汇添富国企创新增长股票型证券投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 03 月 29 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。本年度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 2024 年 3 月 27 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 10
3.3 过去三年基金的利润分配情况 14
§4 管理人报告 14
4.1 基金管理人及基金经理情况 14
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 19
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 23
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 23
§5 托管人报告 24
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 24
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 24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 24
§6 审计报告 24
6.1 审计报告的基本信息 24
6.2 审计报告的基本内容 24
§7 年度财务报表 26
7.1 资产负债表 26
7.2 利润表 27
7.3 净资产变动表 29
7.4 报表附注 30
§8 投资组合报告 79
8.1 期末基金资产组合情况 79
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 79
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 80

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....91
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....92
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....92
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....92
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....92
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....92
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....92
8.12 投资组合报告附注.....92
§9 基金份额持有人信息.....93
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....94
9.3 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.....95
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....95
§10 开放式基金份额变动.....95
§11 重大事件揭示.....96
11.1 基金份额持有人大会决议.....96
11.2 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.....96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....96
11.4 基金投资策略的改变.....96
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....96
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....96
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....96
11.8 其他重大事件.....101
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....102
12.1 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.....102
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....102
§13 备查文件目录.....102
13.1 备查文件目录.....102
13.2 存放地点.....103
13.3 查阅方式.....103

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富国企创新增长股票型证券投资基金		
基金简称	汇添富国企创新增长股票		
基金主代码	001490		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 07 月 10 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）	357,727,968.22		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富国企创新增长股票 A	汇添富国企创新增长股票 C	汇添富国企创新增长股票 D
下属分级基金的交易代码	001490	015123	015124
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	351,720,782.09	2,901,734.95	3,105,451.18

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，精选国企创新主题的优质上市公司，结合市场脉络，做中长期布局，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为股票型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘具有持续创新增长动力的国企创新主题上市公司。 本基金的投资策略还包括：债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略、融资投资策略、股票期权投资策略。
业绩比较基准	中证国有企业综合指数*80%+中债综合指数*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	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 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年	2022 年	2021 年

	汇添富国企创新增长股票 A	汇添富国企创新增长股票 C	汇添富国企创新增长股票 D	汇添富国企创新增长股票 A	汇添富国企创新增长股票 C	汇添富国企创新增长股票 D	汇添富国企创新增长股票 A	汇添富国企创新增长股票 C	汇添富国企创新增长股票 D
本期已实现收益	-32,813,167.04	-358,411.60	-92,513.89	-10,856,877.55	-356,671.44	-19,986.33	158,547,060.17	0.00	0.00
本期利润	-106,794,731.52	-520,228.31	-314,077.91	-193,144,929.99	419,723.26	-31,619.92	99,264,355.13	0.00	0.00
加权平均基金份额本期利润	-0.2492	-0.1122	-0.4321	-0.4894	0.1459	-0.2079	0.2617	0.0000	0.0000
本期加权平均净值利	-13.63%	-5.99%	-25.14%	-24.52%	7.62%	-10.88%	11.57%	0.00%	0.00%

润率									
本期基金份额净值增长率	-12.30%	-12.80%	-12.61%	-19.68%	-7.23%	-7.03%	13.02%	0.00%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末			2022 年末			2021 年末		
期末可供分配利润	237,577,667.00	1,903,571.85	2,058,331.79	372,533,023.21	10,178,648.61	410,299.06	499,708,938.92	0.00	0.00
期末可供分配基金份额利润	0.6755	0.6560	0.6628	0.9096	0.8986	0.9026	1.2081	0.0000	0.0000
期	589,298,	4,805,	5,163,	782,091,	21,505,	864,8	983,398	0.0	0.0

末基金资产净值	449.09	306.80	782.97	526.38	760.38	62.29	,953.76	0	0
期末基金份额净值	1.675	1.656	1.663	1.910	1.899	1.903	2.378	0.000	0.000
3.1.3 累计期末指标	2023 年末			2022 年末			2021 年末		
基金份额累计净值增长率	67.50%	-19.10%	-18.76%	91.00%	-7.23%	-7.03%	137.80%	0.00%	0.00%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

