

# 汇添富全球消费行业混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

|   |    |
|---|----|
| 1.2 目录                                  |    |
| § 1 重要提示及目录                             | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| § 2 基金简介                                | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人                      | 6  |
| 2.5 信息披露方式                              | 6  |
| 2.6 其他相关资料                              | 7  |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现                       | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| § 4 管理人报告                               | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11 |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介               | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 15 |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 16 |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 16 |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 18 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 18 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 19 |
| § 5 托管人报告                               | 19 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 19 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 19 |
| 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见       | 19 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计）                     | 19 |
| 6.1 资产负债表                               | 19 |
| 6.2 利润表                                 | 21 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 22 |
| 6.4 报表附注                                | 23 |
| § 7 投资组合报告                              | 59 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 59 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布              | 59 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合                      | 60 |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细         | 60 |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动                     | 84 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合                  | 87 |
| 7.7 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      | 88 |

|                                       |    |
|---------------------------------------|----|
| 7.8 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 | 88 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 | 88 |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细   | 88 |
| 7.11 投资组合报告附注                         | 88 |
| § 8 基金份额持有人信息                         | 89 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                 | 89 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况              | 90 |
| 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      | 90 |
| § 9 开放式基金份额变动                         | 91 |
| § 10 重大事件揭示                           | 91 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                      | 91 |
| 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      | 91 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼           | 92 |
| 10.4 基金投资策略的改变                        | 92 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况                 | 92 |
| 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         | 92 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况                | 92 |
| 10.8 其他重大事件                           | 95 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息                   | 96 |
| 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   | 96 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息                   | 96 |
| § 12 备查文件目录                           | 96 |
| 12.1 备查文件目录                           | 96 |
| 12.2 存放地点                             | 96 |
| 12.3 查阅方式                             | 96 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                    |                     |                     |                    |
|--------------------|---------------------|---------------------|--------------------|
| 基金名称               | 汇添富全球消费行业混合型证券投资基金  |                     |                    |
| 基金简称               | 添富全球消费混合（QDII）      |                     |                    |
| 基金主代码              | 006308              |                     |                    |
| 基金运作方式             | 契约型开放式              |                     |                    |
| 基金合同生效日            | 2018 年 09 月 21 日    |                     |                    |
| 基金管理人              | 汇添富基金管理股份有限公司       |                     |                    |
| 基金托管人              | 中国工商银行股份有限公司        |                     |                    |
| 报告期末基金份额总额（份）      | 344,792,133.59      |                     |                    |
| 基金合同存续期            | 不定期                 |                     |                    |
| 下属分级基金的基金简称        | 添富全球消费混合（QDII）人民币 A | 添富全球消费混合（QDII）人民币 C | 添富全球消费混合（QDII）美元现汇 |
| 下属分级基金的交易代码        | 006308              | 006309              | 006310             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额（份） | 238,460,710.28      | 89,312,273.36       | 17,019,149.95      |

注：本基金自 2023 年 4 月 12 日起变更业绩比较基准为“明晟全球可选消费指数收益率×30%+明晟全球主要消费指数收益率×20%+恒生新消费指数收益率×20%+中证内地消费主题指数收益率×20%+中债-综合财富(总值)指数收益率×10%”。

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选全球消费行业相关优质公司的股票进行投资布局，为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。   |
| 投资策略 | 本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选全球消费行业相关优质公司的股票进行投资布局，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、个股精选策略、基金投资策略、固定收益类资产投资策略、 |

|        |  |
|--------|--|
|        | 中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、汇率避险策略。  |
| 业绩比较基准 | 明晟全球可选消费指数收益率×30%+明晟全球主要消费指数收益率×20%+恒生新消费指数收益率×20%+中证内地消费主题指数收益率×20%+中债-综合财富(总值)指数收益率×10%  |
| 风险收益特征 | 本基金为主要投资于全球范围内的消费行业相关优质上市公司股票的混合型基金，风险与预期收益水平低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。<br>本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |

### 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               | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李鹏                          | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-28932888                | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | service@99fund.com          | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-888-9918                | 95588               |
| 传真          |      | 021-28932998                | 010-66105798        |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室 | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 办公地址        |      | 上海市黄浦区外马路728号               | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 邮政编码        |      | 200010                      | 100140              |
| 法定代表人       |      | 李文                          | 陈四清                 |

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外资产托管人   |
|------|----|---|
| 名称   | 中文 | 北美信托银行  |
|      | 英文 | The Northern Trust Company                      |
| 注册地址 |    | Chicago, County of Cook, State of Illinois, USA |
| 办公地址 |    | 50 South La Salle Street, Chicago, Illinois USA |
| 邮政编码 |    | 60603   |

注：本基金无境外投资顾问。

### 2.5 信息披露方式

|                     |                      |
|---------------------|----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券日报》               |
| 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 |
|--|---------|

## 2.6 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) |                     |                    |
|---------------|--|---------------------|--------------------|
|               | 添富全球消费混合（QDII）人民币 A                      | 添富全球消费混合（QDII）人民币 C | 添富全球消费混合（QDII）美元现汇 |
| 本期已实现收益       | 30,597,475.42                            | 10,146,699.88       | 14,533,497.22      |
| 本期利润          | 53,709,538.64                            | 18,791,606.98       | 25,940,096.85      |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2172                                   | 0.2019              | 1.4942             |
| 本期加权平均净值利润率   | 11.36%                                   | 11.06%              | 11.44%             |
| 本期基金份额净值增长率   | 12.18%                                   | 11.62%              | 8.13%              |
| 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      | 47,278,209.66                            | 10,635,156.87       | 22,933,520.72      |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1983                                   | 0.1191              | 1.3475             |
| 期末基金资产净值      | 484,260,135.45                           | 172,678,925.76      | 236,021,564.34     |
| 期末基金份额净值      | 2.0308                                   | 1.9334              | 1.9192             |
| 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 | 103.08% | 93.34% | 91.92% |
|-------------|---------|--------|--------|

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

| 添富全球消费混合（QDII）人民币 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               | 8.03%    | 0.80%       | 5.91%      | 0.87%         | 2.12%   | -0.07% |
| 过去三个月               | 5.44%    | 0.89%       | -1.41%     | 0.72%         | 6.85%   | 0.17%  |
| 过去六个月               | 12.18%   | 1.15%       | 1.52%      | 0.75%         | 10.66%  | 0.40%  |
| 过去一年                | 7.81%    | 1.25%       | -3.75%     | 0.89%         | 11.56%  | 0.36%  |
| 过去三年                | -1.85%   | 1.58%       | 13.45%     | 1.01%         | -15.30% | 0.57%  |
| 自基金合同生效日起至今         | 103.08%  | 1.46%       | 50.61%     | 1.04%         | 52.47%  | 0.42%  |
| 添富全球消费混合（QDII）人民币 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                 | 7.94%    | 0.80%       | 5.91%      | 0.87%         | 2.03%   | -0.07% |



| 个月                 |          |             |            |               |         |       |
|--------------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月              | 5.18%    | 0.89%       | -1.41%     | 0.72%         | 6.59%   | 0.17% |
| 过去六个月              | 11.62%   | 1.15%       | 1.52%      | 0.75%         | 10.10%  | 0.40% |
| 过去一年               | 6.74%    | 1.25%       | -3.75%     | 0.89%         | 10.49%  | 0.36% |
| 过去三年               | -4.75%   | 1.58%       | 13.45%     | 1.01%         | -18.20% | 0.57% |
| 自基金合同生效日起至今        | 93.34%   | 1.46%       | 50.61%     | 1.04%         | 42.73%  | 0.42% |
| 添富全球消费混合（QDII）美元现汇 |          |             |            |               |         |       |
| 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              | 5.88%    | 0.87%       | 5.91%      | 0.87%         | -0.03%  | 0.00% |
| 过去三个月              | 0.28%    | 0.87%       | -1.41%     | 0.72%         | 1.69%   | 0.15% |
| 过去六个月              | 8.13%    | 1.18%       | 1.52%      | 0.75%         | 6.61%   | 0.43% |
| 过去一年               | 0.15%    | 1.28%       | -3.75%     | 0.89%         | 3.90%   | 0.39% |
| 过去三年               | -3.83%   | 1.60%       | 13.45%     | 1.01%         | -17.28% | 0.59% |
| 自基金合同生效日起至今        | 91.92%   | 1.46%       | 50.61%     | 1.04%         | 41.31%  | 0.42% |

### 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

添富全球消费混合（QDII）人民币A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富全球消费混合（QDII）人民币C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富全球消费混合（QDII）美元现汇累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018年09月21日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于2005年2月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2023 上半年，汇添富基金新成立 27 只公开募集证券投资基金，包括 10 只股票型基金、9 只混合型基金、8 只债券型基金。截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 297 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限（年） | 说明   |
|-----|----------|------------------|------|-----------|--|
|     |          | 任职日期             | 离任日期 |           |  |
| 郑慧莲 | 本基金的基金经理 | 2018 年 09 月 21 日 |      | 13        | 国籍：中国。学历：复旦大学会计学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格, CPA。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任行业研究员、高级研究员。2017 年 5 月 18 日至 2017 年 12 月 11 日任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2017 年 5 月 18 日至 2017 年 12 月 11 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助理。2017 年 5 月 18 日至 2017 年 12 月 25 日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>的基金经理助理。2017 年 12 月 12 日至 2020 年 6 月 10 日任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2017 年 12 月 12 日至 2021 年 3 月 29 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。2017 年 12 月 12 日至今任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月 12 日至 2020 年 2 月 26 日任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月 12 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月 26 日至 2020 年 2 月 26 日任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月 26 日至 2021 年 3 月 29 日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年</p> |
|--|--|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | <p>3月1日至2020年6月10日任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月2日至2020年6月10日任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年7月6日至2020年6月10日任汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年9月21日至今任汇添富全球消费行业混合型证券投资基金的基金经理。2018年12月21日至2021年5月17日任汇添富消费升级混合型证券投资基金的基金经理。2019年1月30日至2020年6月10日任汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年7月31日至今任汇添富内需增长股票型证券投资基金的基金经理。2020年10月19日至今任汇添富品牌驱动六个月持有期混合型证券投资基</p> |
|--|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 金的基金经理。<br>2021 年 1 月 25 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。<br>2021 年 8 月 17 日至今任汇添富价值领先混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 21 日至今任汇添富品牌价值一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 1 日至今任汇添富品牌力一年持有期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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

##### 4.4.2 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期，A 股方面，上证指数上涨 3.65%，深证成指上涨 0.1%，沪深 300 下跌 0.75%，中小综指上涨 2.25%，创业板指下跌 5.61%。港股方面，恒生指数下跌 4.37%。美股方面，标普 500 上涨 15.91%，道琼斯工业指数上涨 3.8%，纳斯达克上涨 31.73%。

A 股方面，涨幅较好的板块包括通信、传媒、计算机。这 3 个板块主要都受益于 chatgpt 的突破，给板块带来的中长期的投资逻辑的提升。跌幅靠前的板块包括房地产、食品饮料、



综合，主要因为经济复苏速度略低于预期，导致消费相对低迷。

美股方面，本报告期，加息周期已进入尾声（尽管可能年内还有 1-2 次加息，但加息已经不再是市场的主要矛盾了），美国经济数据仍强劲，且以英伟达、微软、特斯拉、苹果等为代表的科技公司正站在各自的一轮新的产业周期的起点上（以英伟达和微软为代表的 AI 产业、以特斯拉为代表的自动驾驶产业、以苹果为代表的 MR 产业），让大家对美国未来的经济增长前景信心满满。因此，美股三大指数在本报告期内，均录得较好涨幅，其中，代表科技股的纳指的涨幅更是一枝独秀。而美股消费股的总体涨幅不及科技股，但是，科技消费股（即，有科技股属性的消费股，比如亚马逊、特斯拉）和成长性较好的消费股（比如 onon、邮轮公司等）也录得较好涨幅。

