汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 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遵规守信情况的说明 16
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 17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 18
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 18
§5 托管人报告 19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 64
7.1 期末基金资产组合情况 64
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 64
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 65
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 76
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 76
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 77
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 77
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 77

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....77
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....77
7.12 市场中性策略执行情况.....77
7.13 投资组合报告附注.....77
§8 基金份额持有人信息.....78
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....78
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....79
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.....79
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....80
§9 开放式基金份额变动.....80
§10 重大事件揭示.....80
10.1 基金份额持有人大会决议.....80
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.....81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....81
10.4 基金投资策略的改变.....81
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....81
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.....81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....81
10.8 其他重大事件.....86
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....86
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.....86
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....86
§12 备查文件目录.....86
12.1 备查文件目录.....86
12.2 存放地点.....87
12.3 查阅方式.....87

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	汇添富绝对收益定开混合	
基金主代码	000762	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 03 月 15 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	4,444,385,514.37	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
下属分级基金的交易代码	000762	008140
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	3,713,906,303.99	730,479,210.38

2.2 基金产品说明

投资目标	基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。
投资策略	本基金采用包括市场中性投资策略在内的多种绝对收益策略，力争实现基金资产长期持续稳定的绝对回报。绝对收益策略包括：市场中性投资策略、其他绝对收益策略。其他投资策略包括：债券投资策略、中小企业私募债投资策略、衍生品投资策略。
业绩比较基准	一年期定期存款税后利率
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，采用多种绝对收益策略，其中市场中性策略采用股指期货对冲市场风险，使得多空组合的收益波动与市场相关性较低。本基金属于中低风险水平追求绝对收益的投资品种，其预期风险低于股票型基金和一般的混合型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	张姗
	联系电话	021-28932888	0755-83077987
	电子邮箱	service@99fund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	400-888-9918	95555
传真	021-28932998	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	李文	缪建民

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)	
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
本期已实现收益	-123,998,637.20	-28,512,988.71
本期利润	-114,312,182.36	-25,665,602.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0292	-0.0333
本期加权平均净值利润率	-2.30%	-2.70%
本期基金份额净值增长率	-2.58%	-2.89%
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	907,514,165.08	149,153,154.27
期末可供分配基金份额利润	0.2444	0.2042
期末基金资产净值	4,621,420,469.07	882,977,398.35
期末基金份额净值	1.244	1.209

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	24.40%	-5.18%

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

汇添富绝对收益定开混合 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.32%	0.22%	0.12%	0.00%	-0.44%	0.22%
过去三个月	-2.12%	0.22%	0.37%	0.00%	-2.49%	0.22%
过去六个月	-2.58%	0.20%	0.74%	0.01%	-3.32%	0.19%
过去一年	-9.53%	0.27%	1.50%	0.00%	-11.03%	0.27%
过去三年	-7.85%	0.33%	4.50%	0.00%	-12.35%	0.33%
自基金合同生效日起至今	24.40%	0.32%	9.44%	0.00%	14.96%	0.32%
汇添富绝对收益定开混合 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一	-0.33%	0.21%	0.12%	0.00%	-0.45%	0.21%

个月						
过去三个月	-2.34%	0.22%	0.37%	0.00%	-2.71%	0.22%
过去六个月	-2.89%	0.20%	0.74%	0.01%	-3.63%	0.19%
过去一年	-10.24%	0.26%	1.50%	0.00%	-11.74%	0.26%
过去三年	-9.98%	0.33%	4.50%	0.00%	-14.48%	0.33%
自基金合同生效日起至今	-5.18%	0.32%	5.45%	0.00%	-10.63%	0.32%

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

注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 03 月 15 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。

本基金于 2019 年 11 月 11 日新增 C 类份额，新增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		
顾耀强	本基金的基金经理,增强收益部总监	2017 年 03 月 15 日		19	国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，现任增强收益部总监。2009 年 12 月 22 日至今任汇添

					富策略回报混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 24 日至今任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月 20 日至今任汇添富沪深 300 基本面

					增强指数型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 5 日至 2022 年 9 月 22 日任汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 16 日至今任汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。
吴江宏	本基金的基金经理,稳健收益部总经理	2017 年 03 月 15 日		12	国籍：中国。学历：厦门大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益分析师，现任稳健收益部总经理。2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月 19 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈

					安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月 3 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 13 日至 2020 年 3 月 23 日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。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月 20 日至 2019 年 9 月 4 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。2017 年 6 月 23 日

					至 2019 年 8 月 28 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。2017 年 9 月 27 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月 25 日至 2019 年 8 月 29 日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。2018 年 4 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至 2020 年 6 月 4 日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。

					2019 年 8 月 28 日至今任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 4 月 20 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 5 月 20 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 4 日至今任汇添富稳健睿选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 23 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 25 日至今

					任汇添富稳健鑫添益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 21 日至今任汇添富鑫享添利六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 10 日至今任汇添富双鑫添利债券型证券投资基金的基金经理。

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，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中的公平交易模块，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

