

汇添富创新活力混合型证券投资基金 2023 年 中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	73
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	73

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
7.12 投资组合报告附注.....	73
§ 8 基金份额持有人信息.....	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	75
§ 9 开放式基金份额变动.....	76
§ 10 重大事件揭示.....	76
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
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.....	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
10.4 基金投资策略的改变.....	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
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.....	77
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
10.8 其他重大事件.....	81
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
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.....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§ 12 备查文件目录.....	82
12.1 备查文件目录.....	82
12.2 存放地点.....	82
12.3 查阅方式.....	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富创新活力混合型证券投资基金		
基金简称	汇添富创新活力混合		
基金主代码	002419		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 07 月 13 日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额（份）	109,240,081.86		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富创新活力混合 A	汇添富创新活力混合 C	汇添富创新活力混合 D
下属分级基金的交易代码	002419	014836	014837
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	92,943,956.84	16,052,040.00	244,085.02

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，以基本面分析为立足点精选优质上市公司股票，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转债及可交换债投资策略、股指期货投资策略、融资投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*20%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。 本基金除了投资 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	王小飞
	联系电话	021-28932888	021-60637103
	电子邮箱	service@99fund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	021-60637228
传真		021-28932998	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200010	100033
法定代表人		李文	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路728号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	报告期(2023年01月01日 - 2023年06月30日)		
	汇添富创新活力混合 A	汇添富创新活力混合 C	汇添富创新活力混合 D
本期已实现收益	6,315,626.42	382,618.78	147,895.59
本期利润	15,979,420.94	559,886.99	1,198,843.65
加权平均基金份额本期利润	0.1568	0.2264	0.3598

本期加权平均净值利润率	8.63%	12.38%	19.96%
本期基金份额净值增长率	8.87%	8.31%	8.70%
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	64,794,438.69	10,867,482.77	168,662.87
期末可供分配基金份额利润	0.6971	0.6770	0.6910
期末基金资产净值	172,070,795.24	29,332,574.15	450,333.72
期末基金份额净值	1.8513	1.8273	1.8450
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	-8.26%	-9.09%	-8.53%

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

汇添富创新活力混合 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	3.17%	1.93%	1.90%	0.76%	1.27%	1.17%

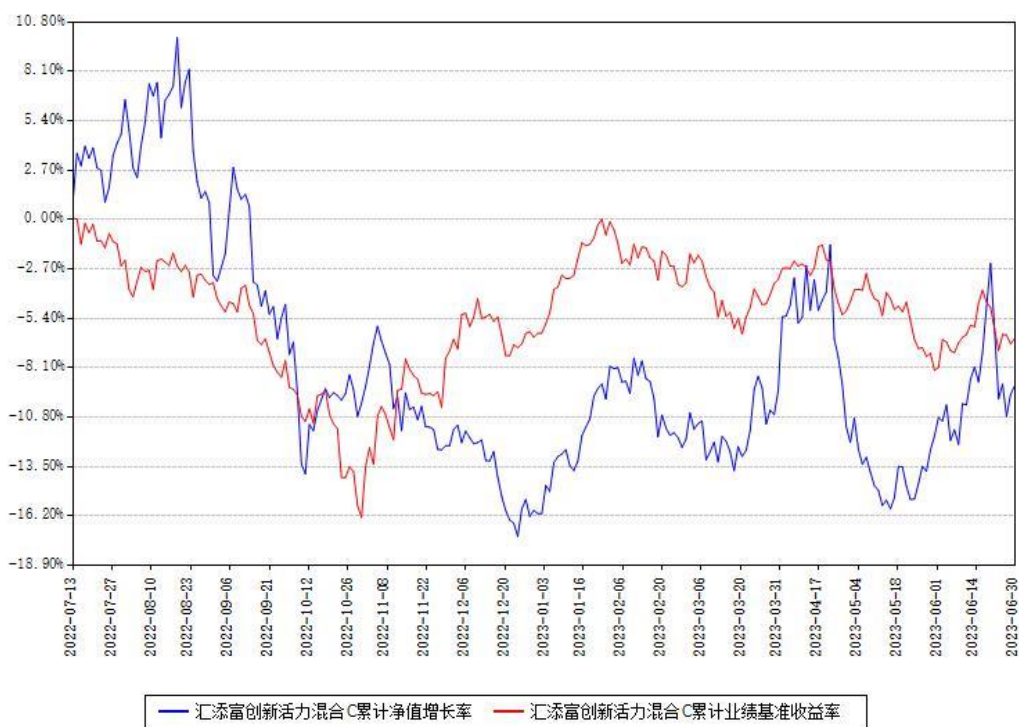
个月						
过去三个月	0.47%	1.81%	-3.34%	0.69%	3.81%	1.12%
过去六个月	8.87%	1.50%	-0.31%	0.71%	9.18%	0.79%
自基金合同生效日起至今	-8.26%	1.47%	-6.50%	0.86%	-1.76%	0.61%
汇添富创新活力混合 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.10%	1.93%	1.90%	0.76%	1.20%	1.17%
过去三个月	0.27%	1.81%	-3.34%	0.69%	3.61%	1.12%
过去六个月	8.31%	1.50%	-0.31%	0.71%	8.62%	0.79%
自基金合同生效日起至今	-9.09%	1.47%	-6.50%	0.86%	-2.59%	0.61%
汇添富创新活力混合 D						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.15%	1.93%	1.90%	0.76%	1.25%	1.17%
过去三个月	0.42%	1.81%	-3.34%	0.69%	3.76%	1.12%
过去六个月	8.70%	1.50%	-0.31%	0.71%	9.01%	0.79%
自基金合同生效日起至今	-8.53%	1.47%	-6.50%	0.86%	-2.03%	0.61%

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

汇添富创新活力混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富创新活力混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富创新活力混合D累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2022 年 07 月 13 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本基金由原汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金于 2022 年 07 月 13 日转型而来。

§ 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		
沈若雨	本基金的基金经理	2022 年 07 月 13 日		11	国籍：中国。学历：复旦大学微电子学学士，悉尼大学数量金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年 11 月至 2013 年 9 月任申银万国证券研究所分析师，2013 年 10 月至 2015 年 3 月任富国基金分析师，2015 年 4 月至 2020 年 4 月任易方达基金研究部高级研究员。2020 年 5 月起任汇添

					<p>富基金管理股份有限公司研究部高级行业分析师。2020年6月18日至今任汇添富全球移动互联网灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2020年6月18日至今任汇添富移动互联股票型证券投资基金的基金经理助理。2021年1月12日至2022年7月12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。2021年9月15日至今任汇添富互联网核心资产六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022年2月21日至今任汇添富自主核心科技一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022年</p>
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					7月13日至 今任汇添富 创新活力混 合型证券投 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 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