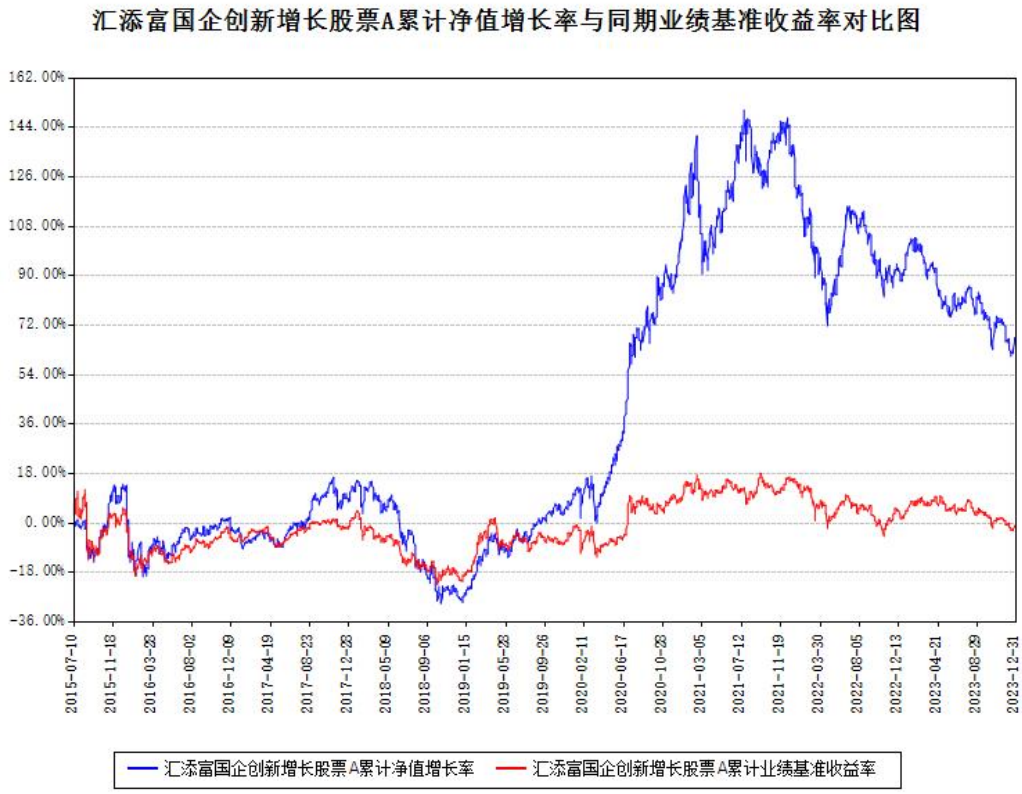
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

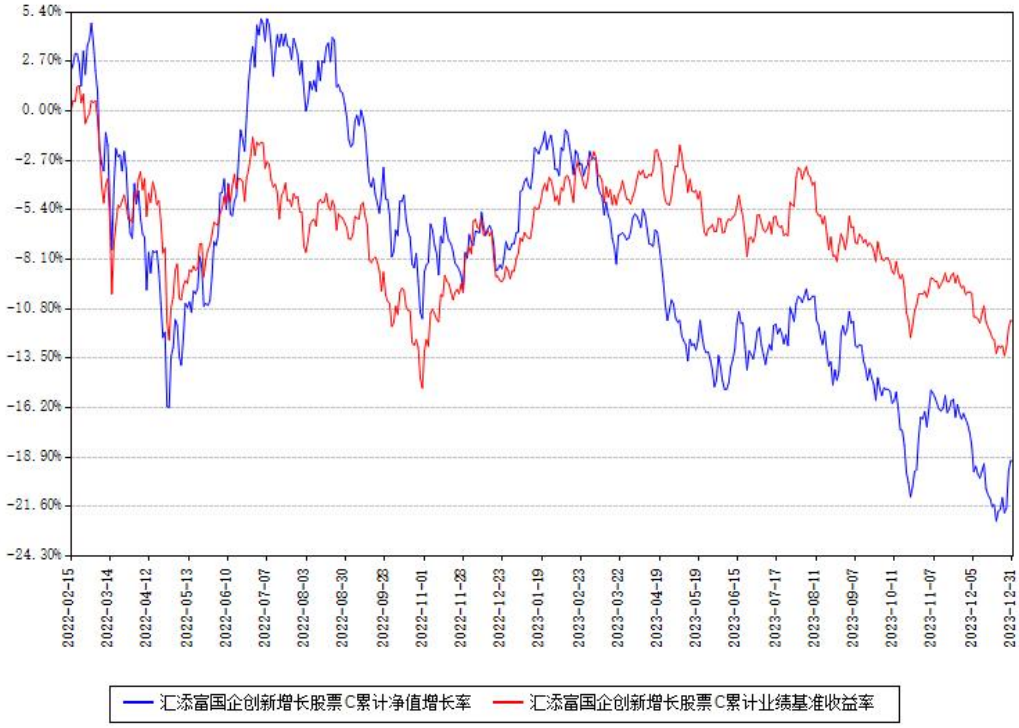
汇添富国企创新增长股票 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-4.45%	0.88%	-3.72%	0.54%	-0.73%	0.34%
过去六个月	-6.89%	0.85%	-5.01%	0.60%	-1.88%	0.25%
过去一年	-12.30%	0.81%	-2.98%	0.61%	-9.32%	0.20%
过去三年	-20.39%	1.24%	-10.83%	0.80%	-9.56%	0.44%
过去五年	131.35%	1.29%	24.90%	0.91%	106.45%	0.38%
自基金合同生效日起至今	67.50%	1.37%	-0.75%	1.05%	68.25%	0.32%
汇添富国企创新增长股票 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
过去三个月	-4.61%	0.88%	-3.72%	0.54%	-0.89%	0.34%
过去六个月	-7.12%	0.85%	-5.01%	0.60%	-2.11%	0.25%
过去一年	-12.80%	0.81%	-2.98%	0.61%	-9.82%	0.20%
自基金合同生效日起至今	-19.10%	1.05%	-11.45%	0.80%	-7.65%	0.25%
汇添富国企创新增长股票 D						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益	①－③	②－④