上半年市场先扬后抑。年初投资者对经济疫后复苏较为乐观，但二季度随外部环境变化，以及房地产、地方债等结构性问题的反复，投资者又转而对经济的中长期增长前景忧心忡忡。“资产负债表衰退”一度成为热门话题。预期的不稳定性导致市场风格的巨大变化。与经济周期相关的大多数资产先涨后跌，只有人工智能相关主题在持续的产业突破刺激下，从大模型，到算力（芯片、光模块等），再到应用（游戏、智能驾驶、机器人等）等热点纷呈。本期基金管理人上半年总体加强了组合管理的规则化控制，但市场预期不稳，博弈氛围浓重，主题投资盛行，仍不利于基本面选股获取超额。组合报告期内未能取得正收益。本基金管理人将继续依托公司投研团队的支持，努力优化投资策略，应对市场环境的挑战。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富绝对收益定开混合 A 类份额净值增长率为-2.58%，同期业绩比较基准收

益率为 0.74%。本报告期汇添富绝对收益定开混合 C 类份额净值增长率为-2.89%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年市场，我们看法相对乐观。在 7 月底中央重要会议定调“经济恢复是一个波浪式发展、曲折式前进的过程”，并针对性做出“房地产市场供求关系发生重大变化”、“要活跃资本市场，提振投资者信心”等投资者极为关切的重大判断后，我们相信，依托强健的政策执行力，经济基本面将逐步稳定复苏，投资者预期有望较快扭转，中国优质资产亦将迎来估值修复。当然从中长期来看，中国正面临百年不遇的大变局，应对外部环境的挑战，以及内部的结构转型仍任重而道远。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30% ，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；封闭期，基金收益分配采用现金分红；开放期，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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	51,593,731.96	58,473,428.20
结算备付金		780,985,220.95	1,110,629,220.92
存出保证金		323,788,978.52	429,626,084.45
交易性金融资产	6.4.7.2	4,565,696,917.21	6,451,192,468.21
其中：股票投资		3,244,699,731.99	4,140,949,053.63
基金投资		-	-
债券投资		1,320,997,185.22	2,310,243,414.58

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	-14,761.65	-12,777.01
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		41,943,610.81	49,054,948.03
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,763,993,697.80	8,098,963,372.80
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		29,026,531.92	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,803,020.02	9,698,973.70
应付托管费		1,133,836.69	1,616,495.62
应付销售服务费		582,189.30	821,445.99
应付投资顾问费		-	-
应交税费		20,223.71	31,836.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	222,030,028.74	477,885,616.31
负债合计		259,595,830.38	490,054,368.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	4,444,385,514.37	5,981,895,774.80
未分配利润	6.4.7.9	1,060,012,353.05	1,627,013,229.56
净资产合计		5,504,397,867.42	7,608,909,004.36
负债和净资产总计		5,763,993,697.80	8,098,963,372.80

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,444,385,514.37 份。本基金下属汇添富绝对收益定开混合 A 基金份额净值 1.244 元，基金份额总额 3,713,906,303.99 份；本基金下属汇添富绝对收益定开混合 C 基金份额净值 1.209 元，基金份额总额 730,479,210.38

份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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		**-83,803,551.98**	**-276,171,185.32**
1.利息收入		8,917,340.00	26,021,700.21
其中：存款利息收入	6.4.7.10	7,681,299.25	23,887,268.27
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		1,236,040.75	2,134,431.94
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-106,182,209.51	44,020,372.30
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-69,616,701.34	-1,022,401,851.90
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	26,284,148.35	18,489,790.97
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	-90,586,251.80	982,716,012.40
股利收益	6.4.7.17	27,736,595.28	65,216,420.83
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	12,533,841.36	-354,525,058.89
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	927,476.17	8,311,801.06
减：二、营业总支出		**56,174,232.57**	**141,050,040.09**
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	44,544,895.12	109,473,548.73
2．托管费	6.4.10.2.2	7,424,149.22	18,245,591.53
3．销售服务费		3,813,606.32	9,191,865.09
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		15,770.07	3,608,185.28

8．其他费用	6.4.7.21	375,811.84	530,849.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-139,977,784.55**	**-417,221,225.41**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-139,977,784.55**	**-417,221,225.41**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**-139,977,784.55**	**-417,221,225.41**

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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)	5,981,895,774.80	1,627,013,229.56	7,608,909,004.36
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	5,981,895,774.80	1,627,013,229.56	7,608,909,004.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,537,510,260.43	-567,000,876.51	-2,104,511,136.94
（一）、综合收益总额	-	-139,977,784.55	-139,977,784.55
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,537,510,260.43	-427,023,091.96	-1,964,533,352.39
其中：1.基金申购款	1,253,945.58	352,937.45	1,606,883.03
2.基金赎回款	-1,538,764,206.01	-427,376,029.41	-1,966,140,235.42
（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）	4,444,385,514.37	1,060,012,353.05	5,504,397,867.42
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）	18,991,829,582.14	7,562,155,912.12	26,553,985,494.26
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	18,991,829,582.14	7,562,155,912.12	26,553,985,494.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,696,292,729.30	-3,744,604,437.26	-12,440,897,166.56
（一）、综合收益总额	-	-417,221,225.41	-417,221,225.41
（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）	-8,696,292,729.30	-3,327,383,211.85	-12,023,675,941.15
其中：1.基金申购款	23,473,707.91	9,045,976.49	32,519,684.40
2.基金赎回款	-8,719,766,437.21	-3,336,429,188.34	-12,056,195,625.55
（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）	10,295,536,852.84	3,817,551,474.86	14,113,088,327.70