交易比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，A 股市场表现分化，上证指数上涨 3.7%，沪深 300 指数下跌 0.8%，创业板指数下跌 5.6%。通信、传媒、计算机板块期间涨幅居前。港股市场震荡调整，恒生指数下跌 4.4%，恒生科技指数下跌 5.3%。

在报告期内，本基金坚持了以科技股为主的投资策略。在一季度增持了受益于人工智能行业发展的计算机、通信行业个股，同时对科技自主可控投资方向维持了重点配置。目前我国经济处在高质量发展时期，在全社会数字化转型的浪潮中，科技产业的发展是提高社会生产力和生产效率的关键，也是经济发展最核心的环节。回顾历史，科技产业发展往往呈现出螺旋式上升的趋势。过去一段时间科技产业纵有波折，但拉长周期视角来看，科技产业仍然在不断进步。

我们看好以大语言模型为代表的人工智能技术将会给整个科技行业带来深刻、长远的变化。人工智能技术本质上将提升各行业的生产力和生产效率，这一方向也符合目前高质量增长时代背景下对经济结构转型的要求。从产业发展的阶段来看，目前人工智能技术仍处于加速渗透的早期阶段，未来将在以下几个方向深刻改变科技行业：1) 加快各行业对于新知识的学习曲线，以大模型能力为例，基本以月为单位就会有明显的功能升级迭代；2) 简化专业软件的操作壁垒，带来人机交互界面的创新性体验，类似当年微软推出 Windows 视窗操作系统，苹果推出触摸屏手机操作界面，进而带动 AI 相关应用的用户规模增长；3) 对传统行业运营进行降本增效，目前人工智能技术已充分应用于电话客服、游戏美术开发等领域，对于传统行业的效率提升明显。从人工智能行业发展的要素来看，数据、算法、算力覆盖了传统科技行业的软件互联网、半导体通信硬件等各个环节，将对整体科技行业的发展产生系统

性的拉动。本季度我们主要对算力硬件基础设施、以及 2B 软件应用、游戏、自动驾驶相关的行业和个股进行了增持。除此之外，我们继续对科技自主可控方向保持跟踪研究，这也是未来我国科技行业能够可持续发展的基石，因此我们也继续对半导体设备材料、软件国产化等投资方向进行了积极的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富创新活力混合 A 类份额净值增长率为 8.87%，同期业绩比较基准收益率为-0.31%。本报告期汇添富创新活力混合 C 类份额净值增长率为 8.31%，同期业绩比较基准收益率为-0.31%。本报告期汇添富创新活力混合 D 类份额净值增长率为 8.70%，同期业绩比较基准收益率为-0.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断未来国内经济处在底部逐渐复苏的过程中，中长期中国经济模式从城镇化拉动的快速增长，转向后城镇化时代由科技创新驱动的高质量增长，寻找结构性机会仍然是未来组合获取超额收益的重要工作之一。从估值角度，市场处在历史偏低的水平，整体处于左侧布局优质个股的时间段，我们将持续挖掘科技相关的投资机会，争取为投资人创造更多收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类、D 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益

分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富创新活力混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	60,302,287.95	46,997,183.65
结算备付金		661,036.38	541,942.39
存出保证金		118,350.66	226,438.32

交易性金融资产	6.4.7.2	171,455,239.10	172,432,687.02
其中：股票投资		171,455,239.10	172,432,687.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	5,501,404.48
应收股利		42.40	-
应收申购款		7,783.48	15,545.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		232,544,739.97	225,715,201.84
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		29,852,757.24	10,109,674.97
应付赎回款		1,900.51	46,165.70
应付管理人报酬		197,015.62	225,602.74
应付托管费		41,044.94	47,000.59
应付销售服务费		18,161.15	3,040.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	580,157.40	486,749.36
负债合计		30,691,036.86	10,918,234.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	109,240,081.86	126,335,626.28
未分配利润	6.4.7.9	92,613,621.25	88,461,341.30
净资产合计		201,853,703.11	214,796,967.58
负债和净资产总计		232,544,739.97	225,715,201.84

注：1、报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 109,240,081.86 份。本基金下属汇

添富创新活力混合 A 基金份额净值 1.8513 元，基金份额总额 92,943,956.84 份；本基金下属汇添富创新活力混合 C 基金份额净值 1.8273 元，基金份额总额 16,052,040.00 份；本基金下属汇添富创新活力混合 D 基金份额净值 1.8450 元，基金份额总额 244,085.02 份。

2、本基金合同于 2022 年 07 月 13 日生效，上年度实际报告期间为 2022 年 07 月 13 日至 2022 年 12 月 31 日，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：汇添富创新活力混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		19,284,254.95
1. 利息收入		61,352.79
其中：存款利息收入	6.4.7.10	61,352.79
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,273,703.39
其中：股票投资收益	6.4.7.11	7,584,341.26
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,537.92
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	686,824.21
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	10,892,010.79
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	57,187.98
减：二、营业总支出		1,546,103.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,171,677.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	244,296.65
3. 销售服务费		24,613.34
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		-
8. 其他费用	6. 4. 7. 21	105, 516. 01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17, 738, 151. 58
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17, 738, 151. 58
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		17, 738, 151. 58

注：本基金合同于 2022 年 07 月 13 日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富创新活力混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	126, 335, 626. 28	88, 461, 341. 30	214, 796, 967. 58
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	126, 335, 626. 28	88, 461, 341. 30	214, 796, 967. 58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17, 095, 544. 42	4, 152, 279. 95	-12, 943, 264. 47
（一）、综合收益总额	-	17, 738, 151. 58	17, 738, 151. 58
（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）	-17, 095, 544. 42	-13, 585, 871. 63	-30, 681, 416. 05
其中：1. 基金申购款	22, 795, 865. 50	18, 491, 043. 61	41, 286, 909. 11
2. 基金赎回款	-39, 891, 409. 92	-32, 076, 915. 24	-71, 968, 325. 16
（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）	109,240,081.86	92,613,621.25	201,853,703.11

注：本基金合同于 2022 年 07 月 13 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

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

汇添富创新活力混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），是由汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金变更而来，汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的前身为汇添富盈安保本混合型证券投资基金。汇添富盈安保本混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]202 号文《关于准予汇添富盈安保本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 2016 年 4 月 19 日生效。首次设立基金募集规模为 4,570,074,199.91 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（2016）验字第 60466941_B07 号验资报告予以验证。