		准差②		率标准差④		
过去三个月	-4.48%	0.88%	-3.72%	0.54%	-0.76%	0.34%
过去六个月	-6.99%	0.85%	-5.01%	0.60%	-1.98%	0.25%
过去一年	-12.61%	0.81%	-2.98%	0.61%	-9.63%	0.20%
自基金合同生效日起至今	-18.76%	1.05%	-11.45%	0.80%	-7.31%	0.25%

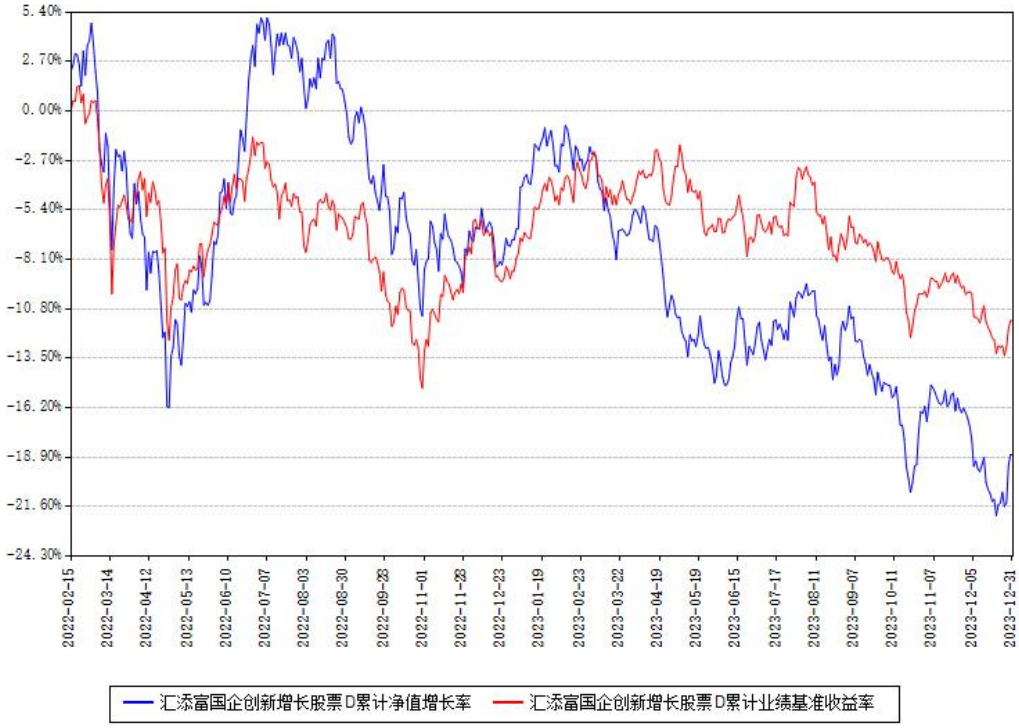
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



