	3.62	29,487.13	3.40	
东方证券	2	32,735,662.80	2.98	23,863.88	2.75	
华泰证券	2	27,706,764.15	2.52	20,198.06	2.33	
中信证券	1	20,459,511.27	1.86	14,757.43	1.70	
中金公司	2	17,307,086.92	1.58	15,316.22	1.77	
东方财富	2	12,529,544.70	1.14	7,924.74	0.91	
方正证券	2	5,676,900.09	0.52	4,094.25	0.47	
长城证券	1	2,350,894.29	0.21	1,695.61	0.20	
招商证券	2	2,243,595.00	0.20	1,617.87	0.19	
渤海证券	2	-	-	-	-	
广发证券	2	-	-	-	-	
国金证券	1	-	-	-	-	
国联证券	1	-	-	-	-	
国泰	1	-	-	-	-	

君安						
海通 证券	2	-	-	-	-	
恒泰 证券	2	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
华西证券	1,244,891.99	0.15	14,404,190,000.00	38.41	-	-	-	-
东海证券	1,613,488.95	0.19	4,716,500,000.00	12.58	-	-	-	-
华宝证券	961,123.07	0.11	-	-	-	-	-	-
长江证券	357,361.67	0.04	3,481,000,000.00	9.28	-	-	-	-
民生证券	355,212.00	0.04	25,000,000.00	0.07	-	-	-	-
财通	-	-	10,000,000.00	0.03	-	-	-	-

证券									
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	1,735,272.27	0.21	1,509,200,000.00	4.02	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	4,713,980,000.00	12.57	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	783,000,000.00	2.09	-	-	-	-	-
东方证券	833,857,272.44	99.12	748,400,000.00	2.00	-	-	-	-	-
华泰证券	276,275.00	0.03	1,020,300,000.00	2.72	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	3,078,400,000.00	8.21	-	-	-	-	-
中金公司	877,875.00	0.10	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	394,000,000.00	1.05	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	620,000,000.00	1.65	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	1,576,000,000.00	4.20	-	-	-	-
招商证券	-	-	418,000,000.00	1.11	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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 1 家证券公司的 1 个交易单元:广发证券(深交所单元)。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下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 01 月 18 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
3	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
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	2023 年 04 月 21 日

		站	
--	--	---	--

§ 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稳健添益一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富稳健添益一年持有期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、报告期内汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日