汇添富盈安保本混合型证券投资基金于 2019 年 4 月 20 日第一个保本周期到期，由于不符合保本基金存续条件，按照《汇添富盈安保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，该基金保本周期到期后转型为非保本的混合基金，名称相应变更为“汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金”，该变更无须基金份额持有人大会决议。2019 年 4 月 27 日，《汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

自 2022 年 1 月 17 日起，汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金增设 C 类和 D 类基金份额，原基金份额变更为 A 类基金份额，基金注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司。

根据相关法律法规及《关于汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金转型的议案》的规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自 2022 年 7 月 13 日起，汇添富盈安

灵活配置混合型证券投资基金转型为汇添富创新活力混合型证券投资基金。根据转型安排，修订后的《汇添富创新活力混合型证券投资基金基金合同》自 2022 年 7 月 13 日起生效，《汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金》同日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 60%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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。本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，以基本面分析为立足点精选优质上市公司股票，力争实现基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单

以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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	60,302,287.95
等于：本金	60,299,244.42
加：应计利息	3,043.53
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	60,302,287.95

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	169,126,984.64	-	171,455,239.10	2,328,254.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	169,126,984.64	-	171,455,239.10	2,328,254.46

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	425,854.84
其中：交易所市场	425,854.84
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	94,795.19
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	580,157.40

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富创新活力混合 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	116,085,041.50	116,085,041.50
本期申购	6,566,942.21	6,566,942.21
本期赎回（以“-”号填列）	-29,708,026.87	-29,708,026.87
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	92,943,956.84	92,943,956.84
汇添富创新活力混合 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	12,263.13	12,263.13
本期申购	16,097,696.70	16,097,696.70

本期赎回（以“-”号填列）	-57,919.83	-57,919.83
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	16,052,040.00	16,052,040.00
汇添富创新活力混合 D		
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	10,238,321.65	10,238,321.65
本期申购	131,226.59	131,226.59
本期赎回（以“-”号填列）	-10,125,463.22	-10,125,463.22
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	244,085.02	244,085.02

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

汇添富创新活力混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	72,366,845.76	8,945,566.32	81,312,412.08
本期利润	6,315,626.42	9,663,794.52	15,979,420.94
本期基金份额交易产生的变动数	-13,888,033.49	-4,276,961.13	-18,164,994.62
其中：基金申购款	4,241,409.47	1,375,793.96	5,617,203.43
基金赎回款	-18,129,442.96	-5,652,755.09	-23,782,198.05
本期已分配利润	-	-	-

本期末	64,794,438.69	14,332,399.71	79,126,838.40
汇添富创新活力混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	7,492.37	933.68	8,426.05
本期利润	382,618.78	177,268.21	559,886.99
本期基金份额交易产生的变动数	10,477,371.62	2,234,849.49	12,712,221.11
其中：基金申购款	10,514,017.48	2,246,889.66	12,760,907.14
基金赎回款	-36,645.86	-12,040.17	-48,686.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,867,482.77	2,413,051.38	13,280,534.15
汇添富创新活力混合 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	6,353,118.49	787,384.68	7,140,503.17
本期利润	147,895.59	1,050,948.06	1,198,843.65
本期基金份额交易产生的变动数	-6,332,351.21	-1,800,746.91	-8,133,098.12
其中：基金申购款	84,066.18	28,866.86	112,933.04
基金赎回款	-6,416,417.39	-1,829,613.77	-8,246,031.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	168,662.87	37,585.83	206,248.70

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	50,448.67
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	9,543.18
其他	1,360.94
合计	61,352.79

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	589,186,702.57
减：卖出股票成本总额	580,008,851.10
减：交易费用	1,593,510.21
买卖股票差价收入	7,584,341.26

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	3,834.92
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-1,297.00
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	2,537.92

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	3,455,826.22
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	3,403,274.00
减：应计利息总额	53,849.22
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,297.00

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	686,824.21
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	686,824.21

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	10,892,010.79
——股票投资	10,892,010.79
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	10,892,010.79

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	57,187.98
替代损益	-
其他	-
合计	57,187.98

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	1,971.49
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	641.96
合计	105,516.01

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	101,328,564.57	8.85

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期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	73,417.85	8.81	30,715.08	7.21

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
当期发生的基金应支付的管理费	1,171,677.37
其中：支付销售机构的客户维护费	349,854.89

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的帐号路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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
当期发生的基金应支付的托管费	244,296.65

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
-------	---------------------------------------

务费的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	汇添富创新活力混合 A	汇添富创新活力混合 C	汇添富创新活力混合 D	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	0.77	408.65	409.42
合计	-	0.77	408.65	409.42

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按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.80% 年费率计提，D 类基金份额的销售服务费按前一日 D 类基金份额资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{该类基金份额的销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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末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	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	60,302,287.95	50,448.67

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：本基金本报告期末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	62	1,731.66	2,047.86	
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	

		日		限						
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	229	2,720.52	4,813.58	
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	91	1,399.58	1,353.17	
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	31	1,378.88	1,223.88	
300804	广康生化	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	132	5,603.40	4,352.04	
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	99	5,593.50	5,240.07	
301170	锡南科技	2023年06月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	119	4,046.00	4,156.67	
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	1,293	33,385.26	33,385.26	
301202	朗	2023	6	新	25.82	25.82	144	3,718.08	3,718.08	

	威股份	年 06 月 28 日	个 月	股 流 通 受 限						
301203	国泰环保	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	46.13	34.40	146	6,734.98	5,022.40	
301225	恒勃股份	2023 年 06 月 08 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	35.66	33.26	151	5,384.66	5,022.26	
301232	飞沃科技	2023 年 06 月 08 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	72.50	58.42	70	5,075.00	4,089.40	
301260	格力博	2023 年 01 月 20 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	30.85	23.63	392	12,093.20	9,262.96	
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	989	36,494.10	36,494.10	
301261	恒工精密	2023 年 06 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	36.90	36.90	110	4,059.00	4,059.00	
301262	海看股	2023 年 06 月 06 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	30.22	25.50	208	6,285.76	5,304.00	

	份	月 13 日		通 受 限						
301281	科 源 制 药	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	31.45	25.10	170	5,345.78	4,267.00	
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	2,585	51,674.15	51,674.15	
301292	海 科 新 源	2023 年 06 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.99	19.99	288	5,757.12	5,757.12	
301293	三 博 脑 科	2023 年 04 月 25 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	29.60	71.42	167	4,943.20	11,927.14	
301301	川 宁 生 物	2022 年 12 月 20 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	5.00	8.96	1,850	9,250.00	16,576.00	
301305	朗 坤 环 境	2023 年 05 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	25.25	19.69	239	6,034.75	4,705.91	
301307	美 利 信	2023 年 04 月 14	6 个 月	新 股 流 通 受	32.34	31.86	211	6,823.74	6,722.46	