汇添富国企创新增长股票C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富国企创新增长股票D累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

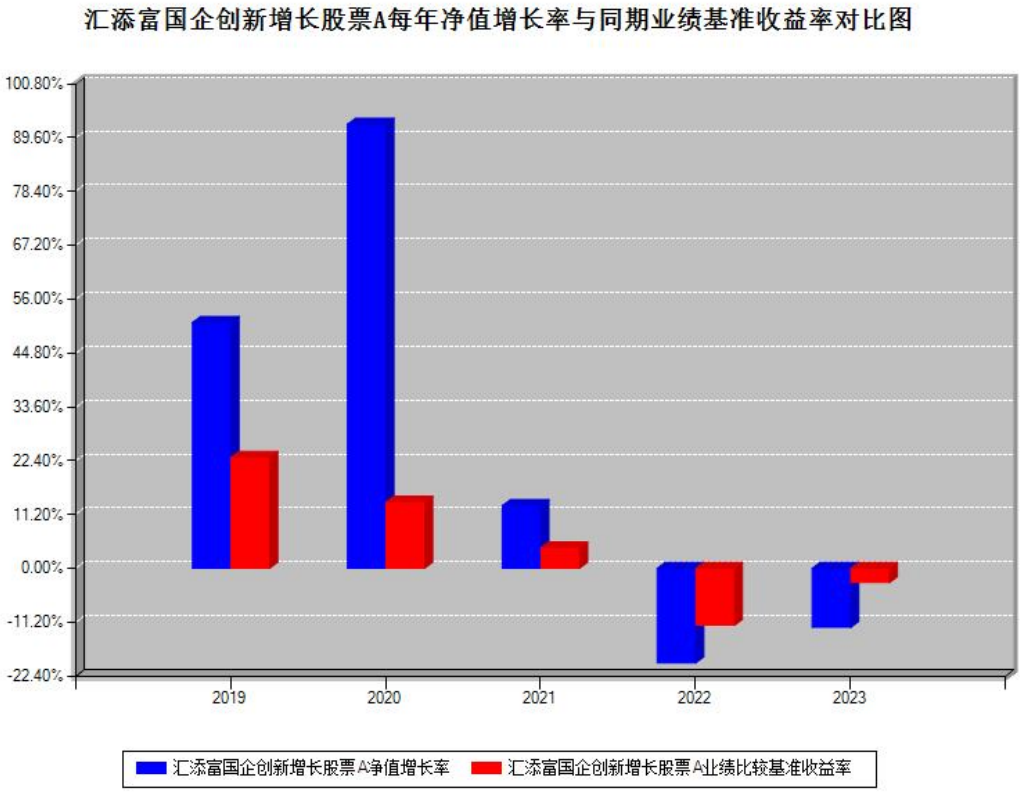


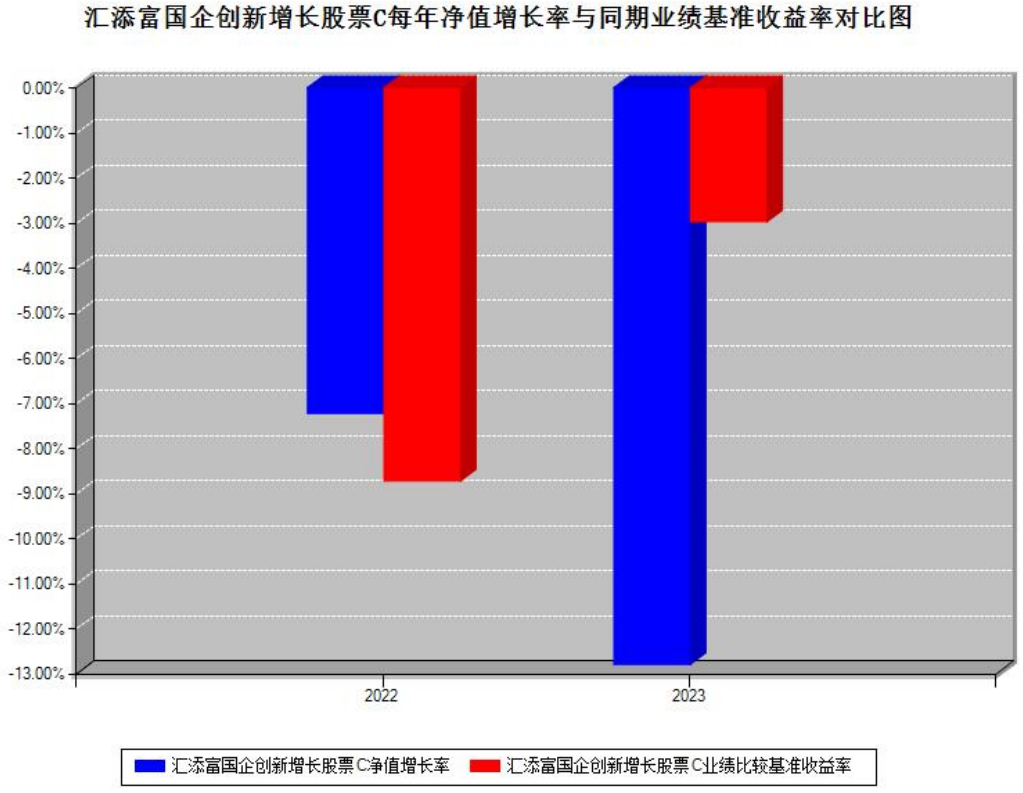
注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2015 年 07 月 10 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