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：

张晖	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

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（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[2014]741 号文《关于核准汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》以及中国证监会机构部函[2016]2980 号文《关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金延期募集备案的回函》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 2017 年 3 月 15 日生效。首次设立基金募集规模为 493,313,864.49 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（2017）验字第 60466941_B11 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

自 2019 年 11 月 11 日起，本基金增设 C 类基金基金份额，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。

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，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)。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80％—120％之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货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比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。本基金基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的

风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。本基金的业绩比较基准为：一年期定期存款税后利率。

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	51,593,731.96
等于：本金	51,588,735.77
加：应计利息	4,996.19
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	51,593,731.96

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		3,436,192,283.39	-	3,244,699,731.99	-191,492,551.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	254,459,373.10	2,264,475.73	262,324,509.40	5,600,660.57
	银行间市场	1,042,746,105.80	10,059,585.82	1,058,672,675.82	5,866,984.20
	其他	-	-	-	-
	合计	1,297,205,478.90	12,324,061.55	1,320,997,185.22	11,467,644.77
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,733,397,762.29	12,324,061.55	4,565,696,917.21	-180,024,906.63

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-

（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	-2,686,303,367.87	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	-2,686,303,367.87	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-2,686,303,367.87	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2309	IF2309	-1,077	-1,240,380,900.00	-2,004,355.86
IF2312	IF2312	-1,254	-1,447,316,640.00	610,183.73
合计				-1,394,172.13
减：可抵销期货暂收款				-1,394,172.13
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-14,761.65	-
银行间市场	-	-

合计	-14,761.65	-

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	2,328,655.19
其中：交易所市场	2,328,655.19
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	144,630.98
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	219,497,235.20
合计	222,030,028.74

注：本基金适用国债冲抵期货备付金，其他负债-其他为期末应付各期货公司的备付金余额。

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富绝对收益定开混合 A	
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,012,013,427.60	5,012,013,427.60
本期申购	1,157,235.25	1,157,235.25
本期赎回（以“-”号填列）	-1,299,264,358.86	-1,299,264,358.86
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	3,713,906,303.99	3,713,906,303.99
汇添富绝对收益定开混合 C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	969,882,347.20	969,882,347.20
本期申购	96,710.33	96,710.33
本期赎回（以“-”号填列）	-239,499,847.15	-239,499,847.15
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	730,479,210.38	730,479,210.38

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

汇添富绝对收益定开混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,399,223,951.71	-10,276,892.13	1,388,947,059.58
本期利润	-123,998,637.20	9,686,454.84	-114,312,182.36
本期基金份额交易产生的变动数	-331,059,348.05	-36,061,364.09	-367,120,712.14
其中：基金申购款	287,677.63	40,966.15	328,643.78

基金赎回款	-331,347,025.68	-36,102,330.24	-367,449,355.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	944,165,966.46	-36,651,801.38	907,514,165.08
汇添富绝对收益定开混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	226,355,531.39	11,710,638.59	238,066,169.98
本期利润	-28,512,988.71	2,847,386.52	-25,665,602.19
本期基金份额交易产生的变动数	-48,689,388.41	-11,212,991.41	-59,902,379.82
其中：基金申购款	19,964.38	4,329.29	24,293.67
基金赎回款	-48,709,352.79	-11,217,320.70	-59,926,673.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	149,153,154.27	3,345,033.70	152,498,187.97

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	318,353.25
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	7,348,192.29
其他	14,753.71
合计	7,681,299.25

注:“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	4,505,350,796.34
减：卖出股票成本总额	4,563,842,444.36
减：交易费用	11,125,053.32
买卖股票差价收入	-69,616,701.34

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	24,753,879.40
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付）差价收入	1,530,268.95
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	26,284,148.35

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	1,649,418,706.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,612,976,924.30
减：应计利息总额	34,895,373.53
减：交易费用	16,140.00
买卖债券差价收入	1,530,268.95

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-

股指期货投资收益	-90,586,251.80
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

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	27,736,595.28
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	27,736,595.28

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	-33,312,574.89
——股票投资	-38,033,122.84
——债券投资	4,720,547.95
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	45,846,416.25
——权证投资	-
——期货投资	45,846,416.25
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	12,533,841.36

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	927,476.17
替代损益	-
其他	-
合计	927,476.17

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	17,320.93
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	236,352.56
合计	375,811.84

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人,基金销售机构,基金注册登记机构,基金发起人
招商银行股份有限公司（"招商银行"）	基金托管人,基金代销机构
东方证券股份有限公司（"东方证券"）	基金管理人的股东,基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	1,958,259,073.74	23.89	11,539,344,363.19	43.70

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	30,000,000.00	13.95	202,524,587.19	93.47

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	2,330,000,000.00	45.16	200,000,000.00	41.67

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	1,412,491.06	23.66	70,706.86	3.04
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	8,902,769.23	44.41	3,814,153.30	45.22

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	44,544,895.12	109,473,548.73
其中：支付销售机构的客户维护费	17,768,991.88	34,002,050.63

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

H=E×1.50%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,424,149.22	18,245,591.53