		日		限						
301310	鑫宏业	2023年05月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	128	8,611.84	8,375.04	
301315	威士顿	2023年06月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	130	4,197.70	6,645.60	
301317	鑫磊股份	2023年01月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	465	9,611.55	12,169.05	
301337	亚华电子	2023年05月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	128	4,172.80	3,887.36	
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	73	5,361.85	3,404.72	
301355	南王科技	2023年06月02日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	261	4,580.55	4,371.75	
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	264	6,275.28	11,322.96	
301360	荣	2023	6	新	71.88	92.60	71	5,103.48	6,574.60	

	旗科技	2023年04月17日	6个月	新股流通受限						
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	194	6,543.62	6,178.90	
301376	致欧科技	2023年06月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	200	4,932.00	4,502.00	
301382	蜂助手	2023年05月09日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	170	4,046.00	5,582.80	
301383	天键股份	2023年05月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	151	6,970.16	5,393.72	
301397	溯联股份	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	118	6,285.86	4,743.60	
301399	英特科技	2023年05月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	125	5,498.75	6,446.25	
301428	世纪恒	2023年05月	6个月	新股流	26.35	30.60	161	4,242.35	4,926.60	

	通	月		通						
	10	日		受						
	限			限						
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	269	5,377.31	4,546.10	
301488	豪恩汽车	2023年06月26日	6个交易日	新股流通受限	39.78	39.78	1,178	46,860.84	46,860.84	
301488	豪恩汽车	2023年06月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	131	5,211.18	5,211.18	
688515	裕太微电子	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	92.00	162.75	1,076	98,992.00	175,119.00	
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 49 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。）。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融

机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	60,302,287.95	-	-	-	-	-	60,302,287.95
结算备付金	661,036.38	-	-	-	-	-	661,036.38
存出保证金	118,350.66	-	-	-	-	-	118,350.66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	171,455,239.10	171,455,239.10
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	-	-	-	-	-	42.40	42.40
应收	-	-	-	-	-	7,783.48	7,783.48

申购款							
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	61,081,674.99	-	-	-	-	171,463,064.98	232,544,739.97
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	-	-	-	-	-	29,852,757.24	29,852,757.24
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,900.51	1,900.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	197,015.62	197,015.62
应付托管费	-	-	-	-	-	41,044.94	41,044.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-	18,161.15	18,161.15
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	-	-	-	-	-	580,157.40	580,157.40
负债总计	-	-	-	-	-	30,691,036.86	30,691,036.86
利率敏感度缺口	61,081,674.99	-	-	-	-	140,772,028.12	201,853,703.11
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	46,997,183.65	-	-	-	-	-	46,997,183.65
结算备付金	541,942.39	-	-	-	-	-	541,942.39
存出保证金	226,438.32	-	-	-	-	-	226,438.32
交易性金融资产	-	-	-	-	-	172,432,687.02	172,432,687.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	5,501,404.48	5,501,404.48
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	15,545.98	15,545.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	47,765,564.36	-	-	-	-	177,949,637.48	225,715,201.84
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	-	-	-	-	-	10,109,674.97	10,109,674.97
应付赎回款	-	-	-	-	-	46,165.70	46,165.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	225,602.74	225,602.74
应付	-	-	-	-	-	47,000.59	47,000.59

托管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,040.90	3,040.90
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	-	-	-	-	-	486,749.36	486,749.36
负债总计	-	-	-	-	-	10,918,234.26	10,918,234.26
利率敏感度缺口	47,765,564.36	-	-	-	-	167,031,403.22	214,796,967.58

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	11,692,221.21	-	11,692,221.21
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	-	42.40	-	42.40
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	11,692,263.61	-	11,692,263.61
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	-	11,692,263.61	-	11,692,263.61
	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	-	25,731,767.87	-	25,731,767.87
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	25,731,767.87	-	25,731,767.87

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	-	25,731,767.87	-	25,731,767.87

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	584,613.18	1,286,588.39

	港币相对人民币贬值 5%	-584,613.18	-1,286,588.39
--	--------------	-------------	---------------

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	171,455,239.10	84.94	172,432,687.02	80.28
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	171,455,239.10	84.94	172,432,687.02	80.28

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%	6,912,963.94	5,878,289.70
	沪深 300 指数下跌 5%	-6,912,963.94	-5,878,289.70

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	170,862,355.05
第二层次	203,735.73
第三层次	389,148.32
合计	171,455,239.10

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	171,455,239.10	73.73
	其中：股票	171,455,239.10	73.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	60,963,324.33	26.22
8	其他各项资产	126,176.54	0.05
9	合计	232,544,739.97	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 11,692,221.21 元，占期末净值比例为 5.79%。

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	26,803.02	0.01
B	采矿业	99,185.23	0.05
C	制造业	94,354,407.26	46.74

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,943.68	0.04
E	建筑业	66,175.10	0.03
F	批发和零售业	233,899.30	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	62,538.00	0.03
H	住宿和餐饮业	11,777.40	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,194,081.27	24.37
J	金融业	4,120,184.12	2.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,718.69	0.01
M	科学研究和技术服务业	6,649,743.68	3.29
N	水利、环境和公共设施管理业	464,349.29	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	150,142.63	0.07
R	文化、体育和娱乐业	4,230,069.22	2.10
S	综合	-	-
	合计	159,763,017.89	79.15

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	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	13,389.91	0.01
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	11,678,831.30	5.79
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	11,692,221.21	5.79

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	00700	腾讯控股	38,200	11,678,831.30	5.79
2	300820	英杰电气	105,600	8,699,328.00	4.31
3	688111	金山办公	16,890	7,975,795.80	3.95
4	688630	芯碁微装	83,333	7,001,638.66	3.47
5	000063	中兴通讯	144,400	6,575,976.00	3.26
6	002463	沪电股份	312,200	6,537,468.00	3.24
7	603859	能科科技	124,200	6,350,346.00	3.15
8	688169	石头科技	19,390	6,217,985.20	3.08
9	002230	科大讯飞	91,000	6,184,360.00	3.06
10	688383	新益昌科技	44,368	6,176,912.96	3.06
11	300634	彩讯股份	218,500	5,768,400.00	2.86
12	600570	恒生电子	108,600	4,809,894.00	2.38
13	601138	工业富联	179,100	4,513,320.00	2.24
14	300627	华测导航	138,300	4,490,601.00	2.22
15	002602	世纪华通	564,200	4,282,278.00	2.12
16	000938	紫光股份	133,300	4,245,605.00	2.10
17	300031	宝通科技	165,800	4,098,576.00	2.03
18	688239	贵州航宇科技	58,588	4,098,230.60	2.03
19	002705	新宝股份	226,900	4,091,007.00	2.03
20	603596	伯特利	50,400	3,994,704.00	1.98
21	300033	同花顺	22,700	3,978,856.00	1.97