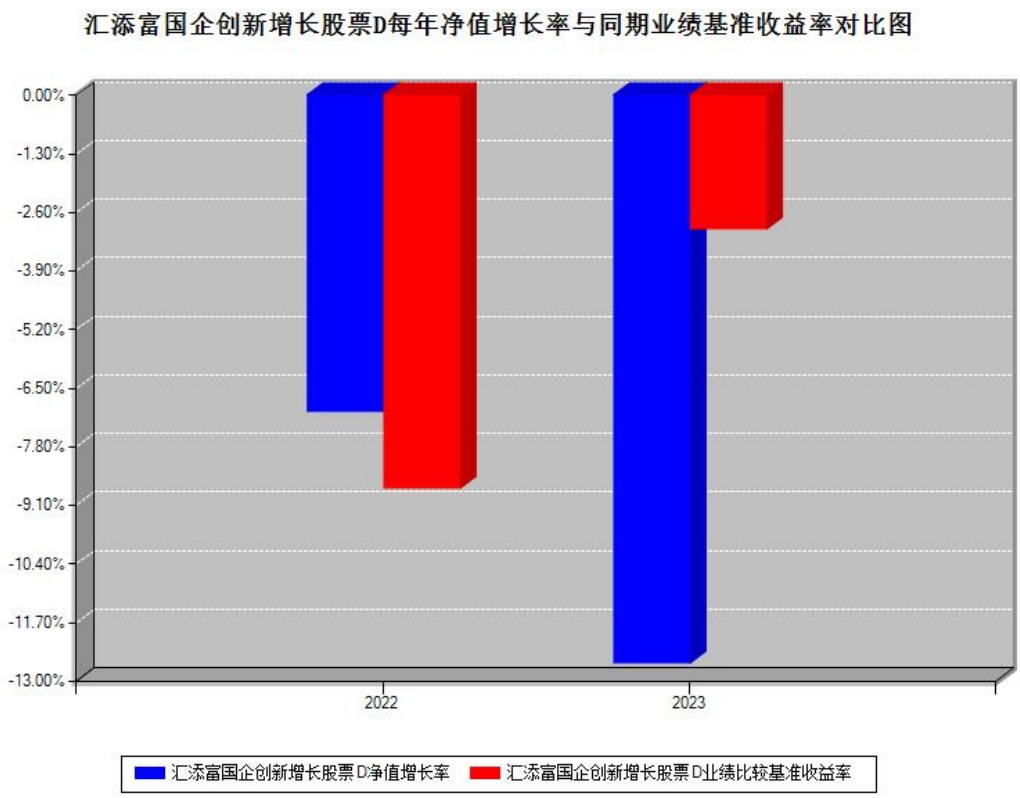
本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

本基金于 2022 年 2 月 14 日新增 C、D 类份额。

3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较







注：本《基金合同》生效之日为 2015 年 07 月 10 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