我们认为，虽然美国的经济衰退尚未到来（下半年可能会到来），但总体来说，伴随着新的科技增长动能的崛起，中期来看，美国经济不久就将进入下一个长维度的向上周期。我们认为，这些科技创新和突破将释放出极大的产业增长动能。而消费，作为后周期板块，必将受益于经济的持续而良性的增长，因此，我们对于美国消费股也充满信心，我们尤其偏好处于成长期中早期的消费品公司，他们或可以比成熟公司获得更高的中长期的复合收益。

本报告期，我们进一步减持了港股，加仓了美股和欧洲股票。一方面，我们希望我们的基金具有自己的特质，目前市场上，以美股消费为主要布局的基金产品的供给相对稀缺，另一方面，我们也认为，美股中有很多品牌力强、运营能力优秀的公司，正展现出积极的增长动能和活力。他们在主要集中在服装、餐饮、零售（电商、超市、垂直细分领域的专卖店等）、酒店、娱乐等领域。在欧洲股票中，我们持续持有头部的奢侈品公司，我们认为，其具备最顶级的品牌力和最强大的穿越周期的能力。

港股方面，受制于中国经济复苏势头略显平缓，增长动能不足，因此，消费股和消费科技股的表现一般。我们继续低配港股，港股的主要持仓集中在竞争优势突出、向下风险可控的龙头公司。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期添富全球消费混合（QDII）人民币 A 类份额净值增长率为 12.18%，同期业绩比较基准收益率为 1.52%。本报告期添富全球消费混合（QDII）人民币 C 类份额净值增长率为 11.62%，同期业绩比较基准收益率为 1.52%。本报告期添富全球消费混合（QDII）美元现汇类份额净值增长率为 8.13%，同期业绩比较基准收益率为 1.52%。

#### 4.6 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，我们认为，中国的宏观经济具体取决于政策、内需、外需等情况。我们认

为，政策将会持续释放暖风，以增强信心、控制风险、鼓励和扶持经济增长的动能。内需方面，经济有阶段性压力，但随着企业家和消费者的信心恢复，中国经济的可挖掘潜力仍很大，因为中国经济的纵深是很深的，且中国人民是勤奋向上的。外需方面，欧美有衰退压力，但总体的压力或仍在可控范围。

美国的宏观经济，我们总体保持乐观。主要是因为美国的大型科技股在 AI、MR 等各个领域都做出了创新性的破局，将给美国经济带来很大的中长期的增长驱动力。所以，通胀等给美国经济带来的困扰或是暂时的，美国经济仍将有较好的活力。

就消费板块而言，我们对美国和中国消费都保持乐观。对于美国消费而言，我们判断，高端消费有较强韧性，中端消费虽阶段性承压但预期企稳，大众消费见底企稳（去年由于高通胀，对大众消费的挤压是最为明显的），尤其是可选消费。对于中国消费而言，我们判断，伴随着一系列的政策暖风，消费信心将回升，老百姓对未来的就业预期也或有所提升，则中国的消费潜力不容小觑。我们持续看好，服务业回升、自主品牌崛起和消费升级持续等三条投资主线。下半年也将围绕这些投资主线做布局。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富全球消费行业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<br>2023 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 57,788,443.12           | 47,742,643.13            |
| 结算备付金      |         | 669.85                  | 301,774.14               |
| 存出保证金      |         | 8,464.46                | 67,980.93                |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 816,473,504.56          | 785,199,329.25           |
| 其中：股票投资    |         | 777,917,082.58          | 731,034,005.98           |
| 基金投资       |         | 24,560,281.98           | 9,701,611.19             |
| 债券投资       |         | 13,996,140.00           | 44,463,712.08            |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 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         |            | 51,470,232.98              | 25,409,139.85               |
| 应收股利          |            | 879,452.87                 | 272,747.29                  |
| 应收申购款         |            | 737,536.45                 | 501,704.04                  |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 927,358,304.29             | 859,495,318.63              |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2022年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | 25,879,935.40              | 17,475,210.08               |
| 应付赎回款         |            | 6,664,794.59               | 1,765,536.03                |
| 应付管理人报酬       |            | 1,291,930.60               | 1,289,760.77                |
| 应付托管费         |            | 251,208.73                 | 250,786.81                  |
| 应付销售服务费       |            | 138,963.94                 | 143,486.92                  |
| 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    | 170,845.48                 | 250,983.58                  |
| 负债合计          |            | 34,397,678.74              | 21,175,764.19               |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.8    | 444,105,414.77             | 467,391,311.38              |
| 未分配利润         | 6.4.7.9    | 448,855,210.78             | 370,928,243.06              |
| 净资产合计         |            | 892,960,625.55             | 838,319,554.44              |
| 负债和净资产总计      |            | 927,358,304.29             | 859,495,318.63              |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 344,792,133.59 份。本基金下属添富全球消费混合（QDII）人民币 A 基金份额净值 2.0308 元，基金份额总额 238,460,710.28 份；本基金下属添富全球消费混合（QDII）人民币 C 基金份额净值 1.9334 元，基金份额总额

89,312,273.36 份；本基金下属添富全球消费混合(QDII)美元现汇基金份额净值 1.9192 元，基金份额总额 17,019,149.95 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富全球消费行业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<br>2023 年 01 月 01 日<br>至 2023 年 06 月 30<br>日 | 上年度可比期间<br>2022 年 01 月 01 日<br>至 2022 年 06 月 30<br>日 |
|------------------------|------------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | <b>108,909,059.89</b>                           | <b>-163,254,786.69</b>                               |
| 1. 利息收入                |            | 555,904.48                                      | 62,425.20  |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.10   | 555,904.48                                      | 62,425.20  |
| 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）      |            | 57,388,411.99                                   | -399,618,634.79                                      |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.11   | 55,479,574.27                                   | -406,232,471.06                                      |
| 基金投资收益                 | 6.4.7.12   | -1,268,241.65                                   | -  |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | 270,486.92                                      | 166,910.82   |
| 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   | 2,906,592.45                                    | 6,446,925.45   |
| 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   | 43,163,569.95                                   | 229,364,056.11                                       |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | 7,350,503.04                                    | 6,800,374.43   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.19   | 450,670.43                                      | 136,992.36   |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | <b>10,467,817.42</b>                            | <b>11,626,472.81</b>                                 |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 7,782,640.76                                    | 8,773,685.72   |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,513,291.26                                    | 1,705,994.44   |
| 3. 销售服务费               |            | 845,124.70                                      | 909,669.44   |
| 4. 投资顾问费               |            | -   | -  |
| 5. 利息支出                |            | -   | 5,890.56   |
| 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               |            | -   | 2.23   |

|                     |             |               |                 |
|---------------------|-------------|---------------|-----------------|
| 8. 其他费用             | 6. 4. 7. 21 | 326,760.70    | 231,230.42      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |             | 98,441,242.47 | -174,881,259.50 |
| 减：所得税费用             |             | -             | -               |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |             | 98,441,242.47 | -174,881,259.50 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |             | -             | -               |
| 六、综合收益总额            |             | 98,441,242.47 | -174,881,259.50 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富全球消费行业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<br>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）                          | 467,391,311.38                           | 370,928,243.06 | 838,319,554.44 |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -              | -              |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 467,391,311.38                           | 370,928,243.06 | 838,319,554.44 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -23,285,896.61                           | 77,926,967.72  | 54,641,071.11  |
| （一）、综合收益总额                               | -  | 98,441,242.47  | 98,441,242.47  |
| （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）      | -23,285,896.61                           | -20,514,274.75 | -43,800,171.36 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 27,220,390.72                            | 24,304,577.57  | 51,524,968.29  |
| 2. 基金赎回款                                 | -50,506,287.33                           | -44,818,852.32 | -95,325,139.65 |
| （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)                          | 444,105,414.77                     | 448,855,210.78  | 892,960,625.55   |
| 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)                          | 632,238,664.93                     | 714,172,276.34  | 1,346,410,941.27 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                  | -               | -                |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 632,238,664.93                     | 714,172,276.34  | 1,346,410,941.27 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -128,021,568.24                    | -276,423,150.58 | -404,444,718.82  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | -174,881,259.50 | -174,881,259.50  |
| （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）      | -128,021,568.24                    | -101,541,891.08 | -229,563,459.32  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 54,824,679.12                      | 43,165,905.90   | 97,990,585.02    |
| 2. 基金赎回款                                 | -182,846,247.36                    | -144,707,796.98 | -327,554,044.34  |
| （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)                          | 504,217,096.69                     | 437,749,125.76  | 941,966,222.45   |

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>张暉</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

汇添富全球消费行业混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]636号文《关于准予汇添富全球消费行业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2018年9月21日生效。首次设立基金募集规模为347,747,420.28份人民币基金份额和3,255,290.62份美元基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2018）验字第60466941\_B34号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外托管人为北美信托银行。

根据《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富全球消费行业混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》，自2023年4月12日起，本基金约定的业绩比较基准由原“中证主要消费行业指数收益率×40%+恒生消费品制造及服务业指数收益率×24%+明晟全球可选消费指数收益率×8%+明晟全球主要消费指数收益率×8%+中债综合财富指数收益率×20%”变更为“明晟全球可选消费指数收益率×30%+明晟全球主要消费指数收益率×20%+恒生新消费指数收益率×20%+中证内地消费主题指数收益率×20%+中债-综合财富(总值)指数收益率×10%”。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（以下无特别说明，均包括exchange traded fund, ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股（包括港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构化投资产品；针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票（包含中小板、创业板、其他依法上市的股票），存托凭证、衍生工具（股指期货、权证、国债期货、股票期权等），债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等资产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。本基金为对冲外币的汇率风险,可以投资于外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易、境内融资交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%。本基金以全球消费行业相关公司股票及存托凭证为主要投资对象,投资于全球消费行业相关公司股票及存托凭证的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于全球市场,包括境内市场和境外市场,其中主要境外市场有:美国、欧洲、日本、香港和加拿大等国家或地区。投资各个市场股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例上限均为 95%。香港市场可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度和港股通机制进行投资,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0%-95%。本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,在科学严格管理风险的前提下,精选全球消费行业相关优质公司的股票进行投资布局,为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。自 2018 年 9 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 4 月 11 日,本基金的业绩比较基准为:中证主要消费行业指数收益率 $\times$ 40%+恒生消费品制造及服务业指数收益率 $\times$ 24%+明晟全球可选消费指数收益率 $\times$ 8%+明晟全球主要消费指数收益率 $\times$ 8%+中债综合财富指数收益率 $\times$ 20%。根据《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富全球消费行业混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》,自 2023 年 4 月 12 日起,本基金的业绩比较基准为:明晟全球可选消费指数收益率 $\times$ 30%+明晟全球主要消费指数收益率 $\times$ 20%+恒生新消费指数收益率 $\times$ 20%+中证内地消费主题指数收益率 $\times$ 20%+中债-综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 10%。

#### 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

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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 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<br>2023 年 06 月 30 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 57,788,443.12           |
| 等于：本金          | 57,788,041.25           |
| 加：应计利息         | 401.87                  |
| 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             | 57,788,443.12           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2023 年 06 月 30 日 |      |                |               |
|----|-------------------------|------|----------------|---------------|
|    | 成本                      | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票 | 742,743,620.41          | -    | 777,917,082.58 | 35,173,462.17 |

|               |                |               |                |               |
|---------------|----------------|---------------|----------------|---------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -              | -             | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场          | -             | -              | -             |
|               | 银行间市场          | 13,983,844.00 | 8,740.00       | 13,996,140.00 |
|               | 境外 OTC 市场      | -             | -              | -             |
|               | 合计             | 13,983,844.00 | 8,740.00       | 13,996,140.00 |
| 资产支持证券        | -              | -             | -              | -             |
| 基金            | 24,391,610.81  | -             | 24,560,281.98  | 168,671.17    |
| 其他            | -              | -             | -              | -             |
| 合计            | 781,119,075.22 | 8,740.00      | 816,473,504.56 | 35,345,689.34 |