22	000651	格力电器	107,600	3,928,476.00	1.95
23	603516	淳中科技	156,100	3,442,005.00	1.71
24	300223	北京君正	35,186	3,107,275.66	1.54
25	002558	巨人网络	167,600	3,005,068.00	1.49
26	300182	捷成股份	419,600	2,647,676.00	1.31
27	300442	润泽科技	85,660	2,634,901.60	1.31
28	688369	致远互联	47,638	2,634,381.40	1.31
29	688031	星环科技	16,220	2,161,152.80	1.07
30	002605	姚记科技	45,700	2,121,851.00	1.05
31	000997	新大陆	106,900	2,020,410.00	1.00
32	002049	紫光国微	21,200	1,976,900.00	0.98
33	688071	华依科技集团	32,239	1,971,414.85	0.98
34	688037	芯源微电子	11,193	1,913,443.35	0.95
35	600986	浙文互联	244,400	1,564,160.00	0.77
36	300133	华策影视	214,000	1,517,260.00	0.75
37	002803	吉宏股份	74,000	1,514,040.00	0.75
38	688661	和林微纳科技	20,851	1,465,825.30	0.73
39	688515	裕太微电子	1,076	175,119.00	0.09
40	002409	雅克科技	2,200	160,336.00	0.08
41	301366	一博科技	3,312	143,906.40	0.07
42	688230	芯导科技	3,049	138,150.19	0.07
43	301109	军信股份	8,085	133,483.35	0.07

44	301200	大族数控	3,255	129,809.40	0.06
45	688150	莱特光电股份	5,626	126,022.40	0.06
46	301139	元道通信	4,351	125,700.39	0.06
47	688291	金橙子科技	3,608	114,229.28	0.06
48	301396	宏景科技	3,295	107,581.75	0.05
49	688114	华大智造	1,190	103,006.40	0.05
50	688257	新锐股份	3,788	100,419.88	0.05
51	301181	标榜股份	3,333	100,289.97	0.05
52	301377	鼎泰高科	4,280	98,440.00	0.05
53	688173	希荻微电子	4,236	96,919.68	0.05
54	688231	隆达超合金股份	3,395	96,859.35	0.05
55	301267	华夏眼科	1,587	96,727.65	0.05
56	688376	美埃科技	2,430	95,960.70	0.05
57	301260	格力博	3,916	95,847.64	0.05
58	688325	赛微微电子	2,448	95,594.40	0.05
59	301148	嘉戎技术	4,444	95,012.72	0.05
60	301135	瑞德智能	3,376	92,569.92	0.05
61	301398	星源卓镁	2,464	92,400.00	0.05
62	301306	西测测试	2,361	91,724.85	0.05
63	301197	工大科雅	3,791	91,363.10	0.05
64	688503	聚和材料股份公司	909	88,627.50	0.04
65	688353	华盛锂	2,369	87,605.62	0.04

		电			
66	301310	鑫宏业	1,277	87,518.16	0.04
67	301379	天山电子	3,040	84,907.20	0.04
68	301176	逸豪新材	4,930	84,697.40	0.04
69	688459	哈铁科技	8,784	84,677.76	0.04
70	688084	晶品特装	968	84,090.16	0.04
71	301280	珠城科技	2,337	83,571.12	0.04
72	688115	思林杰科技	2,153	83,170.39	0.04
73	301285	鸿日达	5,643	81,767.07	0.04
74	688275	万润新能源	903	81,567.99	0.04
75	688307	中润光学	2,455	80,253.95	0.04
76	301161	唯万密封	3,460	79,960.60	0.04
77	688184	帕瓦股份	2,523	78,868.98	0.04
78	301227	森鹰窗业	2,840	78,753.20	0.04
79	300834	星辉环材	3,174	77,445.60	0.04
80	301196	唯科科技	2,272	77,134.40	0.04
81	301315	威士顿	1,296	76,407.38	0.04
82	301335	天元宠物	3,130	74,619.20	0.04
83	301388	欣灵电气	2,748	73,783.80	0.04
84	688143	长盈通光电	1,944	73,288.80	0.04
85	301399	英特科技	1,242	72,907.75	0.04
86	301360	荣旗科技	703	72,479.56	0.04
87	688480	赛恩斯环保	2,302	71,269.92	0.04
88	301307	美利信	2,105	70,758.60	0.04

89	301283	聚胶股份	1,994	70,747.12	0.04
90	688193	仁度生物	1,635	70,435.80	0.03
91	688737	中自科技	1,805	70,376.95	0.03
92	001270	铖昌科技	795	69,403.50	0.03
93	301365	矩阵股份	4,179	68,786.34	0.03
94	301319	唯特偶	1,149	68,767.65	0.03
95	688426	康为世纪生物科技	2,266	68,433.20	0.03
96	301233	盛帮股份	1,576	68,193.52	0.03
97	688448	南京磁谷科技	1,985	67,946.55	0.03
98	601136	首创证券	4,739	67,151.63	0.03
99	688255	凯尔达机器人	1,973	66,805.78	0.03
100	301300	远翔新材	2,107	66,581.20	0.03
101	688211	中科微至	1,462	66,038.54	0.03
102	688739	成大生物	1,976	65,128.96	0.03
103	301290	东星医疗	2,018	64,676.90	0.03
104	301382	蜂助手	1,697	64,586.08	0.03
105	301356	天振股份	2,869	62,831.10	0.03
106	301373	凌玮科技	1,935	62,569.89	0.03
107	001287	中电港	2,281	61,818.14	0.03
108	688137	近岸蛋白	1,191	61,312.68	0.03
109	301292	海科新源	2,873	57,431.27	0.03
110	301262	海看股份	2,075	57,113.25	0.03
111	301428	世纪恒	1,602	56,226.20	0.03