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

H=E×0.25%/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，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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		
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C	合计
招商银行股份有限公司	-	1,690,025.46	1,690,025.46
东方证券股份有限公司	-	31,312.70	31,312.70
汇添富基金管理股份有限公司	-	40,862.30	40,862.30
合计	-	1,762,200.46	1,762,200.46
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		
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C	合计
招商银行股份有限公司	-	4,865,663.64	4,865,663.64
东方证券股份有限公司	-	65,118.49	65,118.49
汇添富基金管理股份有限公司	-	78,570.99	78,570.99
合计	-	5,009,353.12	5,009,353.12

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值的 0.80%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.80%÷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

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: 本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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
招商银行	51,593,731.96	318,353.25	191,123,888.26	809,084.26

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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等相关法律法规、以及本基金合同的有关规定，经审慎研究并履行适当审批程序后，投资于基金托管人招商银行发行的股票招商银行。 于本报告期末，本基金持有招商银行 1,251,872.00 股。（于上年度可比期间，本基金持有招商银行 3,179,972.00 股。）

6.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期未进行利润分配。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	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	

				限						
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	
001380	华纬科技	2023年05月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	2023	5	新	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	

	威股份	年06月28日	个交易日	股流通受限						
301202	朗威股份	2023年06月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	
301203	国泰环保	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	
301225	恒勃股份	2023年06月08日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	
301232	飞沃科技	2023年06月08日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	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	2023年06月29	6个月	新股流	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	

	密	日		通受限						
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	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	
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	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	

				限						
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	威士顿	2023年06月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	
301317	鑫磊股份	2023年01月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	
301320	豪江智能	2023年06月01日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	
301337	亚华电子	2023年05月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	
301355	南	2023	6	新	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	

	王科技	年06月02日	个月	股流通受限						
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	
301360	荣旗科技	2023年04月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	
301376	致欧科技	2023年06月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	
301382	蜂助手	2023年05月09日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	
301383	天键股份	2023年05月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	
301397	溯联股	2023年06月15	6个月	新股流	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	

	份	日		通受限						
301399	英特科技	2023年05月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	
301428	世纪恒通	2023年05月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个交易日	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	
301488	豪恩汽电	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	2023年03月31日	6个月	新股流通受	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	

	集团			限						
601133	柏诚系统股份公司	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	
603125	江苏常青树科技	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	
688146	中船派瑞特气	2023年04月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	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	颀中科	2023年04月11	6个月	新股流	12.10	12.07	1,968	23,812.80	23,753.76	

	技	日		通受限						
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	2023年03	6个	新股	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	

	科技	月28日	月	流通受限						
688486	龙迅股份	2023年02月10日	6个月	新股流通受限	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	
688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	新股流通受限	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	
688523	航天环宇科技	2023年05月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	
688535	华海诚科新材料	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	
688552	航天南湖	2023年05月08日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	
688562	航天软件股份	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	
688581	安杰思	2023年05月12	6个月	新股流	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	

	医学	日		通受限						
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	
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	成功认购	受限	流通	认购价格	期末估值单价	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日	期	受限类型			位：张）			
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“科源制药”（证券代码：301281）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 97 股（根据山东科源制药股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告，科源制药以公司现有总股本 77,350,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 4 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 4 股，除权除息日为 2023 年 5 月 26 日。）。本基金持有的流通受限股票“索辰科技”（证券代码：688507）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 72 股（根据上海索辰信息科技股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告，索辰科技以公司现有总股本 41,333,400 股为基数，向全体股东每股派 0.15 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每股转增 0.48 股，除权除息日为 2023 年 6 月 20 日。）。

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于约定开放日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	51,593,731.96	-	-	-	-	-	51,593,731.96
结算备付金	780,985,220.95	-	-	-	-	-	780,985,220.95

存出保证金	1,265,273.72	-	-	-	-	322,523,704.80	323,788,978.52
交易性金融资产	135,369,330.59	110,510,413.27	484,464,866.03	590,652,575.33	-	3,244,699,731.99	4,565,696,917.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-14,761.65	-	-	-	-	-	-14,761.65
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	41,943,610.81	41,943,610.81
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	969,198,795.57	110,510,413.27	484,464,866.03	590,652,575.33	-	3,609,167,047.60	5,763,993,697.80
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	-	-	-	-	-	29,026,531	29,026,531

付清算款						.92	.92
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,803,020.02	6,803,020.02
应付托管费	-	-	-	-	-	1,133,836.69	1,133,836.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	582,189.30	582,189.30
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	20,223.71	20,223.71
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递	-	-	-	-	-	-	-

延所得税负债							
其他负债	-	-	-	-	-	222,030,028.74	222,030,028.74
负债总计	-	-	-	-	-	259,595,830.38	259,595,830.38
利率敏感度缺口	969,198,795.57	110,510,413.27	484,464,866.03	590,652,575.33	-	3,349,571,217.22	5,504,397,867.42
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	58,473,428.20	-	-	-	-	-	58,473,428.20
结算备付金	1,110,629,220.92	-	-	-	-	-	1,110,629,220.92
存	2,387,048.	-	-	-	-	427,239,03	429,626,08