### 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<br>2023 年 06 月 30 日 |
|-------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       |
| 应付赎回费       | 1,029.18                |
| 应付证券出借违约金   | -                       |
| 应付交易费用      | 5,596.75                |
| 其中：交易所市场    | 5,411.75                |
| 银行间市场       | 185.00                  |

|              |            |
|--------------|------------|
| 应付利息         | -          |
| 应付审计费        | 104,712.18 |
| 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           | 170,845.48 |

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 添富全球消费混合（QDII）人民币 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                | 251,151,109.39                        | 251,150,658.45 |
| 本期申购                | 14,990,657.71                         | 14,990,561.87  |
| 本期赎回（以“-”号填列）       | -27,681,056.82                        | -27,681,008.51 |
| 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                 | 238,460,710.28                        | 238,460,211.81 |
| 添富全球消费混合（QDII）人民币 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                | 96,859,306.19                         | 96,853,440.54  |
| 本期申购                | 8,808,964.99                          | 8,808,479.10   |
| 本期赎回（以“-”号填列）       | -16,355,997.82                        | -16,355,048.53 |
| 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                | 89,312,273.36                         | 89,306,871.11  |
| 添富全球消费混合（QDII）美元现汇 |                                       |                |
| 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               | 17,465,166.21                         | 119,387,212.39 |
| 本期申购               | 500,510.04                            | 3,421,349.75   |
| 本期赎回（以“-”号填列）      | -946,526.30                           | -6,470,230.29  |
| 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                | 17,019,149.95                         | 116,338,331.85 |

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

| 添富全球消费混合（QDII）人民币 A |               |                |                |
|---------------------|---------------|----------------|----------------|
| 项目                  | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 本期期初                | 18,783,624.69 | 184,721,838.64 | 203,505,463.33 |
| 本期利润                | 30,597,475.42 | 23,112,063.22  | 53,709,538.64  |
| 本期基金份额交易产生的变动数      | -2,102,890.45 | -9,312,187.88  | -11,415,078.33 |
| 其中：基金申购款            | 1,874,472.42  | 11,920,812.13  | 13,795,284.55  |
| 基金赎回款               | -3,977,362.87 | -21,233,000.01 | -25,210,362.88 |
| 本期已分配利润             | -             | -              | -              |
| 本期末                 | 47,278,209.66 | 198,521,713.98 | 245,799,923.64 |
| 添富全球消费混合（QDII）人民币 C |               |                |                |
| 项目                  | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 本期期初                | 996,405.94    | 69,916,594.30  | 70,913,000.24  |
| 本期利润                | 10,146,699.88 | 8,644,907.10   | 18,791,606.98  |
| 本期基金份额交易产生          | -507,948.95   | -5,824,603.62  | -6,332,552.57  |

|                        |               |                |                |
|------------------------|---------------|----------------|----------------|
| 的变动数                   |               |                |                |
| 其中：基金<br>申购款           | 610,572.86    | 6,746,210.65   | 7,356,783.51   |
| 基金赎回款                  | -1,118,521.81 | -12,570,814.27 | -13,689,336.08 |
| 本期已分配<br>利润            | -             | -              | -              |
| 本期末                    | 10,635,156.87 | 72,736,897.78  | 83,372,054.65  |
| 添富全球消费混合（QDII）美元现汇     |               |                |                |
| 项目                     | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 本期期初                   | 8,809,609.58  | 87,700,169.91  | 96,509,779.49  |
| 本期利润                   | 14,533,497.22 | 11,406,599.63  | 25,940,096.85  |
| 本期基金份额<br>交易产生的<br>变动数 | -409,586.08   | -2,357,057.77  | -2,766,643.85  |
| 其中：基金<br>申购款           | 484,346.68    | 2,668,162.83   | 3,152,509.51   |
| 基金赎回款                  | -893,932.76   | -5,025,220.60  | -5,919,153.36  |
| 本期已分配<br>利润            | -             | -              | -              |
| 本期末                    | 22,933,520.72 | 96,749,711.77  | 119,683,232.49 |

#### 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  | 554,198.70                         |
| 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 | 959.65                             |
| 其他        | 746.13                             |
| 合计        | 555,904.48                         |

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   | 2,273,912,751.90                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,212,965,922.06                   |
| 减：交易费用     | 5,467,255.57                       |
| 买卖股票差价收入   | 55,479,574.27                      |

## 6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期                                 |
|-------------------|------------------------------------|
|                   | 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
| 卖出/赎回基金成交总额       | 106,436,507.80                     |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 107,663,411.75                     |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | -                                  |
| 减：交易费用            | 41,337.70                          |
| 基金投资收益            | -1,268,241.65                      |

## 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                 | 272,457.92                         |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -1,971.00                          |
| 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                           | 270,486.92                         |

## 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   | 44,751,660.00                      |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 43,901,786.00                      |
| 减：应计利息总额               | 851,660.00                         |
| 减：交易费用                 | 185.00                             |
| 买卖债券差价收入               | -1,971.00                          |

## 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   | 2,906,568.97                       |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                  |
| 基金投资产生的股利收益   | 23.48                              |
| 合计            | 2,906,592.45                       |

#### 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             | 43,163,569.95                      |
| ——股票投资                 | 43,037,265.77                      |
| ——债券投资                 | 27,292.00                          |
| ——资产支持证券投资             | -                                  |
| ——基金投资                 | 99,012.18                          |
| ——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                     | 43,163,569.95                      |

#### 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 | 51,576.04                          |
| 替代损益    | -                                  |
| 其他      | 399,094.39                         |
| 合计      | 450,670.43                         |

#### 6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                                 |
|-----------|------------------------------------|
|           | 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
| 审计费用      | 34,712.18                          |
| 信息披露费     | 59,507.37                          |
| 证券出借违约金   | -                                  |
| 账户维护费     | 9,000.00                           |
| 银行费用      | 452.00                             |
| 指数使用费     | -                                  |
| 持有人大会-公证费 | -                                  |
| 持有人大会-律师费 | -                                  |
| 开户费       | -                                  |
| 上市费       | -                                  |
| 其他        | 223,089.15                         |
| 合计        | 326,760.70                         |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                                      | 与本基金的关系                 |
|--|-------------------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司                              | 基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）                       | 基金托管人, 基金代销机构           |
| 北美信托银行（The Northern Trust Company）（“北美信托”） | 境外资产托管人                 |
| 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  | 7,495,148.69                          | 0.17            | 94,292,897.11                              | 1.96            |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

##### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |            |          |              |
|-------|---------------------------------------|------------|----------|--------------|
|       | 当期佣金                                  | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |

|       |  | (%)            |           | (%)              |
|-------|--|----------------|-----------|------------------|
| 东方证券  | 5,485.58                                   | 0.26           | -         | -                |
| 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  | 72,515.78                                  | 2.71           | 24,037.29 | 16.16            |

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<br>2023 年 01 月 01 日至<br>2023 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 01 月 01 日至<br>2022 年 06 月 30 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,782,640.76                                | 8,773,685.72                                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,626,020.58                                | 2,663,035.66                                     |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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<br>2023 年 01 月 01 日至<br>2023 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 01 月 01 日至<br>2022 年 06 月 30 日 |
|----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,513,291.26                                | 1,705,994.44                                     |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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                           |                     |                    |           |
|                | 添富全球消费混合（QDII）人民币 A                        | 添富全球消费混合（QDII）人民币 C | 添富全球消费混合（QDII）美元现汇 | 合计        |
| 中国工商银行股份有限公司   | -  | 23,991.91           | -                  | 23,991.91 |
| 东方证券股份有限公司     | -  | 788.80              | -                  | 788.80    |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | -  | 36,189.58           | -                  | 36,189.58 |
| 合计             | -  | 60,970.29           | -                  | 60,970.29 |
| 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                           |                     |                    |           |
|                | 添富全球消费混合（QDII）人民币 A                        | 添富全球消费混合（QDII）人民币 C | 添富全球消费混合（QDII）美元现汇 | 合计        |
| 中国工商银行股份有限公司   | -  | 25,610.90           | -                  | 25,610.90 |
| 东方证券股份有限公司     | -  | 784.52              | -                  | 784.52    |
| 汇添富基金管理股份有限公司  | -  | 38,338.24           | -                  | 38,338.24 |
| 合计             | -  | 64,733.66           | -                  | 64,733.66 |

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为

1.0%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 1.0% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 添富全球消费混合（QDII）人民币 A              |                                       |  |
|----------------------------------|---------------------------------------|--|
| 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 |
| 基金合同生效日（2018 年 09 月 21 日）持有的基金份额 | -                                     | -  |

|                                  |                                       |  |
|----------------------------------|---------------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额                      | -                                     | 9,270,242.51                               |
| 报告期内申购/买入总份额                     | -                                     | -  |
| 报告期内因拆分变动份额                      | -                                     | -  |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额                   | -                                     | 9,270,242.51                               |
| 报告期末持有的基金份额                      | -                                     | -  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）           | -                                     | -  |
| 添富全球消费混合（QDII）人民币 C              |                                       |  |
| 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 |
| 基金合同生效日（2018 年 09 月 21 日）持有的基金份额 | -                                     | -  |
| 报告期初持有的基金份额                      | -                                     | -  |
| 报告期内申购/买入总份额                     | -                                     | -  |
| 报告期内因拆分变动份额                      | -                                     | -  |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额                   | -                                     | -  |
| 报告期末持有的基金份额                      | -                                     | -  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）           | -                                     | -  |
| 添富全球消费混合（QDII）美元现汇               |                                       |  |
| 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 |
| 基金合同生效日（2018 年 09 月 21 日）持有的基金份额 | -                                     | -  |
| 报告期初持有的基金份额                      | -                                     | -  |
| 报告期内申购/买入总份额                     | -                                     | -  |
| 报告期内因拆分变动份额                      | -                                     | -  |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额                   | -                                     | -  |
| 报告期末持有的基金份额                      | -                                     | -  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）           | -                                     | -  |

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 6.4.10.5.2 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    |
| 工商银行  | 6,176,528.00                          | 8,782.28   | 14,807,014.79                              | 57,758.52 |
| 北美信托  | 51,611,915.12                         | 545,416.42 | 24,796,221.24                              | -         |

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码    | 股票名称                           | 停牌日期             | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额    | 期末估值总额   | 备注 |
|---------|--------------------------------|------------------|--------|--------|------|--------|-------|-----------|----------|----|
| 1995 HK | CIFI Ever Sunshine Services Gr | 2023 年 03 月 31 日 | 重大事项停牌 | 2.81   |      | -      | 1,300 | 10,260.49 | 3,655.65 |    |