		通			
112	001269	欧晶科技	764	56,176.92	0.03
113	301383	天键股份	1,506	56,070.72	0.03
114	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.03
115	301157	华塑科技	989	55,115.67	0.03
116	301225	恒勃股份	1,506	53,653.21	0.03
117	301488	豪恩汽电	1,309	52,072.02	0.03
118	301203	国泰环保	1,458	51,978.88	0.03
119	301349	信德新材	1,029	51,594.06	0.03
120	301397	溯联股份	1,176	49,602.80	0.02
121	301305	朗坤环境	2,382	49,301.74	0.02
122	688420	天津美腾科技	1,272	49,264.56	0.02
123	301068	大地海洋	1,436	48,263.96	0.02
124	301309	万得凯	1,751	48,222.54	0.02
125	301439	泓淋电力	2,687	47,683.22	0.02
126	301376	致欧科技	1,991	46,948.70	0.02
127	301355	南王科技	2,603	46,059.35	0.02
128	688553	汇宇制药	3,035	45,312.55	0.02
129	300804	广康生化	1,313	44,872.15	0.02
130	301281	科源制药	1,683	44,179.94	0.02
131	301170	锡南科技	1,185	43,811.87	0.02
132	301337	亚华电子	1,274	43,309.76	0.02
133	688622	禾信仪	1,204	42,742.00	0.02

		器			
134	301232	飞沃科技	698	42,202.72	0.02
135	301239	普瑞眼科	423	41,487.84	0.02
136	301261	恒工精密	1,099	40,553.10	0.02
137	301079	邵阳液压	1,815	38,695.80	0.02
138	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.02
139	001311	多利科技	649	37,272.07	0.02
140	301202	朗威股份	1,437	37,103.34	0.02
141	301162	国能日新	468	36,915.84	0.02
142	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
143	301345	涛涛车业	729	34,702.48	0.02
144	001330	博纳影业	3,564	33,073.92	0.02
145	688390	固德威电源	193	32,203.98	0.02
146	001338	永顺泰	1,649	30,407.56	0.02
147	688367	工大高科	1,717	30,356.56	0.02
148	001258	立新能源	3,188	30,254.12	0.01
149	600927	永安期货	1,859	30,227.34	0.01
150	605598	上海港湾	553	29,120.98	0.01
151	601089	福元医药	1,749	28,508.70	0.01
152	301018	申菱环境	782	28,144.18	0.01
153	301175	中科环保	4,342	27,050.66	0.01
154	603071	物产环能	1,627	26,991.93	0.01
155	603255	鼎际得	488	24,770.88	0.01

		股份			
156	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.01
157	001339	智微智能	812	24,092.04	0.01
158	603211	晋拓科技股份	1,286	23,636.68	0.01
159	301286	侨源股份	784	23,128.00	0.01
160	301368	丰立智能	326	22,555.94	0.01
161	001227	兰州银行	7,868	22,502.48	0.01
162	605555	德昌股份	1,284	22,418.64	0.01
163	603191	望变电气	1,149	22,348.05	0.01
164	001282	三联锻造	615	21,789.96	0.01
165	001322	箭牌家居	1,286	21,527.64	0.01
166	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.01
167	001236	弘业期货	1,399	21,446.67	0.01
168	603206	嘉环科技	1,210	20,872.50	0.01
169	301179	泽宇智能	614	20,691.80	0.01
170	601022	宁波远洋	1,983	20,603.37	0.01
171	301268	铭利达	472	19,762.64	0.01
172	001215	千味央厨	295	19,614.55	0.01
173	001323	慕思股份	573	19,459.08	0.01
174	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.01
175	301058	中粮科工	1,386	19,334.70	0.01
176	300982	苏文电能	317	19,197.52	0.01
177	301185	鸥玛软	578	19,085.56	0.01

		件			
178	300972	万辰生物	430	19,066.20	0.01
179	600935	华塑股份	4,811	18,041.25	0.01
180	603122	合富中国	2,198	18,023.60	0.01
181	603235	天新药业	572	17,937.92	0.01
182	301311	昆船智能	607	17,894.36	0.01
183	603209	兴通股份	833	17,667.93	0.01
184	603173	福斯达深冷	588	17,316.60	0.01
185	301117	佳缘科技	262	16,930.44	0.01
186	301301	川宁生物	1,850	16,576.00	0.01
187	301187	欧圣电气	876	16,179.72	0.01
188	603282	亚光科技股份	457	15,771.07	0.01
189	001216	华瓷股份	1,178	15,502.48	0.01
190	001360	南矿集团	903	15,457.61	0.01
191	001318	阳光乳业	1,142	15,451.26	0.01
192	301082	久盛电气	816	14,728.80	0.01
193	001228	永泰运	383	14,718.69	0.01
194	301039	中集车辆	1,112	14,711.76	0.01
195	603230	内蒙新华	1,140	14,706.00	0.01
196	301201	诚达药业	353	14,543.60	0.01
197	603070	万控智造	775	14,484.75	0.01
198	001298	好上好	584	14,454.00	0.01
199	001217	华尔泰	1,239	14,421.96	0.01
200	603190	烟台亚	470	14,382.00	0.01

		通精工 机械			
201	300957	贝泰妮	159	14,131.92	0.01
202	001367	海森药 业	307	13,803.96	0.01
203	603237	五芳斋 实业	455	13,800.15	0.01
204	603057	上海紫 燕食品	549	13,796.37	0.01
205	301069	凯盛新 材	539	13,712.16	0.01
206	301327	华宝新 能	173	13,686.03	0.01
207	300997	欢乐家	928	13,520.96	0.01
208	301235	华康医 疗	418	13,300.76	0.01
209	603162	海通发 展	774	13,196.70	0.01
210	603153	上海建 科集团	740	13,135.00	0.01
211	603097	江苏华 辰	577	13,074.82	0.01
212	605599	菜百股 份	980	12,945.80	0.01
213	301199	迈赫股 份	402	12,799.68	0.01
214	603051	鹿山新 材	272	12,737.76	0.01
215	301015	百洋医 药	457	12,686.32	0.01
216	301096	百诚医 药	207	12,546.27	0.01
217	301052	果麦文 化	252	12,428.64	0.01
218	603176	汇通集 团	1,924	12,313.60	0.01
219	00696	中国民 航信息 网络	1,000	12,262.33	0.01
220	301317	鑫磊股 份	465	12,169.05	0.01
221	301177	迪阿股 份	311	11,951.73	0.01

222	301207	华兰疫苗	359	11,940.34	0.01
223	301293	三博脑科	167	11,927.14	0.01
224	300973	立高食品	174	11,905.08	0.01
225	301073	君亭酒店	324	11,777.40	0.01
226	301048	金鹰重工	843	11,776.71	0.01
227	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.01
228	603170	宝立食品科技	542	11,522.92	0.01
229	301180	万祥科技	654	11,464.62	0.01
230	301123	奕东电子	444	11,339.76	0.01
231	301358	湖南裕能	264	11,322.96	0.01
232	301367	怡和嘉业	76	11,273.84	0.01
233	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.01
234	001319	铭科精技	536	11,234.56	0.01
235	001218	丽臣实业	490	11,078.90	0.01
236	001317	三羊马	300	11,070.00	0.01
237	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.01
238	301391	卡莱特	94	11,013.98	0.01
239	300993	玉马遮阳	959	10,980.55	0.01
240	603130	云中马股份	480	10,900.80	0.01
241	300962	中金辐照	576	10,771.20	0.01
242	301017	漱玉平民	555	10,567.20	0.01
243	603216	梦天家居	772	10,522.36	0.01
244	001260	坤泰股	484	10,401.16	0.01