出保证金	45					6.00	4.45
交易性金融资产	26,838,069.77	9,490,371.11	1,170,114,966.40	1,103,800,007.30	-	4,140,949,053.63	6,451,192,468.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-12,777.01	-	-	-	-	-	-12,777.01
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	49,054,948.03	49,054,948.03
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递	-	-	-	-	-	-	-

延所得税资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,198,314,990.33	9,490,371.11	1,170,114,966.40	1,103,800,007.30	-	4,617,243,037.66	8,098,963,372.80
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	-	-	-	-	-	9,698,973.70	9,698,973.70
应付托管费	-	-	-	-	-	1,616,495.62	1,616,495.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-	821,445.99	821,445.99
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	31,836.82	31,836.82
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延	-	-	-	-	-	-	-

所得税负债							
其他负债	-	-	-	-	-	477,885,616.31	477,885,616.31
负债总计	-	-	-	-	-	490,054,368.44	490,054,368.44
利率敏感度缺口	1,198,314,990.33	9,490,371.11	1,170,114,966.40	1,103,800,007.30	-	4,127,188,669.22	7,608,909,004.36

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	4,031,914.60	5,227,461.87

	基准利率增加 25 个基点	-4,003,130.25	-5,198,623.18

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	3,244,699,731.99	58.95	4,140,949,053.63	54.42
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	1,320,997,185.22	24.00	2,310,243,414.58	30.36
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	4,565,696,917.21	82.95	6,451,192,468.21	84.78

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%	23,805,807.61	44,331,124.89

	沪深 300 指数下跌 5%	-23,805,807.61	-44,331,124.89

注：本基金管理人运用资本一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	3,388,185,434.92
第二层次	1,176,063,475.91
第三层次	1,448,006.38
合计	4,565,696,917.21

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	3,244,699,731.99	56.29
	其中：股票	3,244,699,731.99	56.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,320,997,185.22	22.92
	其中：债券	1,320,997,185.22	22.92
	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	-14,761.65	0.00
	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	832,578,952.91	14.44
8	其他各项资产	365,732,589.33	6.35
9	合计	5,763,993,697.80	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	93,246,531.25	1.69
C	制造业	2,032,680,182.70	36.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,126,955.95	1.09
E	建筑业	44,381,264.15	0.81
F	批发和零售业	28,415,129.05	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	19,760,901.00	0.36
H	住宿和餐饮业	27,410,916.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	203,343,894.72	3.69
J	金融业	571,330,677.61	10.38
K	房地产业	78,750,491.45	1.43

L	租赁和商务服务业	26,239,915.95	0.48
M	科学研究和技术服务业	13,323,810.48	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	45,666,495.11	0.83
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,244,699,731.99	58.95

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	83,380	140,995,580.00	2.56
2	300750	宁德时代	500,767	114,570,481.93	2.08
3	601318	中国平安	1,943,995	90,201,368.00	1.64
4	600030	中信证券	3,885,231	76,849,869.18	1.40
5	002142	宁波银行	2,531,520	64,047,456.00	1.16
6	601658	邮储银行	11,136,400	54,456,996.00	0.99
7	000568	泸州老窖	246,881	51,738,851.17	0.94
8	002594	比亚迪	197,669	51,051,972.63	0.93
9	000333	美的集团	864,550	50,939,286.00	0.93
10	600900	长江电力	2,270,408	50,085,200.48	0.91
11	600085	同仁堂	860,017	49,502,578.52	0.90
12	300274	阳光电源	410,028	47,821,565.64	0.87
13	603198	迎驾贡酒	727,900	46,440,020.00	0.84

14	301267	华厦眼科	748,855	45,642,712.25	0.83
15	688239	贵州航宇科技	630,000	44,068,500.00	0.80
16	002371	北方华创	133,600	42,438,040.00	0.77
17	002384	东山精密	1,626,800	42,134,120.00	0.77
18	600036	招商银行	1,251,872	41,011,326.72	0.75
19	601899	紫金矿业	3,421,400	38,901,318.00	0.71
20	000683	远兴能源	5,367,467	38,592,087.73	0.70
21	001979	招商蛇口	2,793,500	36,399,305.00	0.66
22	300896	爱美客	80,141	35,658,737.95	0.65
23	600919	江苏银行	4,751,836	34,925,994.60	0.63
24	601939	建设银行	5,472,818	34,259,840.68	0.62
25	603369	今世缘	641,300	33,860,640.00	0.62
26	601601	中国太保	1,298,900	33,745,422.00	0.61
27	003031	中瓷电子	250,800	33,386,496.00	0.61
28	002840	华统股份	2,106,501	32,945,675.64	0.60
29	688111	金山办公	68,546	32,368,792.12	0.59
30	000651	格力电器	878,900	32,088,639.00	0.58
31	600325	华发股份	3,256,000	32,071,600.00	0.58
32	300059	东方财富	2,154,552	30,594,638.40	0.56
33	301165	锐捷网络	493,515	30,459,745.80	0.55
34	002541	鸿路钢构	980,203	28,239,648.43	0.51
35	600276	恒瑞医药	588,500	28,189,150.00	0.51
36	000938	紫光股	883,420	28,136,927.00	0.51