##### 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。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。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，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<br>期<br>末<br>202<br>3年<br>06<br>月<br>30<br>日 | 1个月以内         | 1<br>-<br>3<br>个月 | 3个月-1年 | 1<br>-<br>5<br>年 | 5<br>年<br>以上 | 不计息            | 合计             |
|--|---------------|-------------------|--------|------------------|--------------|----------------|----------------|
| 资产   |               |                   |        |                  |              |                |                |
| 银行存款   | 57,788,443.12 | -                 | -      | -                | -            | -              | 57,788,443.12  |
| 结算备付金  | 669.85        | -                 | -      | -                | -            | -              | 669.85         |
| 存出保证金  | 8,464.46      | -                 | -      | -                | -            | -              | 8,464.46       |
| 交易性金融资产  | 13,996,140.00 | -                 | -      | -                | -            | 802,477,364.56 | 816,473,504.56 |
| 衍生金融资产   | -             | -                 | -      | -                | -            | -              | -              |
| 买入返售金融   | -             | -                 | -      | -                | -            | -              | -              |

|         |               |   |   |   |   |                |                |
|---------|---------------|---|---|---|---|----------------|----------------|
| 资产      |               |   |   |   |   |                |                |
| 债权投资    | -             | - | - | - | - | -              | -              |
| 应收清算款   | -             | - | - | - | - | 51,470,232.98  | 51,470,232.98  |
| 应收股利    | -             | - | - | - | - | 879,452.87     | 879,452.87     |
| 应收申购款   | -             | - | - | - | - | 737,536.45     | 737,536.45     |
| 递延所得税资产 | -             | - | - | - | - | -              | -              |
| 其他资产    | -             | - | - | - | - | -              | -              |
| 资产总计    | 71,793,717.43 | - | - | - | - | 855,564,586.86 | 927,358,304.29 |
| 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     | - | - | - | - | - | 25,879,935.40 | 25,879,935.40 |
| 应付赎回款     | - | - | - | - | - | 6,664,794.59  | 6,664,794.59  |
| 应付管理人报酬   | - | - | - | - | - | 1,291,930.60  | 1,291,930.60  |
| 应付托管费     | - | - | - | - | - | 251,208.73    | 251,208.73    |
| 应付销       | - | - | - | - | - | 138,963.94    | 138,963.94    |

|                                 |                   |             |          |             |                  |                    |                    |
|---------------------------------|-------------------|-------------|----------|-------------|------------------|--------------------|--------------------|
| 售<br>服<br>务<br>费                |                   |             |          |             |                  |                    |                    |
| 应<br>付<br>投<br>资<br>顾<br>问<br>费 | -                 | -           | -        | -           | -                | -                  | -                  |
| 应<br>交<br>税<br>费                | -                 | -           | -        | -           | -                | -                  | -                  |
| 应<br>付<br>利<br>润                | -                 | -           | -        | -           | -                | -                  | -                  |
| 递<br>延<br>所<br>得<br>税<br>负<br>债 | -                 | -           | -        | -           | -                | -                  | -                  |
| 其<br>他<br>负<br>债                | -                 | -           | -        | -           | -                | 170,845.48         | 170,845.48         |
| 负<br>债<br>总<br>计                | -                 | -           | -        | -           | -                | 34,397,678.74      | 34,397,678.74      |
| 利<br>率<br>敏<br>感<br>度<br>缺<br>口 | 71,793,717.4<br>3 | -           | -        | -           | -                | 821,166,908.1<br>2 | 892,960,625.5<br>5 |
| 上<br>年<br>度                     | 1 个月以内            | 1<br>-<br>3 | 3 个月-1 年 | 1<br>-<br>5 | 5<br>年<br>以<br>上 | 不计息                | 合计                 |

| 末<br>202<br>2 年<br>12<br>月<br>31<br>日 |               | 个<br>月 |               | 年 | 上 |                |                |
|---------------------------------------|---------------|--------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 资产                                    |               |        |               |   |   |                |                |
| 银行存款                                  | 47,742,643.13 | -      | -             | - | - | -              | 47,742,643.13  |
| 结算备付金                                 | 301,774.14    | -      | -             | - | - | -              | 301,774.14     |
| 存出保证金                                 | 67,980.93     | -      | -             | - | - | -              | 67,980.93      |
| 交易性金融资产                               | -             | -      | 44,463,712.08 | - | - | 740,735,617.17 | 785,199,329.25 |
| 衍生金融资产                                | -             | -      | -             | - | - | -              | -              |
| 买入返售金融资产                              | -             | -      | -             | - | - | -              | -              |

|         |               |   |               |   |   |                |                |
|---------|---------------|---|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 债权投资    | -             | - | -             | - | - | -              | -              |
| 应收清算款   | -             | - | -             | - | - | 25,409,139.85  | 25,409,139.85  |
| 应收股利    | -             | - | -             | - | - | 272,747.29     | 272,747.29     |
| 应收申购款   | -             | - | -             | - | - | 501,704.04     | 501,704.04     |
| 递延所得税资产 | -             | - | -             | - | - | -              | -              |
| 其他资产    | -             | - | -             | - | - | -              | -              |
| 资产总计    | 48,112,398.20 | - | 44,463,712.08 | - | - | 766,919,208.35 | 859,495,318.63 |
| 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     | - | - | - | - | - | 17,475,210.08 | 17,475,210.08 |
| 应付赎回款     | - | - | - | - | - | 1,765,536.03  | 1,765,536.03  |
| 应付管理人报酬   | - | - | - | - | - | 1,289,760.77  | 1,289,760.77  |
| 应付托管费     | - | - | - | - | - | 250,786.81    | 250,786.81    |
| 应付销售服     | - | - | - | - | - | 143,486.92    | 143,486.92    |

|         |               |   |               |   |   |                |                |
|---------|---------------|---|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 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    | -             | - | -             | - | - | 250,983.58     | 250,983.58     |
| 负债总计    | -             | - | -             | - | - | 21,175,764.19  | 21,175,764.19  |
| 利率敏感度缺口 | 48,112,398.20 | - | 44,463,712.08 | - | - | 745,743,444.16 | 838,319,554.44 |

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；<br>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；<br>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；<br>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；<br>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   | 573.44                      | 34,366.55             |
|    | 基准利率增加 25 个基点   | -573.44                     | -34,366.01            |

#### 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     | 1,933,559.63         | 25,118,312.32 | 26,113,210.21 | 53,165,082.16 |
| 结算备付金    | -                    | -             | -             | -             |

|          |                |                |                |                |
|----------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 存出保证金    | -              | -              | -              | -              |
| 交易性金融资产  | 545,672,197.21 | 181,245,828.53 | 74,733,374.72  | 801,651,400.46 |
| 衍生金融资产   | -              | -              | -              | -              |
| 买入返售金融资产 | -              | -              | -              | -              |
| 债权投资     | -              | -              | -              | -              |
| 应收清算款    | 51,470,232.98  | -              | -              | 51,470,232.98  |
| 应收股利     | 173,029.44     | 706,423.43     | -              | 879,452.87     |
| 应收申购款    | 10,046.82      | -              | -              | 10,046.82      |
| 递延所得税资产  | -              | -              | -              | -              |
| 其他资产     | -              | -              | -              | -              |
| 资产合计     | 599,259,066.08 | 207,070,564.28 | 100,846,584.93 | 907,176,215.29 |
| 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<br>回购<br>金融<br>资产<br>款  | -              | -              | -             | -              |
| 应付<br>清算<br>款              | -              | 2,700,913.25   | 23,179,021.89 | 25,879,935.14  |
| 应付<br>赎回<br>款              | 1,400,217.19   | -              | -             | 1,400,217.19   |
| 应付<br>管理<br>人报<br>酬        | -              | -              | -             | -              |
| 应付<br>托管<br>费              | -              | -              | -             | -              |
| 应付<br>销售<br>服务<br>费        | -              | -              | -             | -              |
| 应付<br>投资<br>顾问<br>费        | -              | -              | -             | -              |
| 应交<br>税费                   | -              | -              | -             | -              |
| 应付<br>利润                   | -              | -              | -             | -              |
| 递延<br>所得<br>税负<br>债        | -              | -              | -             | -              |
| 其他<br>负债                   | 50.58          | -              | -             | 50.58          |
| 负债<br>合计                   | 1,400,267.77   | 2,700,913.25   | 23,179,021.89 | 27,280,202.91  |
| 资产<br>负债<br>表外<br>汇风<br>险敞 | 597,858,798.31 | 204,369,651.03 | 77,667,563.04 | 879,896,012.38 |

| 项目       | 上年度末 2022 年 12 月 31 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             |
| 口净额      |                       |                |               |                |
| 以外币计价的资产 |                       |                |               |                |
| 银行存款     | 38,589,110.23         | 4,600,283.82   | 4,150,994.35  | 47,340,388.40  |
| 结算备付金    | -                     | -              | -             | -              |
| 存出保证金    | -                     | -              | -             | -              |
| 交易性金融资产  | 344,073,886.83        | 355,551,523.52 | 29,320,383.74 | 728,945,794.09 |
| 衍生金融资产   | -                     | -              | -             | -              |
| 买入返售金融资产 | -                     | -              | -             | -              |
| 债权投资     | -                     | -              | -             | -              |
| 应收清算款    | -                     | 25,409,139.85  | -             | 25,409,139.85  |
| 应收股利     | 25,695.61             | 247,051.68     | -             | 272,747.29     |
| 应收申购款    | 26,426.13             | -              | -             | 26,426.13      |
| 递延所得税资产  | -                     | -              | -             | -              |
| 其他资产     | -                     | -              | -             | -              |

|           |                |                |               |                |
|-----------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 资产合计      | 382,715,118.80 | 385,807,998.87 | 33,471,378.09 | 801,994,495.76 |
| 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     | 13,458,309.46  | -              | 4,016,899.51  | 17,475,208.97  |
| 应付赎回款     | 28,744.85      | -              | -             | 28,744.85      |
| 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               | 13,487,054.31  | -              | 4,016,899.51  | 17,503,953.82  |
| 资产负债表外<br>外汇风险敞口净额 | 369,228,064.49 | 385,807,998.87 | 29,454,478.58 | 784,490,541.94 |

#### 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 |
|    | 美元相对人民币升值 5%                                      | 29,892,939.92               | 18,461,403.22         |
|    | 美元相对人民币贬值 5%                                      | -29,892,939.92              | -18,461,403.22        |
|    | 港币相对人民币升值 5%                                      | 10,218,482.55               | 19,290,399.94         |
|    | 港币相对人民币贬值 5%                                      | -10,218,482.55              | -19,290,399.94        |
|    | 欧元相对人民币升值 5%                                      | 3,883,378.15                | 1,472,723.93          |
|    | 欧元相对人民币贬值 5%                                      | -3,883,378.15               | -1,472,723.93         |

#### 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  | 777,917,082.58       | 87.12         | 731,034,005.98        | 87.20         |
| 交易性金融资产—基金投资  | 24,560,281.98        | 2.75          | 9,701,611.19          | 1.16          |
| 交易性金融资产—债券投资  | 13,996,140.00        | 1.57          | 44,463,712.08         | 5.30          |
| 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            | 816,473,504.56       | 91.43         | 785,199,329.25        | 93.66         |

#### 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；<br>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 |
|    | 指数上涨 5%   | 21,442,139.52               | 26,708,734.12         |
|    | 指数下跌 5%   | -21,442,139.52              | -26,708,734.12        |

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<br>2023 年 06 月 30 日 |
|---------------|-------------------------|
| 第一层次          | 801,734,649.74          |
| 第二层次          | 14,738,854.82           |
| 第三层次          | -                       |
| 合计            | 816,473,504.56          |

##### 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             | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 777,917,082.58 | 83.89            |
|    | 其中：普通股            | 725,232,746.03 | 78.20            |
|    | 存托凭证              | 52,684,336.55  | 5.68             |
|    | 优先股               | -              | -                |
|    | 房地产信托             | -              | -                |
| 2  | 基金投资              | 24,560,281.98  | 2.65             |
| 3  | 固定收益投资            | 13,996,140.00  | 1.51             |
|    | 其中：债券             | 13,996,140.00  | 1.51             |
|    | 资产支持证券            | -              | -                |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -                |
|    | 其中：远期             | -              | -                |
|    | 期货                | -              | -                |
|    | 期权                | -              | -                |
|    | 权证                | -              | -                |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -                |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -                |
| 6  | 货币市场工具            | -              | -                |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 57,789,112.97  | 6.23             |
| 8  | 其他各项资产            | 53,095,686.76  | 5.73             |
| 9  | 合计                | 927,358,304.29 | 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 1,219,538.90 元，占期末净值比例为 0.14%。

#### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值           | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|--------|----------------|------------------|
| 美国     | 521,111,915.23 | 58.36            |
| 中国香港   | 181,245,828.53 | 20.30            |
| 法国     | 45,826,280.92  | 5.13             |
| 意大利    | 23,994,307.80  | 2.69             |

|    |                |       |
|----|----------------|-------|
| 瑞士 | 4,912,786.00   | 0.55  |
| 中国 | 825,964.10     | 0.09  |
| 合计 | 777,917,082.58 | 87.12 |