		份			
245	300986	志特新材	370	10,360.00	0.01
246	301110	青木股份	202	10,186.86	0.01
247	001288	运机集团	537	10,149.30	0.01
248	301013	利和兴	707	10,110.10	0.01
249	001266	宏英智能	346	10,051.30	0.00
250	605566	福莱茵特	435	10,005.00	0.00
251	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
252	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
253	301277	新天地	503	9,813.53	0.00
254	001313	粤海饲料	1,232	9,732.80	0.00
255	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
256	603213	镇洋发展	799	9,532.07	0.00
257	001268	联合精密	409	9,492.89	0.00
258	301046	能辉科技	290	9,483.00	0.00
259	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
260	300968	格林精密	1,036	9,210.04	0.00
261	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.00
262	001222	源飞宠物	607	9,183.91	0.00
263	300614	百川畅银	329	9,011.31	0.00
264	603280	南方路面机械	363	8,922.54	0.00
265	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
266	301116	益客食品	577	8,885.80	0.00
267	301126	达嘉维	662	8,870.80	0.00

		康			
268	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
269	603151	邦基科技股份	535	8,741.90	0.00
270	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
271	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
272	301078	孩子王	756	8,641.08	0.00
273	001296	长江材料	403	8,467.03	0.00
274	001231	农心科技	355	8,445.45	0.00
275	301118	恒光股份	315	8,419.95	0.00
276	001219	青岛食品	460	8,390.40	0.00
277	603182	嘉华生物科技股份	546	8,255.52	0.00
278	301092	争光股份	315	8,246.70	0.00
279	301093	华兰股份	238	8,234.80	0.00
280	301028	东亚机械	733	8,172.95	0.00
281	605567	春雪食品	629	8,070.07	0.00
282	605033	美邦股份	423	7,910.10	0.00
283	300814	中富电路	328	7,901.52	0.00
284	300994	久祺股份	504	7,781.76	0.00
285	300967	晓鸣股份	507	7,736.82	0.00
286	300952	恒辉安防	340	7,670.40	0.00
287	001336	楚环科技	274	7,666.52	0.00
288	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.00
289	301021	英诺激	290	7,580.60	0.00

		光			
290	603048	浙江黎明	464	7,470.40	0.00
291	301026	浩通科技	203	7,251.16	0.00
292	301041	金百泽	215	7,120.80	0.00
293	301011	华立科技	296	6,935.28	0.00
294	300991	创益通	406	6,824.86	0.00
295	603150	万朗磁塑	250	6,590.00	0.00
296	300971	博亚精工	245	6,431.25	0.00
297	300966	共同药业	286	6,392.10	0.00
298	605138	盛泰集团	723	6,304.56	0.00
299	301038	深水规院	346	6,259.14	0.00
300	301012	扬电科技	238	6,152.30	0.00
301	301098	金埔园林	460	5,543.00	0.00
302	301062	上海艾录	523	5,538.57	0.00
303	301016	雷尔伟	275	5,516.50	0.00
304	300958	建工修复	300	5,322.00	0.00
305	300774	倍杰特	444	5,168.16	0.00
306	301055	张小泉	355	5,051.65	0.00
307	300981	中红医疗	331	5,014.65	0.00
308	301025	读客文化	403	4,924.66	0.00
309	301033	迈普医学	108	4,747.68	0.00
310	301007	德迈仕	303	4,675.29	0.00
311	301032	新柴股份	513	4,591.35	0.00
312	301072	中捷精工	181	4,534.05	0.00
313	301010	晶雪节能	218	4,423.22	0.00

314	301049	超越科技	196	4,331.60	0.00
315	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
316	300992	泰福泵业	200	4,024.00	0.00
317	300955	嘉亨家化	186	3,961.80	0.00
318	301053	远信工业	155	3,932.35	0.00
319	300995	奇德新材	191	3,896.40	0.00
320	301036	双乐股份	205	3,839.65	0.00
321	301037	保立佳	212	3,777.84	0.00
322	301057	汇隆新材	218	3,758.32	0.00
323	301027	华蓝集团	286	3,514.94	0.00
324	300854	中兰环保	203	3,227.70	0.00
325	03690	美团-W	10	1,127.58	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	300820	英杰电气	21,101,845.25	9.82
2	00700	腾讯控股	20,179,123.59	9.39
3	002230	科大讯飞	15,848,447.50	7.38
4	000651	格力电器	15,745,812.08	7.33
5	603859	能科科技	15,453,582.00	7.19
6	688169	石头科技	11,769,275.05	5.48
7	300394	天孚通信	10,130,460.00	4.72
8	300634	彩讯股份	9,463,532.00	4.41
9	688037	芯源微电子	9,219,129.82	4.29
10	03690	美团-W	8,813,615.91	4.10
11	300567	精测电子	8,386,407.00	3.90

12	600570	恒生电子	8,206,688.42	3.82
13	300666	江丰电子	7,875,071.13	3.67
14	301165	锐捷网络	7,792,176.00	3.63
15	688111	金山办公	7,644,253.02	3.56
16	688123	聚辰半导体	7,337,518.83	3.42
17	002602	世纪华通	7,249,675.00	3.38
18	300442	润泽科技	7,155,263.40	3.33
19	300059	东方财富	7,028,132.43	3.27
20	688063	派能科技	6,722,216.51	3.13
21	002463	沪电股份	6,441,693.20	3.00
22	688630	芯碁微装	6,267,595.40	2.92
23	300598	诚迈科技	6,220,187.00	2.90
24	300660	江苏雷利	6,152,313.20	2.86
25	000938	紫光股份	6,099,804.68	2.84
26	300033	同花顺	6,043,076.00	2.81
27	603596	伯特利	6,043,046.00	2.81
28	688383	新益昌科技	5,966,742.11	2.78
29	300182	捷成股份	5,894,412.00	2.74
30	002049	紫光国微	5,685,552.00	2.65
31	002291	遥望科技	5,618,666.00	2.62
32	300672	国科微	5,140,588.00	2.39
33	002803	吉宏股份	5,119,624.00	2.38
34	600372	中航电子	5,002,998.00	2.33
35	000063	中兴通讯	4,969,448.00	2.31
36	002558	巨人网络	4,948,085.00	2.30
37	300031	宝通科技	4,928,688.00	2.29
38	300413	芒果超媒	4,833,116.00	2.25
39	300383	光环新网	4,719,814.06	2.20
40	300348	长亮科技	4,633,837.00	2.16
41	002555	三七互娱	4,607,587.00	2.15
42	000661	长春高新	4,531,130.00	2.11
43	688369	致远互联	4,525,211.73	2.11
44	688232	国泰新点软件	4,486,829.06	2.09
45	000333	美的集团	4,398,511.00	2.05
46	600584	长电科技	4,301,513.00	2.00