		份			
37	601117	中国化学	3,390,000	28,069,200.00	0.51
38	600754	锦江酒店	647,400	27,410,916.00	0.50
39	600938	中国海油	1,497,900	27,141,948.00	0.49
40	002709	天赐材料	651,282	26,826,305.58	0.49
41	300567	精测电子	280,300	26,670,545.00	0.48
42	000001	平安银行	2,350,571	26,396,912.33	0.48
43	601865	福莱特	680,000	26,186,800.00	0.48
44	688390	固德威电源	156,618	26,133,279.48	0.47
45	000858	五 粮液	156,300	25,565,991.00	0.46
46	688777	中控技术	406,915	25,546,123.70	0.46
47	600570	恒生电子	576,178	25,518,923.62	0.46
48	688037	芯源微电子	148,722	25,424,025.90	0.46
49	002050	三花智控	824,400	24,946,344.00	0.45
50	688072	拓荆科技	57,242	24,383,374.74	0.44
51	300848	美瑞新材	1,166,700	24,209,025.00	0.44
52	002236	大华股份	1,203,300	23,765,175.00	0.43
53	300014	亿纬锂能	389,821	23,584,170.50	0.43
54	002463	沪电股份	1,122,000	23,494,680.00	0.43
55	688066	北京航天宏图	380,000	23,142,000.00	0.42
56	600872	中炬高新	624,000	22,956,960.00	0.42
57	600188	兖矿能源	754,300	22,568,656.00	0.41
58	601689	拓普集	278,296	22,458,487.20	0.41

		团			
59	000729	燕京啤酒	1,750,000	21,822,500.00	0.40
60	600765	中航重机	806,277	21,374,403.27	0.39
61	600199	金种子酒	900,000	21,366,000.00	0.39
62	688639	华恒生物	233,467	21,124,094.16	0.38
63	000989	九 芝堂	1,500,000	20,760,000.00	0.38
64	601377	兴业证券	3,369,794	20,623,139.28	0.37
65	688668	鼎通科技	206,884	20,233,255.20	0.37
66	002460	赣锋锂业	328,500	20,025,360.00	0.36
67	300286	安科瑞	520,000	19,687,200.00	0.36
68	000821	京山轻机	955,600	19,551,576.00	0.36
69	002230	科大讯飞	286,700	19,484,132.00	0.35
70	601728	中国电信	3,415,000	19,226,450.00	0.35
71	601166	兴业银行	1,224,400	19,161,860.00	0.35
72	300395	菲利华	386,900	19,035,480.00	0.35
73	605089	味知香	474,360	18,642,348.00	0.34
74	688246	嘉和美康科技	437,296	18,309,583.52	0.33
75	300855	图南股份	507,717	17,932,564.44	0.33
76	601100	恒立液压	274,500	17,658,585.00	0.32
77	688661	和林微纳科技	249,804	17,561,221.20	0.32
78	603939	益丰药房	461,460	17,074,020.00	0.31
79	300068	南都电源	857,800	16,607,008.00	0.30
80	601390	中国中铁	2,150,600	16,301,548.00	0.30
81	603379	三美股	680,000	15,986,800.00	0.29

		份			
82	003022	联泓新科	622,900	15,510,210.00	0.28
83	002043	兔 宝宝	1,400,000	15,274,000.00	0.28
84	002558	巨人网络	850,000	15,240,500.00	0.28
85	600690	海尔智家	647,200	15,196,256.00	0.28
86	603799	华友钴业	319,718	14,678,253.38	0.27
87	601628	中国人寿	418,356	14,625,725.76	0.27
88	603605	珀莱雅	128,660	14,461,384.00	0.26
89	600309	万华化学	164,559	14,454,862.56	0.26
90	600760	中航沈飞	312,172	14,047,740.00	0.26
91	688383	新益昌科技	100,000	13,922,000.00	0.25
92	603986	兆易创新	130,400	13,855,000.00	0.25
93	688008	澜起科技	234,959	13,491,345.78	0.25
94	603259	药明康德	213,600	13,309,416.00	0.24
95	002352	顺丰控股	293,100	13,215,879.00	0.24
96	603806	福斯特	353,780	13,157,078.20	0.24
97	600926	杭州银行	1,104,546	12,978,415.50	0.24
98	688269	西安凯立新材	200,000	12,758,000.00	0.23
99	688630	芯碁微装	150,295	12,627,785.90	0.23
100	000933	神火股份	964,800	12,542,400.00	0.23
101	300442	润泽科技	381,160	11,724,481.60	0.21
102	002262	恩华药业	375,500	11,576,665.00	0.21
103	000063	中兴通讯	250,000	11,385,000.00	0.21

104	000963	华东医药	259,905	11,272,079.85	0.20
105	002920	德赛西威	71,600	11,155,996.00	0.20
106	600426	华鲁恒升	362,913	11,116,025.19	0.20
107	002756	永兴材料	176,962	11,079,590.82	0.20
108	601888	中国中免	98,615	10,899,915.95	0.20
109	002335	科华数据	298,634	10,735,892.30	0.20
110	000425	徐工机械	1,532,700	10,376,379.00	0.19
111	001914	招商积余	683,029	10,279,586.45	0.19
112	000690	宝新能源	1,425,400	10,006,308.00	0.18
113	002439	启明星辰	327,500	9,746,400.00	0.18
114	601398	工商银行	2,000,038	9,640,183.16	0.18
115	600436	片仔癀	30,700	8,791,252.00	0.16
116	600415	小商品城	1,000,000	8,530,000.00	0.15
117	688050	爱博诺德医疗	38,343	7,872,968.19	0.14
118	002966	苏州银行	1,192,600	7,811,530.00	0.14
119	002293	罗莱生活	656,110	7,545,265.00	0.14
120	002027	分众传媒	1,000,000	6,810,000.00	0.12
121	600009	上海机场	144,100	6,545,022.00	0.12
122	688270	浙江臻镭科技股份	100,000	6,493,000.00	0.12
123	300260	新莱应材	162,000	6,402,240.00	0.12
124	300316	晶盛机电	90,000	6,381,000.00	0.12
125	603596	伯特利	80,000	6,340,800.00	0.12