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币元）     | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|----------------|--------------|
| 10 能源   | 1,032,617.60   | 0.12         |
| 15 原材料  | -              | -            |
| 20 工业   | 10,199,755.75  | 1.14         |
| 25 可选消费 | 459,998,522.02 | 51.51        |
| 30 日常消费 | 95,952,763.03  | 10.75        |
| 35 医疗保健 | 26,482,240.21  | 2.97         |
| 40 金融   | 18,581,319.01  | 2.08         |
| 45 信息技术 | 44,417,624.50  | 4.97         |
| 50 电信服务 | 120,689,593.86 | 13.52        |
| 55 公用事业 | -              | -            |
| 60 房地产  | 562,646.60     | 0.06         |
| 合计      | 777,917,082.58 | 87.12        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）             | 公司名称（中文） | 证券代码   | 所在证券市场 | 所属国家（地区） | 数量（股）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------|----------|--------|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | Tencent Holdings Ltd | 腾讯控股     | 700 HK | 香港联合交易 | 中国香港     | 251,100 | 76,768,443.42 | 8.60         |

|   |                         |                            |         |           |    |         |               |      |
|---|-------------------------|----------------------------|---------|-----------|----|---------|---------------|------|
|   |                         |                            |         | 所         |    |         |               |      |
| 2 | Amazon.com Inc          | 亚马逊公司                      | AMZN US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 63,824  | 60,119,354.30 | 6.73 |
| 3 | On Holding AG           | On 控股股份公司                  | ONON US | 纽约证券交易所   | 美国 | 150,143 | 35,801,808.55 | 4.01 |
| 4 | Hermes International    | 爱马仕国际公司                    | RMS FP  | 巴黎交易所     | 法国 | 2,003   | 31,397,884.29 | 3.52 |
| 5 | Tesla Inc               | 特斯拉公司                      | TSLA US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 16,460  | 31,134,051.58 | 3.49 |
| 6 | Lululemon Athletica Inc | Lululemon Athletica 股份有限公司 | LULU US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 10,557  | 28,873,028.67 | 3.23 |
| 7 | Home Depot Inc/The      | 家得宝                        | HD US   | 纽约证券交易所   | 美国 | 12,524  | 28,111,652.34 | 3.15 |

|    |                            |                               |         |           |      |            |               |      |
|----|----------------------------|-------------------------------|---------|-----------|------|------------|---------------|------|
|    |                            |                               |         | 交易所       |      |            |               |      |
| 8  | Chipotle Mexican Grill Inc | Chipotle Mexican Grill 股份有限公司 | CMG US  | 纽约证券交易所   | 美国   | 1,617      | 24,992,329.69 | 2.80 |
| 9  | Costco Wholesale Corp      | 开市客                           | COST US | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 6,214      | 24,173,865.63 | 2.71 |
| 10 | Moncler SpA                | Moncler 股份有限公司                | MONC IM | 意大利证券交易所  | 意大利  | 48,091     | 23,994,307.80 | 2.69 |
| 11 | Carnival Corp              | 嘉年华公司                         | CCL US  | 纽约证券交易所   | 美国   | 140,080    | 19,059,538.91 | 2.13 |
| 12 | COFCO Joycome Foods Ltd    | 中粮家佳康                         | 1610 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 10,957,000 | 18,992,013.54 | 2.13 |
| 13 | PayPal Holdings Inc        | Paypal 控股股份有限公司               | PYPL US | 纳斯达克      | 美国   | 36,982     | 17,831,893.26 | 2.00 |

|    |   |                         |            |                                 |                  |         |                   |      |
|----|---|-------------------------|------------|---------------------------------|------------------|---------|-------------------|------|
|    |   |                         |            | 克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所      |                  |         |                   |      |
| 14 | Taiwan<br>Semiconduct<br>or<br>Manufacturi<br>ng Co Ltd | 台积电                     | TSM<br>US  | 纽<br>约<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美<br>国           | 22,721  | 16,568,783.<br>39 | 1.86 |
| 15 | DoorDash<br>Inc   | DoorDash<br>股份有限公<br>司  | DASH<br>US | 纽<br>约<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美<br>国           | 28,033  | 15,479,700.<br>26 | 1.73 |
| 16 | NIKE Inc  | 耐克公司                    | NKE<br>US  | 纽<br>约<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美<br>国           | 18,212  | 14,524,280.<br>28 | 1.63 |
| 17 | LVMH Moet<br>Hennessy<br>Louis<br>Vuitton SE            | LVMH 集团<br>公司           | MC FP      | 巴<br>黎<br>交<br>易<br>所           | 法<br>国           | 2,069   | 14,064,932.<br>27 | 1.58 |
| 18 | China<br>Resources<br>Beer<br>Holdings Co<br>Ltd        | 华润啤酒                    | 291<br>HK  | 香<br>港<br>联<br>合<br>交<br>易<br>所 | 中<br>国<br>香<br>港 | 294,000 | 13,986,805.<br>39 | 1.57 |
| 19 | STAAR<br>Surgical Co                                    | STAAR<br>Surgical<br>公司 | STAA<br>US | 纳<br>斯<br>达<br>克<br>证           | 美<br>国           | 35,577  | 13,514,290.<br>11 | 1.51 |

|    |                  |             |         |           |    |         |               |      |
|----|------------------|-------------|---------|-----------|----|---------|---------------|------|
|    |                  |             |         | 券交易所      |    |         |               |      |
| 20 | Ulta Beauty Inc  | Ulta 美容产品公司 | ULTA US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 3,944   | 13,411,277.58 | 1.50 |
| 21 | Microsoft Corp   | 微软公司        | MSFT US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 4,790   | 11,786,628.13 | 1.32 |
| 22 | ROBLOX Corp      | Roblox 公司   | RBLX US | 纽约证券交易所   | 美国 | 35,574  | 10,359,139.55 | 1.16 |
| 23 | Target Corp      | 塔吉特公司       | TGT US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 9,880   | 9,416,460.24  | 1.05 |
| 24 | Skechers USA Inc | 斯凯奇美国公司     | SKX US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 24,190  | 9,204,552.09  | 1.03 |
| 25 | Wenzhou          | 康宁医院        | 2120    | 香         | 中  | 948,200 | 8,305,103.6   | 0.93 |



|    |                              |                     |            |   |                  |         |              |      |
|----|------------------------------|---------------------|------------|---|------------------|---------|--------------|------|
|    | Kangning Hospital Co Ltd     |                     | HK         | 港<br>联<br>合<br>交<br>易<br>所                | 国<br>香<br>港      |         | 4            |      |
| 26 | MercadoLibre Inc             | MercadoLibre 股份有限公司 | MELI<br>US | 纳<br>斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美<br>国           | 968     | 8,285,772.83 | 0.93 |
| 27 | Atour Lifestyle Holdings Ltd | 亚朵生活控股有限公司          | ATAT<br>US | 纳<br>斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美<br>国           | 67,620  | 7,935,003.60 | 0.89 |
| 28 | Meta Platforms Inc           | Meta 平台股份有限公司       | META<br>US | 纳<br>斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美<br>国           | 3,785   | 7,848,803.42 | 0.88 |
| 29 | Dollar General Corp          | 达乐公司                | DG US      | 纽<br>约<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所           | 美<br>国           | 6,204   | 7,611,044.39 | 0.85 |
| 30 | Samsonite International SA   | 新秀丽                 | 1910<br>HK | 香<br>港<br>联<br>合                          | 中<br>国<br>香<br>港 | 369,600 | 7,530,880.16 | 0.84 |

|    |                             |                       |            |                     |          |         |                  |      |
|----|-----------------------------|-----------------------|------------|---------------------|----------|---------|------------------|------|
|    |                             |                       |            | 交易所                 |          |         |                  |      |
| 31 | Full Truck Alliance Co Ltd  | -                     | YMM<br>US  | 纽约<br>证券<br>交易<br>所 | 美国       | 162,830 | 7,318,309.0<br>3 | 0.82 |
| 32 | PRADA SpA                   | 普拉达                   | 1913<br>HK | 香港<br>联合<br>交易<br>所 | 中国<br>香港 | 139,100 | 6,732,989.4<br>5 | 0.75 |
| 33 | Kuaishou Technology         | 快手                    | 1024<br>HK | 香港<br>联合<br>交易<br>所 | 中国<br>香港 | 134,600 | 6,645,475.1<br>0 | 0.74 |
| 34 | Shopify Inc                 | Shopify 股<br>份有限公司    | SHOP<br>US | 纽约<br>证券<br>交易<br>所 | 美国       | 14,175  | 6,616,701.1<br>9 | 0.74 |
| 35 | Royal Caribbean Cruises Ltd | 皇家加勒比<br>国际游轮有<br>限公司 | RCL<br>US  | 纽约<br>证券<br>交易<br>所 | 美国       | 8,362   | 6,268,192.7<br>6 | 0.70 |
| 36 | Dollar Tree Inc             | 美元树公司                 | DLTR<br>US | 纳斯<br>达克<br>证<br>券  | 美国       | 5,625   | 5,832,575.4<br>4 | 0.65 |

|    |                             |               |         |           |    |         |              |      |
|----|-----------------------------|---------------|---------|-----------|----|---------|--------------|------|
|    |                             |               |         | 交易所       |    |         |              |      |
| 37 | Gildan Activewear Inc       | 吉尔丹运动服装股份有限公司 | GIL US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 23,100  | 5,381,371.20 | 0.60 |
| 38 | Starbucks Corp              | 星巴克公司         | SBUX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 7,497   | 5,366,260.75 | 0.60 |
| 39 | Cie Financiere Richemont SA | 瑞士历峰集团        | CFR SW  | 瑞士证券交易所   | 瑞士 | 4,011   | 4,912,786.00 | 0.55 |
| 40 | Netflix Inc                 | 奈飞公司          | NFLX US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 1,535   | 4,885,740.21 | 0.55 |
| 41 | iQIYI Inc                   | 爱奇艺           | IQ US   | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 114,700 | 4,425,788.05 | 0.50 |

|    |                           |          |             |                                   |    |          |                  |      |
|----|---------------------------|----------|-------------|-----------------------------------|----|----------|------------------|------|
| 42 | Canada Goose Holdings Inc | 加拿大鹅控股公司 | GOOS<br>US  | 纽约<br>证券<br>交易<br>所               | 美国 | 34,193   | 4,397,877.6<br>7 | 0.49 |
| 43 | Sea Ltd                   | Sea 有限公司 | SE US       | 纽约<br>证券<br>交易<br>所               | 美国 | 9,999    | 4,193,434.9<br>3 | 0.47 |
| 44 | Alibaba Group Holding Ltd | 阿里巴巴     | BABA<br>US  | 纽约<br>证券<br>交易<br>所               | 美国 | 6,178    | 3,720,826.7<br>2 | 0.42 |
| 45 | NVIDIA Corp               | 英伟达      | NVDA<br>US  | 纳斯<br>达克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美国 | 1,163    | 3,554,893.1<br>6 | 0.40 |
| 46 | Domino's Pizza Inc        | 达美乐披萨公司  | DPZ<br>US   | 纽约<br>证券<br>交易<br>所               | 美国 | 1,458    | 3,550,262.5<br>7 | 0.40 |
| 47 | adidas AG                 | 阿迪达斯公司   | ADDYY<br>US | 美国<br>OT<br>C<br>市<br>场           | 美国 | 5,030    | 3,537,897.6<br>4 | 0.40 |
| 48 | China Kepei               | 中国科培     | 1890        | 香<br>港                            | 中  | 1,552,00 | 3,391,263.7      | 0.38 |