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	00700	腾讯控股	24,487,901.68	11.40
2	300820	英杰电气	15,085,660.25	7.02
3	300394	天孚通信	13,781,699.00	6.42
4	688037	芯源微电子	13,477,325.45	6.27
5	300059	东方财富	12,717,539.31	5.92
6	300750	宁德时代	12,616,320.00	5.87
7	000651	格力电器	12,137,370.00	5.65
8	603859	能科科技	12,086,702.00	5.63
9	002230	科大讯飞	11,385,752.30	5.30
10	002352	顺丰控股	10,796,504.00	5.03
11	300567	精测电子	10,422,341.00	4.85
12	301165	锐捷网络	9,770,534.72	4.55
13	688711	江苏宏微科技	8,962,965.43	4.17
14	688188	上海柏楚电子科技	8,442,444.00	3.93
15	688111	金山办公	8,294,371.44	3.86
16	03690	美团-W	8,289,818.73	3.86
17	688123	聚辰半导体	8,267,289.22	3.85
18	300274	阳光电源	8,245,294.00	3.84
19	600570	恒生电子	7,895,533.00	3.68
20	00696	中国民航信息网络	7,886,611.94	3.67
21	300660	江苏雷利	7,138,288.60	3.32
22	603197	保隆科技	6,957,414.00	3.24
23	300666	江丰电子	6,834,416.74	3.18
24	300496	中科创达	6,701,552.46	3.12
25	002415	海康威视	6,669,264.00	3.10
26	601865	福莱特	6,621,310.50	3.08
27	603986	兆易创新	6,491,242.00	3.02
28	300598	诚迈科技	6,460,431.00	3.01
29	688063	派能科技	6,301,272.20	2.93
30	688169	石头科技	6,236,606.28	2.90
31	300413	芒果超媒	6,197,568.00	2.89
32	300672	国科微	6,160,750.00	2.87
33	688630	芯碁微装	5,951,145.80	2.77
34	002291	遥望科技	5,285,640.00	2.46
35	600372	中航电子	5,079,766.50	2.36
36	688160	步科自动化	5,075,627.62	2.36
37	600584	长电科技	5,061,172.00	2.36
38	002013	中航机电	5,002,998.00	2.33

39	300308	中际旭创	4,664,998.00	2.17
40	688369	致远互联	4,652,350.02	2.17
41	300348	长亮科技	4,615,716.00	2.15
42	000333	美的集团	4,493,738.00	2.09
43	603108	润达医疗	4,450,522.00	2.07
44	002555	三七互娱	4,413,450.00	2.05

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	568,139,392.39
卖出股票收入（成交）总额	589,186,702.57

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股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	118,350.66
2	应收清算款	-
3	应收股利	42.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,783.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	126,176.54

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
汇添富创新	3,977	23,370.37	1,724,991.00	1.86	91,218,965.84	98.14

活力混合 A						
汇添富创新活力混合 C	37	433,838.92	16,021,769.87	99.81	30,270.13	0.19
汇添富创新活力混合 D	24	10,170.21	0.00	0.00	244,085.02	100.00
合计	4,038	27,053.02	17,746,760.87	16.25	91,493,320.99	83.75

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	汇添富创新活力混合 A	422,294.56	0.45
	汇添富创新活力混合 C	0.00	0.00
	汇添富创新活力混合 D	678.33	0.28
	合计	422,972.89	0.39

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	汇添富创新活力混合 A	0
	汇添富创新活力混合 C	0
	汇添富创新活力混合 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富创新活力混合 A	10~50
	汇添富创新活力混合 C	0
	汇添富创新活力混合 D	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富创新活力混合 A	汇添富创新活力混合 C	汇添富创新活力混合 D
基金合同生效日（2022 年 07 月 13 日）基金份额总额	159,010,346.30	4,584.27	13,225,013.75
本报告期期初基金份额总额	116,085,041.50	12,263.13	10,238,321.65
本报告期基金总申购份额	6,566,942.21	16,097,696.70	131,226.59
减：本报告期基金总赎回份额	29,708,026.87	57,919.83	10,125,463.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	92,943,956.84	16,052,040.00	244,085.02

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 (%)	
方正证券	2	162,715,890.74	14.22	118,385.07	14.20	
太平洋证	1	157,400,051.28	13.75	116,279.67	13.95	

券						
东吴证券	3	156,966,236.02	13.72	113,665.74	13.63	
西部证券	2	115,515,475.91	10.09	84,244.65	10.10	
国金证券	2	109,147,259.07	9.54	80,434.19	9.65	
东方证券	2	101,328,564.57	8.85	73,417.85	8.81	
中信建投证券	4	100,887,128.96	8.82	72,963.24	8.75	
中泰证券	2	51,595,665.47	4.51	37,215.70	4.46	
申万宏源证券	3	41,023,241.99	3.58	29,756.24	3.57	
海通证券	4	39,294,412.39	3.43	28,343.06	3.40	
浙商证券	1	30,123,504.96	2.63	21,728.30	2.61	
上海证券	2	26,759,777.81	2.34	19,423.63	2.33	
野村东方国际	2	26,101,506.59	2.28	18,826.71	2.26	
华兴证券	2	25,592,474.08	2.24	19,115.88	2.29	
安信证券	2	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
川财证券	2	-	-	-	-	
东北证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
开源证券	2	-	-	-	-	
天风证券	2	-	-	-	-	

西南证券	1	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-

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 (%)
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	2,298,343.00	33.77	-	-	-	-	-	-
西部证券	100,002.00	1.47	-	-	-	-	-	-
国金证券	2,702,130.00	39.71	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	599,958.00	8.82	-	-	-	-	-	-
中泰证券	1,104,818.00	16.23	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村 东方 国际	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商

评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 3 家证券公司的 5 个交易单元:长江证券(上交所单元,深交所单元)、开源证券(上交所单元,深交所单元)、广发证券(深交所单元);不再租用 1 家证券公司的 1 个交易单元:太平洋证券(上交所单元)。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
2	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富盈安保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富创新活力混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富创新活力混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富创新活力混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 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