126	603197	保隆科技	110,000	5,967,500.00	0.11
127	002068	黑猫股份	500,000	5,935,000.00	0.11
128	600887	伊利股份	200,000	5,664,000.00	0.10
129	000680	山推股份	1,000,000	5,630,000.00	0.10
130	600406	国电南瑞	240,000	5,544,000.00	0.10
131	301317	鑫磊股份	200,694	5,414,161.98	0.10
132	688523	航天环宇科技	200,472	5,389,257.20	0.10
133	688232	国泰新点软件	100,000	5,381,000.00	0.10
134	601088	中国神华	150,719	4,634,609.25	0.08
135	002410	广联达	114,380	3,716,206.20	0.07
136	688378	奥来德光电	30,000	1,482,000.00	0.03
137	688443	智翔金泰	30,329	933,162.53	0.02
138	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.01
139	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
140	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.00
141	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
142	688472	阿特斯阳光电力	6,261	106,687.44	0.00
143	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
144	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
145	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
146	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
147	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00

148	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
149	688146	中船派瑞特气	1,011	38,549.43	0.00
150	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
151	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
152	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
153	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
154	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
155	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
156	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
157	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
158	688352	颀中科技	1,968	23,753.76	0.00
159	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
160	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
161	688458	美芯晟科技	221	20,057.96	0.00
162	688581	安杰思医学	163	19,238.89	0.00
163	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
164	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
165	688562	航天软件股份	726	16,197.06	0.00
166	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
167	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
168	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
169	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
170	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00

171	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
172	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
173	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
174	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
175	688629	四川华丰科技	708	13,161.72	0.00
176	688620	安凯微电子	1,016	12,537.44	0.00
177	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
178	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
179	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
180	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
181	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
182	601065	江西省盐业集团	875	10,360.00	0.00
183	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
184	688479	用友汽车信息科技	332	9,790.68	0.00
185	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
186	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
187	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
188	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
189	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
190	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
191	688535	华海诚科新材料	161	8,248.03	0.00
192	601133	柏诚系统股份	664	8,140.64	0.00

		公司			
193	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
194	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
195	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
196	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
197	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
198	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
199	603125	江苏常青树科技	160	3,924.80	0.00
200	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
201	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
202	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
203	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
204	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
205	000301	东方盛虹	21	248.22	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	301267	华厦眼科	71,700,806.73	0.94
2	601318	中国平安	69,649,118.34	0.92
3	300033	同花顺	62,513,558.00	0.82
4	300413	芒果超媒	62,512,603.16	0.82
5	002230	科大讯飞	61,991,902.00	0.81
6	000858	五 粮 液	60,550,613.00	0.80
7	603198	迎驾贡酒	58,065,572.34	0.76

8	002142	宁波银行	57,657,803.33	0.76
9	688239	贵州航宇科技	53,675,194.37	0.71
10	300848	美瑞新材	52,063,401.50	0.68
11	600702	舍得酒业	50,676,919.00	0.67
12	600085	同仁堂	48,868,918.32	0.64
13	601601	中国太保	45,553,763.00	0.60
14	688072	拓荆科技	44,929,008.05	0.59
15	000568	泸州老窖	44,480,949.55	0.58
16	600938	中国海油	44,390,629.15	0.58
17	000001	平安银行	41,682,423.08	0.55
18	605089	味知香	40,372,593.72	0.53
19	002594	比亚迪	39,080,806.00	0.51
20	601658	邮储银行	38,914,836.00	0.51

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	600519	贵州茅台	133,608,997.37	1.76
2	000858	五 粮 液	87,295,614.51	1.15
3	300033	同花顺	77,496,142.12	1.02
4	000568	泸州老窖	67,562,916.58	0.89
5	300413	芒果超媒	60,868,289.00	0.80
6	000001	平安银行	58,509,252.38	0.77
7	300347	泰格医药	57,168,754.91	0.75
8	601888	中国中免	56,479,934.59	0.74
9	605089	味知香	55,231,903.02	0.73
10	300059	东方财富	55,112,601.87	0.72
11	688111	金山办公	54,948,625.61	0.72
12	002230	科大讯飞	53,715,328.74	0.71
13	600702	舍得酒业	52,501,144.90	0.69
14	601398	工商银行	46,823,642.37	0.62
15	300498	温氏股份	45,462,451.70	0.60
16	601669	中国电建	45,137,227.14	0.59
17	600809	山西汾酒	44,809,658.73	0.59
18	601658	邮储银行	43,855,676.00	0.58
19	300015	爱尔眼科	43,828,318.77	0.58
20	688639	华恒生物	43,269,889.19	0.57