|    |   |           |            |   |                  |           |              |      |
|----|---|-----------|------------|---|------------------|-----------|--------------|------|
|    | Education Group Ltd                         |           | HK         | 港<br>联<br>合<br>交<br>易<br>所                | 国<br>香<br>港      | 0         | 2            |      |
| 49 | Crocs Inc                                   | 卡骆弛股份有限公司 | CROX<br>US | 纳<br>斯<br>达<br>克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美<br>国           | 4,149     | 3,370,933.68 | 0.38 |
| 50 | Lowe's Cos Inc                              | 劳氏        | LOW<br>US  | 纽<br>约<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所           | 美<br>国           | 2,047     | 3,338,376.68 | 0.37 |
| 51 | Beauty Farm Medical And Health Industry Inc | -         | 2373<br>HK | 香<br>港<br>联<br>合<br>交<br>易<br>所           | 中<br>国<br>香<br>港 | 151,000   | 3,299,489.83 | 0.37 |
| 52 | Tsingtao Brewery Co Ltd                     | 青岛啤酒      | 168<br>HK  | 香<br>港<br>联<br>合<br>交<br>易<br>所           | 中<br>国<br>香<br>港 | 48,300    | 3,170,652.34 | 0.36 |
| 53 | China Yuhua Education Corp Ltd              | 宇华教育      | 6169<br>HK | 香<br>港<br>联<br>合<br>交<br>易<br>所           | 中<br>国<br>香<br>港 | 3,850,000 | 3,123,668.24 | 0.35 |
| 54 | Jiumaojiu                                   | 九毛九       | 9922       | 香   | 中                | 261,000   | 3,089,776.2  | 0.35 |

|    |                                 |                |         |         |      |         |              |      |
|----|---------------------------------|----------------|---------|---------|------|---------|--------------|------|
|    | International Holdings Ltd      |                | HK      | 香港联合交易所 | 香港   |         | 6            |      |
| 55 | Unity Software Inc              | Unity 软件股份有限公司 | U US    | 纽约证券交易所 | 美国   | 9,190   | 2,883,309.53 | 0.32 |
| 56 | ZTO Express Cayman Inc          | 中通快递           | ZTO US  | 纽约证券交易所 | 美国   | 15,900  | 2,881,446.72 | 0.32 |
| 57 | Xtep International Holdings Ltd | 特步国际           | 1368 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 374,500 | 2,755,346.45 | 0.31 |
| 58 | Walt Disney Co/The              | 华特迪士尼公司        | DIS US  | 纽约证券交易所 | 美国   | 4,078   | 2,630,797.01 | 0.29 |
| 59 | Deckers Outdoor Corp            | 德克斯户外用品公司      | DECK US | 纽约证券交易所 | 美国   | 682     | 2,600,306.16 | 0.29 |
| 60 | Constellation Brands Inc        | 星座品牌股份有限公司     | STZ US  | 纽约证     | 美国   | 1,436   | 2,553,906.12 | 0.29 |

|    |                                       |               |         |           |      |         |              |      |
|----|---------------------------------------|---------------|---------|-----------|------|---------|--------------|------|
|    |                                       |               |         | 券交易所      |      |         |              |      |
| 61 | Weilong Delicious Global Holdings Ltd | 卫龙美味全球控股有限公司  | 9985 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 310,000 | 2,240,780.19 | 0.25 |
| 62 | Alphabet Inc                          | Alphabet 公司   | GOOG US | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 2,525   | 2,207,115.19 | 0.25 |
| 63 | China Education Group Holdings Ltd    | 中教控股          | 839 HK  | 香港联合交易所   | 中国香港 | 361,700 | 2,034,229.01 | 0.23 |
| 64 | Hilton Worldwide Holdings Inc         | 希尔顿全球控股股份有限公司 | HLT US  | 纽约证券交易所   | 美国   | 1,887   | 1,984,586.56 | 0.22 |
| 65 | Gushengtang Holdings Ltd              | 固生堂           | 2273 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 41,900  | 1,919,958.81 | 0.22 |
| 66 | Yum China Holdings Inc                | 百胜中国          | 9987 HK | 香港联       | 中国香  | 4,650   | 1,893,230.61 | 0.21 |

|    |                               |                  |         |           |      |        |              |      |
|----|-------------------------------|------------------|---------|-----------|------|--------|--------------|------|
|    |                               |                  |         | 合交易所      | 港    |        |              |      |
| 67 | Kroger Co/The                 | 克罗格公司            | KR US   | 纽约证券交易所   | 美国   | 5,560  | 1,888,246.06 | 0.21 |
| 68 | China Mengniu Dairy Co Ltd    | 蒙牛乳业             | 2319 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 55,000 | 1,495,912.55 | 0.17 |
| 69 | Ross Stores Inc               | 罗斯百货股份有限公司       | ROST US | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 1,775  | 1,438,156.39 | 0.16 |
| 70 | Wolfspeed Inc                 | Wolfspeed 股份有限公司 | WOLF US | 纽约证券交易所   | 美国   | 3,353  | 1,346,840.49 | 0.15 |
| 71 | Chervon Holdings Ltd          | -                | 2285 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 43,300 | 1,237,573.75 | 0.14 |
| 72 | Zoom Video Communications Inc | Zoom 视频通信股份有限公司  | ZM US   | 纳斯达克      | 美国   | 2,440  | 1,196,789.02 | 0.13 |



|    |  |                |            |                                 |                  |         |                  |      |
|----|--|----------------|------------|---------------------------------|------------------|---------|------------------|------|
|    |  |                |            | 克<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所      |                  |         |                  |      |
| 73 | DingDong<br>Cayman Ltd                     | 叮咚买菜           | DDL<br>US  | 纽<br>约<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美<br>国           | 53,514  | 1,194,845.7<br>2 | 0.13 |
| 74 | Pop Mart<br>Internation<br>al Group<br>Ltd | 泡泡玛特           | 9992<br>HK | 香<br>港<br>联<br>合<br>交<br>易<br>所 | 中<br>国<br>香<br>港 | 70,600  | 1,133,898.9<br>5 | 0.13 |
| 75 | CNOOC Ltd                                  | 中国海洋石<br>油     | 883<br>HK  | 香<br>港<br>联<br>合<br>交<br>易<br>所 | 中<br>国<br>香<br>港 | 100,000 | 1,032,617.6<br>0 | 0.12 |
| 76 | Yum! Brands<br>Inc                         | 百胜餐饮集<br>团     | YUM<br>US  | 纽<br>约<br>证<br>券<br>交<br>易<br>所 | 美<br>国           | 992     | 993,125.51       | 0.11 |
| 77 | Giant<br>Biogene<br>Holding Co<br>ltd      | 巨子生物           | 2367<br>HK | 香<br>港<br>联<br>合<br>交<br>易<br>所 | 中<br>国<br>香<br>港 | 28,200  | 904,794.29       | 0.10 |
| 78 | ZJLD Group<br>Inc                          | 珍酒李渡集<br>团有限公司 | 6979<br>HK | 香<br>港<br>联<br>合<br>交<br>易<br>所 | 中<br>国<br>香<br>港 | 122,000 | 884,105.06       | 0.10 |

|    |                                       |              |         |         |      |         |            |      |
|----|---------------------------------------|--------------|---------|---------|------|---------|------------|------|
|    |                                       |              |         | 合交易所    | 港    |         |            |      |
| 79 | Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd     | 周大福          | 1929 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 67,000  | 869,759.05 | 0.10 |
| 80 | Chongqing Fuling Zhacai Group Co Ltd  | 涪陵榨菜         | 002507  | 深圳证券交易所 | 中国   | 45,110  | 825,964.10 | 0.09 |
| 81 | Capri Holdings Ltd                    | Capri 控股有限公司 | CPRI US | 纽约证券交易所 | 美国   | 2,928   | 759,329.84 | 0.09 |
| 82 | China East Education Holdings Ltd     | 中国东方教育       | 667 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 266,500 | 739,580.09 | 0.08 |
| 83 | EuroEyes International Eye Clinic Ltd | 德视佳          | 1846 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 167,000 | 739,059.17 | 0.08 |
| 84 | TJX Cos Inc/The                       | TJX 公司       | TJX US  | 纽约证券交易所 | 美国   | 1,000   | 612,675.58 | 0.07 |

|    |   |              |         |         |      |         |            |      |
|----|---|--------------|---------|---------|------|---------|------------|------|
|    |   |              |         | 易所      |      |         |            |      |
| 85 | Hisense Home Appliances Group Co Ltd      | 海信家电         | 921 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 33,000  | 611,549.33 | 0.07 |
| 86 | Qifu Technology Inc                       | 奇富科技-S       | 3660 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 9,350   | 575,419.24 | 0.06 |
| 87 | Regina Miracle International Holdings Ltd | 维珍妮          | 2199 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 212,000 | 557,060.32 | 0.06 |
| 88 | Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd         | 海吉亚医疗        | 6078 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 13,400  | 523,832.16 | 0.06 |
| 89 | Poly Property Services Co Ltd             | 保利物业服务股份有限公司 | 6049 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 14,600  | 510,841.46 | 0.06 |
| 90 | Ocumension Therapeutics                   | 欧康维视生物       | 1477 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 69,500  | 488,271.39 | 0.05 |

|    |   |               |            |               |      |         |            |      |
|----|---|---------------|------------|---------------|------|---------|------------|------|
| 91 | Rambus Inc                                    | Rambus 股份有限公司 | RMBS<br>US | 纳斯达克<br>证券交易所 | 美国   | 1,000   | 463,679.59 | 0.05 |
| 92 | DPC Dash Ltd                                  | -             | 1405<br>HK | 香港联合<br>交易所   | 中国香港 | 9,000   | 443,103.59 | 0.05 |
| 93 | Chaoju Eye Care Holdings Ltd                  | 朝聚眼科          | 2219<br>HK | 香港联合<br>交易所   | 中国香港 | 101,500 | 435,151.51 | 0.05 |
| 94 | New Oriental Education & Technology Group Inc | 新东方           | EDU<br>US  | 纽约证<br>券交易所   | 美国   | 1,325   | 378,084.57 | 0.04 |
| 95 | Tongdao Liepin Group                          | 同道猎聘          | 6100<br>HK | 香港联合<br>交易所   | 中国香港 | 40,800  | 341,184.23 | 0.04 |
| 96 | Farfetch Ltd                                  | 发发奇           | FTCH<br>US | 纽约证<br>券交易所   | 美国   | 7,800   | 340,421.89 | 0.04 |

|     |  |        |         |           |      |        |            |      |
|-----|--|--------|---------|-----------|------|--------|------------|------|
| 97  | PDD Holdings Inc                               | 拼多多    | PDD US  | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 640    | 319,738.76 | 0.04 |
| 98  | L'Oreal SA                                     | 欧莱雅    | OR FP   | 巴黎交易所     | 法国   | 89     | 299,423.54 | 0.03 |
| 99  | Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd      | 周黑鸭    | 1458 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 99,500 | 281,632.62 | 0.03 |
| 100 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | 永达汽车   | 3669 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 77,000 | 279,710.29 | 0.03 |
| 101 | Yonghe Medical Group Co Ltd                    | -      | 2279 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 34,300 | 243,504.14 | 0.03 |
| 102 | Cloud Music Inc                                | 云村有限公司 | 9899 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 3,100  | 237,225.45 | 0.03 |
| 103 | Tong Ren Tang                                  | 同仁堂科技  | 1666 HK | 香港        | 中国   | 33,000 | 236,709.15 | 0.03 |

|     |                                   |      |         |         |      |        |            |      |
|-----|-----------------------------------|------|---------|---------|------|--------|------------|------|
|     | Technologies Co Ltd               |      |         | 联合交易所   | 香港   |        |            |      |
| 104 | Visa Inc                          | 维萨公司 | V US    | 纽约证券交易所 | 美国   | 100    | 171,598.30 | 0.02 |
| 105 | Guangzhou Automobile Group Co Ltd | 广汽集团 | 2238 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 30,000 | 129,169.40 | 0.01 |
| 106 | China Literature Ltd              | 阅文集团 | 772 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 4,200  | 127,592.81 | 0.01 |
| 107 | Meituan                           | 美团-W | 3690 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 950    | 107,120.24 | 0.01 |
| 108 | Procter & Gamble Co/The           | 宝洁   | PG US   | 纽约证券交易所 | 美国   | 88     | 96,486.97  | 0.01 |
| 109 | Diageo PLC                        | 帝亚吉欧 | DEO US  | 纽约证券交易所 | 美国   | 71     | 89,000.76  | 0.01 |

|     |                              |                  |         |           |      |       |           |      |
|-----|------------------------------|------------------|---------|-----------|------|-------|-----------|------|
|     |                              |                  |         | 交易所       |      |       |           |      |
| 110 | Booking Holdings Inc         | Booking 控股股份有限公司 | BKNG US | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 4     | 78,048.18 | 0.01 |
| 111 | Christian Dior SE            | 克里斯汀迪奥股份公司       | CDI FP  | 巴黎交易所     | 法国   | 10    | 64,040.82 | 0.01 |
| 112 | JD.com Inc                   | 京东集团             | JD US   | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 200   | 49,323.31 | 0.01 |
| 112 | JD.com Inc                   | 京东集团             | 9618 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 4     | 488.28    | 0.00 |
| 113 | Greentown China Holdings Ltd | 绿城中国             | 3900 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 6,000 | 43,425.26 | 0.00 |
| 114 | XPeng Inc                    | 小鹏汽车             | XPEV US | 纽约证券      | 美国   | 400   | 38,788.09 | 0.00 |

|     |                      |                        |         |           |      |       |           |      |
|-----|----------------------|------------------------|---------|-----------|------|-------|-----------|------|
|     |                      |                        |         | 交易所       |      |       |           |      |
| 115 | Texas Roadhouse Inc  | Texas Roadhouse 股份有限公司 | TXRH US | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 44    | 35,697.76 | 0.00 |
| 116 | WuXi AppTec Co Ltd   | 药明康德                   | 2359 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 600   | 34,574.25 | 0.00 |
| 117 | Niu Technologies     | 牛电科技                   | NIU US  | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 1,000 | 28,758.68 | 0.00 |
| 118 | East Buy Holding Ltd | 东方甄选                   | 1797 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 1,000 | 23,510.49 | 0.00 |
| 119 | Ralph Lauren Corp    | 拉夫劳伦                   | RL US   | 纽约证券交易所   | 美国   | 16    | 14,255.06 | 0.00 |
| 120 | AK Medical Holdings  | 爱康医疗                   | 1789 HK | 香港        | 中国   | 2,000 | 12,538.93 | 0.00 |



|         |                                      |                          |            |         |      |       |           |      |
|---------|--------------------------------------|--------------------------|------------|---------|------|-------|-----------|------|
|         | Ltd                                  |                          |            | 联合交易所   | 香港   |       |           |      |
| 12<br>1 | Baidu Inc                            | 百度                       | 9888<br>HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 100   | 12,243.89 | 0.00 |
| 12<br>2 | Bath & Body Works Inc                | Bath & Body Works 股份有限公司 | BBWI<br>US | 纽约证券交易所 | 美国   | 41    | 11,109.67 | 0.00 |
| 12<br>3 | China New Higher Education Group Ltd | 新高教集团                    | 2001<br>HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 5,000 | 10,741.07 | 0.00 |
| 12<br>4 | Wuxi Biologics Cayman Inc            | 药明生物                     | 2269<br>HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 300   | 10,386.10 | 0.00 |
| 12<br>5 | Beijing Airdoc Technology Co Ltd     | 北京鹰瞳科技发展股份有限公司           | 2251<br>HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 1,000 | 9,846.75  | 0.00 |
| 12<br>6 | ANTA Sports Products Ltd             | 安踏体育                     | 2020<br>HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 120   | 8,856.54  | 0.00 |

|         |                         |           |            |               |          |       |          |      |
|---------|-------------------------|-----------|------------|---------------|----------|-------|----------|------|
|         |                         |           |            | 交易所           |          |       |          |      |
| 12<br>7 | Airbnb Inc              | 爱彼迎股份有限公司 | ABNB<br>US | 纳斯达克<br>证券交易所 | 美国       | 8     | 7,408.47 | 0.00 |
| 12<br>8 | Sisram<br>Medical Ltd   | 复锐医疗科技    | 1696<br>HK | 香港<br>联合交易所   | 中国<br>香港 | 800   | 6,889.03 | 0.00 |
| 12<br>9 | Maoyan<br>Entertainment | 猫眼娱乐      | 1896<br>HK | 香港<br>联合交易所   | 中国<br>香港 | 1,000 | 6,610.60 | 0.00 |
| 13<br>0 | Walmart Inc             | 沃尔玛股份有限公司 | WMT<br>US  | 纽约<br>证券交易所   | 美国       | 5     | 5,678.76 | 0.00 |
| 13<br>1 | PepsiCo Inc             | 百事可乐      | PEP<br>US  | 纳斯达克<br>证券交易所 | 美国       | 4     | 5,353.45 | 0.00 |
| 13<br>2 | China<br>Overseas       | 中国海外发展    | 688<br>HK  | 香港            | 中国       | 300   | 4,724.23 | 0.00 |

|     |                                       |         |         |         |      |       |          |      |
|-----|---------------------------------------|---------|---------|---------|------|-------|----------|------|
|     | Land & Investment Ltd                 |         |         | 联合交易所   | 香港   |       |          |      |
| 133 | TAL Education Group                   | 好未来教育集团 | TAL US  | 纽约证券交易所 | 美国   | 100   | 4,306.58 | 0.00 |
| 134 | CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd | 旭辉永升服务  | 1995 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 1,300 | 3,655.65 | 0.00 |
| 135 | China Feihe Ltd                       | 中国飞鹤    | 6186 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 800   | 3,215.87 | 0.00 |
| 136 | China Life Insurance Co Ltd           | 中国人寿    | 2628 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 200   | 2,408.21 | 0.00 |
| 137 | Joinn Laboratories China Co Ltd       | 昭衍新药    | 6127 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 117   | 2,125.07 | 0.00 |
| 138 | Tianli International Holdings Ltd     | 天立国际控股  | 1773 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 800   | 1,534.17 | 0.00 |

|     |  |          |        |         |      |     |          |      |
|-----|--|----------|--------|---------|------|-----|----------|------|
|     |  |          |        | 交易所     |      |     |          |      |
| 139 | Xiabuxiabu Catering Management China Holdings Co Ltd | 呷哺呷哺     | 520 HK | 香港联合交易所 | 中国香港 | 300 | 1,017.87 | 0.00 |
| 140 | Shangri-La Asia Ltd                                  | 香格里拉（亚洲） | 69 HK  | 香港联合交易所 | 中国香港 | 100 | 552.27   | 0.00 |

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）                         | 证券代码    | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------------------|---------|----------------|----------------|
| 1  | Meituan                          | 3690 HK | 189,323,730.38 | 22.58          |
| 2  | Tencent Holdings Ltd             | 700 HK  | 147,621,314.07 | 17.61          |
| 3  | Alibaba Group Holding Ltd        | 9988 HK | 94,104,939.36  | 11.23          |
| 3  | Alibaba Group Holding Ltd        | BABA US | 30,653,906.87  | 3.66           |
| 4  | Microsoft Corp                   | MSFT US | 116,317,125.21 | 13.88          |
| 5  | Lululemon Athletica Inc          | LULU US | 84,991,471.87  | 10.14          |
| 6  | Kuaishou Technology              | 1024 HK | 78,280,346.01  | 9.34           |
| 7  | iQIYI Inc                        | IQ US   | 59,415,847.18  | 7.09           |
| 8  | On Holding AG                    | ONON US | 57,444,694.97  | 6.85           |
| 9  | Amazon.com Inc                   | AMZN US | 55,533,518.23  | 6.62           |
| 10 | Pop Mart International Group Ltd | 9992 HK | 54,250,651.28  | 6.47           |

|    |   |         |               |      |
|----|---|---------|---------------|------|
| 11 | Baidu Inc                                 | 9888 HK | 53,525,248.39 | 6.38 |
| 12 | China Resources Beer Holdings Co Ltd      | 291 HK  | 52,855,258.65 | 6.30 |
| 13 | Home Depot Inc/The                        | HD US   | 47,138,175.90 | 5.62 |
| 14 | Li Ning Co Ltd                            | 2331 HK | 45,797,295.25 | 5.46 |
| 15 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | TSM US  | 45,077,677.73 | 5.38 |
| 16 | PayPal Holdings Inc                       | PYPL US | 42,677,915.22 | 5.09 |
| 17 | China Education Group Holdings Ltd        | 839 HK  | 39,736,475.98 | 4.74 |
| 18 | Tesla Inc                                 | TSLA US | 35,715,906.94 | 4.26 |
| 19 | Chipotle Mexican Grill Inc                | CMG US  | 34,856,802.20 | 4.16 |
| 20 | NIKE Inc                                  | NKE US  | 29,496,494.70 | 3.52 |
| 21 | Carnival Corp                             | CCL US  | 27,835,184.16 | 3.32 |
| 22 | JD.com Inc                                | 9618 HK | 27,378,772.93 | 3.27 |
| 23 | Costco Wholesale Corp                     | COST US | 26,130,772.37 | 3.12 |
| 24 | Moncler SpA                               | MONC IM | 23,848,262.62 | 2.84 |
| 25 | COFCO Joycome Foods Ltd                   | 1610 HK | 23,771,658.08 | 2.84 |
| 26 | DoorDash Inc                              | DASH US | 23,595,362.02 | 2.81 |
| 27 | China Life Insurance Co Ltd               | 2628 HK | 22,892,041.93 | 2.73 |
| 28 | Bilibili Inc                              | 9626 HK | 19,787,579.56 | 2.36 |
| 28 | Bilibili Inc                              | BILI US | 2,136,263.47  | 0.25 |
| 29 | H World Group Ltd                         | HTHT US | 17,292,895.95 | 2.06 |
| 29 | H World Group Ltd                         | 1179 HK | 4,241,842.10  | 0.51 |
| 30 | China Feihe Ltd                           | 6186 HK | 21,265,110.59 | 2.54 |
| 31 | Tsingtao Brewery Co Ltd                   | 168 HK  | 17,943,911.07 | 2.14 |