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,705,626,245.56
卖出股票收入（成交）总额	4,505,350,796.34

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	300,677,213.11	5.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	569,927,784.16	10.35
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	142,165,498.20	2.58
5	企业短期融资券	20,173,800.55	0.37
6	中期票据	142,714,778.15	2.59
7	可转债（可交换债）	145,338,111.05	2.64
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,320,997,185.22	24.00

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	220013	22 附息国债 13	3,000,000	300,677,213.11	5.46
2	2128021	21 工商银行永续债 01	1,000,000	103,043,103.83	1.87
3	1928033	19 中国银行二级 03	600,000	62,581,426.85	1.14
4	110059	浦发转债	500,000	54,046,136.99	0.98
5	2028037	20 光大银行永	500,000	53,546,589.04	0.97

		续债			

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

本基金根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截止本报告期末，本基金持有的股票资产 3,244,699,731.99 元，占基金资产净值的比例为 58.95%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-2,687,697,540.00 元，占基金资产净值的比例为-48.83%，运用股指期货进行对冲的空头合约市值占股票资产的比例为-82.83%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-160,202,953.14 元，公允价值变动损益为 7,813,293.41 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司、中信证券股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、上海浦东发展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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	323,788,978.52
2	应收清算款	41,943,610.81
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	365,732,589.33

7.13.4 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	110059	浦发转债	54,046,136.99	0.98
2	113052	兴业转债	50,856,534.25	0.92
3	113062	常银转债	9,056,994.85	0.16
4	113641	华友转债	4,765,326.95	0.09
5	113652	伟 22 转债	3,033,142.56	0.06
6	118008	海优转债	1,920,485.97	0.03
7	110085	通 22 转债	1,761,866.41	0.03
8	113061	拓普转债	1,602,738.46	0.03
9	113633	科沃转债	1,584,917.97	0.03
10	127024	盈峰转债	1,433,015.80	0.03
11	113661	福 22 转债	628,233.29	0.01
12	113655	欧 22 转债	522,359.01	0.01

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富绝对收益定开混合 A	58,180	63,834.76	53,786,190.09	1.45	3,660,120,113.90	98.55
汇添富绝对收益定开混合 C	9,054	80,680.28	33,211,079.43	4.55	697,268,130.95	95.45
合计	67,234	66,103.24	86,997,269.52	1.96	4,357,388,244.85	98.04

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	汇添富绝对收益定开混合 A	3,640,870.24	0.10
	汇添富绝对收益定开混合 C	18,652.12	0.00
	合计	3,659,522.36	0.08

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富绝对收益定开混合 A	0
	汇添富绝对收益定开混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富绝对收益定开混合 A	>100
	汇添富绝对收益定开混合 C	0
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,001,000.00 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 03 月 15 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
基金合同生效日（2017 年 03 月 15 日）基金份额总额	493,313,864.49	-
本报告期期初基金份额总额	5,012,013,427.60	969,882,347.20
本报告期基金总申购份额	1,157,235.25	96,710.33
减：本报告期基金总赎回份额	1,299,264,358.86	239,499,847.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,713,906,303.99	730,479,210.38

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，基金托管人无重大人事变动。

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。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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（%）	
东方证券	2	1,958,259,073.74	23.89	1,412,491.06	23.66	
中信证券	2	1,887,961,832.50	23.03	1,361,774.98	22.81	
天风证券	2	710,927,968.39	8.67	512,795.12	8.59	
广发证券	4	568,674,043.62	6.94	410,187.47	6.87	
东方	2	519,863,136.39	6.34	432,208.37	7.24	

财富						
中信建投证券	2	451,993,609.75	5.51	326,016.74	5.46	
国泰君安	2	406,021,830.92	4.95	292,862.76	4.91	
申万宏源证券	2	386,900,689.91	4.72	279,073.73	4.67	
安信证券	2	357,269,936.46	4.36	257,701.38	4.32	
开源证券	2	321,880,773.72	3.93	232,172.38	3.89	
海通证券	2	235,766,083.39	2.88	170,058.73	2.85	
德邦证券	2	105,754,422.61	1.29	76,280.97	1.28	
国信证券	2	88,801,390.90	1.08	64,053.37	1.07	
华安证券	2	71,776,764.64	0.88	51,773.54	0.87	
民生证券	2	55,394,161.60	0.68	39,956.82	0.67	
东北证券	2	51,032,950.16	0.62	36,810.29	0.62	
国金证券	2	19,433,523.27	0.24	14,016.82	0.23	
财达证券	2	-	-	-	-	
高盛中国	2	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
招商证券	3	-	-	-	-	
中原证券	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（%）
东方证券	30,000,000.00	13.95	2,330,000,000.00	45.16	-	-	-	-
中信证券	85,395,659.30	39.70	1,480,000,000.00	28.68	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	14,735,848.40	6.85	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	1,350,000,000.00	26.16	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	72,478,496.12	33.69	-	-	-	-	-	-

证券								
安信证券	12,494,825.73	5.81	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛	-	-	-	-	-	-	-	-

中国								
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金第十一次开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 19 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
3	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下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 03 月 22 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日

§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绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式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、报告期内汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式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