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。

#### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比 |
|----|----------|------|----------|------------|
|----|----------|------|----------|------------|

|    |   |         |                | 例（%）  |
|----|---|---------|----------------|-------|
| 1  | Meituan                                       | 3690 HK | 189,162,348.09 | 22.56 |
| 2  | Alibaba Group Holding Ltd                     | 9988 HK | 142,528,238.82 | 17.00 |
| 2  | Alibaba Group Holding Ltd                     | BABA US | 29,569,107.73  | 3.53  |
| 3  | Tencent Holdings Ltd                          | 700 HK  | 124,222,340.34 | 14.82 |
| 4  | Microsoft Corp                                | MSFT US | 122,636,635.11 | 14.63 |
| 5  | iQIYI Inc                                     | IQ US   | 110,154,691.00 | 13.14 |
| 6  | Lululemon Athletica Inc                       | LULU US | 84,307,188.64  | 10.06 |
| 7  | Kuaishou Technology                           | 1024 HK | 75,047,897.52  | 8.95  |
| 8  | Amazon.com Inc                                | AMZN US | 67,575,125.30  | 8.06  |
| 9  | Li Ning Co Ltd                                | 2331 HK | 61,918,144.51  | 7.39  |
| 10 | Baidu Inc                                     | 9888 HK | 53,073,127.21  | 6.33  |
| 11 | Pop Mart International Group Ltd              | 9992 HK | 46,287,824.00  | 5.52  |
| 12 | Home Depot Inc/The                            | HD US   | 43,320,480.08  | 5.17  |
| 13 | China Resources Beer Holdings Co Ltd          | 291 HK  | 42,997,419.70  | 5.13  |
| 14 | H World Group Ltd                             | HTHT US | 24,138,803.13  | 2.88  |
| 14 | H World Group Ltd                             | 1179 HK | 15,352,761.92  | 1.83  |
| 15 | China Education Group Holdings Ltd            | 839 HK  | 38,293,828.42  | 4.57  |
| 16 | On Holding AG                                 | ONON US | 36,823,721.78  | 4.39  |
| 17 | New Oriental Education & Technology Group Inc | 9901 HK | 29,262,883.59  | 3.49  |
| 17 | New Oriental Education & Technology Group Inc | EDU US  | 7,081,958.22   | 0.84  |
| 18 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd     | TSM US  | 33,553,261.91  | 4.00  |
| 19 | PDD Holdings Inc                              | PDD US  | 33,289,574.22  | 3.97  |
| 20 | Tsingtao Brewery                              | 168 HK  | 31,526,089.21  | 3.76  |

|    |                                      |         |               |      |
|----|--------------------------------------|---------|---------------|------|
|    | Co Ltd                               |         |               |      |
| 21 | Costco Wholesale Corp                | COST US | 31,397,537.24 | 3.75 |
| 22 | Bilibili Inc                         | 9626 HK | 24,940,052.59 | 2.98 |
| 22 | Bilibili Inc                         | BILI US | 4,902,878.92  | 0.58 |
| 23 | Xtep International Holdings Ltd      | 1368 HK | 24,498,778.21 | 2.92 |
| 24 | JD.com Inc                           | 9618 HK | 23,700,268.21 | 2.83 |
| 25 | China Life Insurance Co Ltd          | 2628 HK | 22,324,608.27 | 2.66 |
| 26 | PayPal Holdings Inc                  | PYPL US | 22,275,861.13 | 2.66 |
| 27 | NIKE Inc                             | NKE US  | 21,521,295.53 | 2.57 |
| 28 | Bath & Body Works Inc                | BBWI US | 20,977,616.06 | 2.50 |
| 29 | Hermes International                 | RMS FP  | 19,117,488.92 | 2.28 |
| 30 | Hisense Home Appliances Group Co Ltd | 921 HK  | 12,765,396.43 | 1.52 |
| 30 | Hisense Home Appliances Group Co Ltd | 000921  | 5,889,497.00  | 0.70 |
| 31 | Bosideng International Holdings Ltd  | 3998 HK | 18,620,988.75 | 2.22 |
| 32 | China Feihe Ltd                      | 6186 HK | 17,873,366.88 | 2.13 |
| 33 | Walt Disney Co/The                   | DIS US  | 17,422,393.18 | 2.08 |

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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |                  |
|------------|------------------|
| 买入成本（成交）总额 | 2,216,811,732.89 |
| 卖出收入（成交）总额 | 2,273,912,751.90 |

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 债券信用等级 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|------|--------------|
|--------|------|--------------|

|        |               |      |
|--------|---------------|------|
| A-至 A+ | 13,996,140.00 | 1.57 |
|--------|---------------|------|

注：本基金债券投资组合主要采用穆迪、标准普尔等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息。

#### 7.7 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  | 239933 | 23 贴现国债 33 | 140,000 | 13,996,140.00 | 1.57         |

#### 7.8 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。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

#### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称                                    | 基金类型  | 运作方式 | 管理人                              | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---|-------|------|----------------------------------|---------------|--------------|
| 1  | Vanguard Extended Duration Treasury ETF | ETF 型 | 开放式  | Vanguard Group Inc/The           | 23,724,632.66 | 2.66         |
| 2  | SPDR S&P Biotech ETF                    | ETF 型 | 开放式  | State Street Global Advisors Inc | 835,649.32    | 0.09         |

#### 7.11 投资组合报告附注

##### 7.11.1



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。

### 7.11.2

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。

### 7.11.3 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 | 8,464.46      |
| 2  | 应收清算款 | 51,470,232.98 |
| 3  | 应收股利  | 879,452.87    |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 737,536.45    |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 53,095,686.76 |

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 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（%） |
| 添富全球消费混合（QDII）人民币 A | 68,350   | 3,488.82  | 1,187,217.64 | 0.50      | 237,273,492.64 | 99.50     |

|                     |         |          |              |      |                |        |
|---------------------|---------|----------|--------------|------|----------------|--------|
| 添富全球消费混合（QDII）人民币 C | 37,466  | 2,383.82 | 631,735.04   | 0.71 | 88,680,538.32  | 99.29  |
| 添富全球消费混合（QDII）美元现汇  | 2,867   | 5,936.22 | 0.00         | 0.00 | 17,019,149.95  | 100.00 |
| 合计                  | 108,683 | 3,172.46 | 1,818,952.68 | 0.53 | 342,973,180.91 | 99.47  |

注：计算上表份额数据时，未将美元份额折算为人民币份额。

## 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 | 添富全球消费混合（QDII）人民币 A | 2,142,127.15 | 0.90        |
|                  | 添富全球消费混合（QDII）人民币 C | 23,934.08    | 0.03        |
|                  | 添富全球消费混合（QDII）美元现汇  | 1,333.47     | 0.01        |
|                  | 合计                  | 2,167,394.70 | 0.63        |

注：计算上表份额数据时，未将美元份额折算为人民币份额。如果将美元份额按照 2023 年 06 月 30 日中国人民银行美元兑换人民币汇率中间价折算为人民币份额后进行计算，添富全球消费混合（QDII）美元现汇份额的管理人所有从业人员持有本基金为 9,635.39 份；从业人员持有本基金合计份额为 2,175,696.62 份，合计份额占比为 0.48%。

## 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 添富全球消费混合（QDII）人民币 A | 10~50             |
|                              | 添富全球消费混合（QDII）人民币 C | 0                 |
|                              | 添富全球消费混合（QDII）美元现汇  | 0                 |
|                              | 合计                  | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金              | 添富全球消费混合（QDII）人民币 A | >100              |

|  |                     |      |
|--|---------------------|------|
|  | 添富全球消费混合（QDII）人民币 C | 0    |
|  | 添富全球消费混合（QDII）美元现汇  | 0    |
|  | 合计                  | >100 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 添富全球消费混合（QDII）人民币 A | 添富全球消费混合（QDII）人民币 C | 添富全球消费混合（QDII）美元现汇 |
|---------------------------------|---------------------|---------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2018 年 09 月 21 日）基金份额总额 | 285,568,522.32      | 62,178,897.96       | 3,255,290.62       |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 251,151,109.39      | 96,859,306.19       | 17,465,166.21      |
| 本报告期基金总申购份额                     | 14,990,657.71       | 8,808,964.99        | 500,510.04         |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 27,681,056.82       | 16,355,997.82       | 946,526.30         |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                   | -                   | -                  |
| 本报告期末基金份额总额                     | 238,460,710.28      | 89,312,273.36       | 17,019,149.95      |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称                      | 交易单元数量 | 股票交易             |                  | 应支付该券商的佣金  |                | 备注 |
|---------------------------|--------|------------------|------------------|------------|----------------|----|
|                           |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| Jefferies International   | -      | 1,811,472,937.18 | 40.34            | 503,552.32 | 23.71          |    |
| Sanford C. Bernstein      | -      | 919,030,989.67   | 20.47            | 355,149.33 | 16.72          |    |
| Goldman Sachs             | -      | 477,084,274.73   | 10.62            | 423,414.91 | 19.94          |    |
| Macquarie                 | -      | 274,261,861.41   | 6.11             | 84,933.31  | 4.00           |    |
| Oppenheimier              | -      | 257,375,266.64   | 5.73             | 150,185.58 | 7.07           |    |
| CICC Hong Kong Securities | -      | 252,529,529.23   | 5.62             | 252,529.53 | 11.89          |    |

|                                  |   |                |      |            |      |  |
|----------------------------------|---|----------------|------|------------|------|--|
| Haitong International Securities | - | 198,208,231.55 | 4.41 | 132,959.50 | 6.26 |  |
| Huatai Securities (HK)           | - | 163,062,349.97 | 3.63 | 130,449.88 | 6.14 |  |
| CGS-CIMB Securities (Singapore)  | - | 98,935,436.15  | 2.20 | 29,680.64  | 1.40 |  |
| China Merchant Security (HK)     | - | 12,093,871.46  | 0.27 | 9,675.10   | 0.46 |  |
| 安信证券                             | 2 | 10,294,767.66  | 0.23 | 7,660.30   | 0.36 |  |
| 东方证券                             | 3 | 7,495,148.69   | 0.17 | 5,485.58   | 0.26 |  |
| 兴业证券                             | 2 | 5,458,996.65   | 0.12 | 3,937.61   | 0.19 |  |
| Morgan Stanley                   | - | 3,394,132.00   | 0.08 | 33,941.32  | 1.60 |  |
| 长江证券                             | 1 | 26,691.69      | 0.00 | 19.26      | 0.00 |  |
| 长城证券                             | 1 | -              | -    | -          | -    |  |
| 国泰君安                             | 2 | -              | -    | -          | -    |  |
| 海通证券                             | 1 | -              | -    | -          | -    |  |
| 首创证券                             | 2 | -              | -    | -          | -    |  |
| 中泰证券                             | 2 | -              | -    | -          | -    |  |

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称                    | 债券交易 |                  | 债券回购交易 |                    | 权证交易 |                  | 基金交易           |                  |
|-------------------------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|----------------|------------------|
|                         | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) | 成交金额           | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
| Jefferies International | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | 152,899,725.13 | 66.81            |
| Sanford C. Bernstein    | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | 25,435,761.39  | 11.11            |
| Goldman Sachs           | -    | -                | -      | -                  | -    | -                | 17,012,432.47  | 7.43             |

|                                  |   |   |   |   |   |   |               |      |
|----------------------------------|---|---|---|---|---|---|---------------|------|
| Macquarie                        | - | - | - | - | - | - | 13,314,668.25 | 5.82 |
| Oppenheimier                     | - | - | - | - | - | - | 17,264,830.31 | 7.54 |
| CICC Hong Kong Securities        | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| Haitong International Securities | - | - | - | - | - | - | 2,932,160.60  | 1.28 |
| Huatai Securities (HK)           | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| CGS-CIMB Securities (Singapore)  | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| China Merchant Security (HK)     | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| 安信证券                             | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| 东方证券                             | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| 兴业证券                             | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| Morgan Stanley                   | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| 长江证券                             | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| 长城证券                             | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| 国泰君安                             | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| 海通证券                             | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| 首创证券                             | - | - | - | - | - | - | -             | -    |
| 中泰证券                             | - | - | - | - | - | - | -             | -    |

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

总监审批。

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元：首创证券（上交所单元，深交所单元）。

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                             | 法定披露日期           |
|----|--|------------------------------------|------------------|
| 1  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 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关于调整旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的公告 | 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站           | 2023 年 04 月 07 日 |
| 5  | 汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富全球消费行业混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告  | 公司网站, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站          | 2023 年 04 月 11 日 |
| 6  | 汇添富全球消费行业混合型证券投资基金基金合同                               | 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站                | 2023 年 04 月 11 日 |
| 7  | 汇添富全球消费行业混合型证券投资基金更新招募说明书（2023 年 4 月 12 日更新）         | 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站                | 2023 年 04 月 12 日 |
| 8  | 汇添富基金管理股份有限公司旗                                       | 上交所, 上证报, 公                        | 2023 年 04 月 21 日 |

|  |                  |                         |  |
|--|------------------|-------------------------|--|
|  | 下基金 2023 年第一季度报告 | 司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站 |  |
|--|------------------|-------------------------|--|

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富全球消费行业混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富全球消费行业混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富全球消费行业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、报告期内汇添富全球消费行业混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日