§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、美国及新加坡设有子公司——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、汇添富资产管理（新加坡）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 年，汇添富基金新成立 48 只公募基金，包括 14 只混合型基金，21 只股票型基金，13 只债券型基金。2023 年底，公司公募基金产品总数达 318 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2023 年，汇添富基金坚持以“客户体验”为中心，以“创新”为宗旨，以“服务”为生命力，稳扎稳打实现互联网平台全方位发展。全年大力开拓投顾式销售及服务模式，持续提升自有平台创新能力。全面致力于基于买方视角下的投顾服务转型，提升客户投资的服务体验。通过打通公司投研端和销售端，实现资源共享最大化，为投顾转型提供更加充实的底层能力支持；同时针对客户端，通过投顾专区进行改版升级，优化投顾策略推荐逻辑，融入丰富的投资工具、工具使用场景和丰富的资讯、内容服务，提升客户投资体验，践行公司投顾转型战略目标。

与此同时，积极拥抱第三方互联网基金销售平台，进一步加强与多家互联网巨头的深度战略合作。围绕客户需求，重构客户中心、资产中心、产品中心、内容中心、活动中心等，全面进行平台运营体系化建设。以开放、转型、服务、共享为目标，搭建以内容中台、营销运营中台、理财师中台、投顾中台等为主要模块的数字中台矩阵。坚持致力于为客户提供全生命周期服务，力争通过金融科技全流程赋能加持，进一步提升客户满意度。

2023 年，汇添富基金继续坚定推进与核心机构客户的合作战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司为机构投资者提供综合解决方案，并深受机构投资者信任。公司不断提升客户服务及产品运营能力，聚焦战略级机构客户，与银行及银行理财公司加快合作，保险规模维持市场领先地位。积极布局多只创新型品种，满足机构投资者专业化需求。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合账户数量持续增加。同时在数字化建设上开展系统平台建设，为客户及团队赋能。

2023 年渠道客户偏好低风险化、渠道运营线上线下一体化趋势愈加明显，公司持续深化核心渠道战略，始终秉持“客户第一”的价值观，围绕如何提升客户“获得感”，优化客

户持有体验开展系列渠道服务和投资者教育工作。积极利用线上化数字营销工具，对客户进行分类经营和分层触达，建立精准的客户画像，提供标准化、体系化、专业化的客户陪伴。积极践行金融科技创新，搭建了一站式投研资讯服务平台，提供紧贴市场的专业投资服务，以及便捷高效的营销辅助工具，赋能渠道客户经理。全年合计开展超 8481 余场“价值投资添富行”线上、线下系列活动。大力开展走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列投资者教育活动，营销培训活动覆盖至各渠道分支机构。

2023 年是券商渠道业务服务深化的一年。为了更好地服务券商渠道客户，公司在 2023 年度组织了超过 2600 场的线上和线下投教、路演活动，主题包括 ETF 大讲堂、走进汇添富、基金经理面对面、投资策略报告会等，覆盖了各重点券商渠道的重点分支机构和营业部，旨在为广大一线投顾赋能的同时，也为广大投资者提供更全面的投资策略交流机会。此外，公司在重点券商渠道积极推广“指能添富”品牌和策略，并结合市场情况，为券商渠道提供相关 ETF 及指数增强产品的配置建议及以客户为中心的解决方案。

2023 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，优化客户服务体系，为公司各项业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2023 年，汇添富香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化，并继续发挥显着成效，国际业务总资产管理规模保持稳定。 汇添富香港子公司发行汇添富美元货币市场基金，进一步完善海外产品线布局，涵盖境外权益、固收、货币类产品，为投资者全球资产分散化布局进一步打下基础，“汇添富中港策略基金”保持国际权威基金评级机构晨星五星评级。从 2023 年年初开始，继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通，进一步完善个性化客户服务体系，积极引导长期资金入市。

2023 年以来，汇添富积极投身公益慈善，充分发挥公募基金力量，履行社会责任，助力实现“共同富裕”。教育助学方面，连续十五年开展“河流·孩子”公益助学项目，组织党支部开展 9 场公益行活动，约 300 名党员、员工、客户与合作伙伴成为公益志愿者，相继回访了四川美姑、贵州黎平、云南怒江、青海互助、内蒙扎兰屯、宁夏泾源、广西百色、湖北恩施、湖南城步等中西部的添富小学，开展学校调研、梦想课堂、学生走访。在上海成功举办“河流·孩子”十五周年公益音乐会及艺术夏令营，帮助来自大山深处、偏远河畔的孩子们开阔眼界、增长见识、提升素养；举办第十六期“河流·孩子”乡村优秀青年教师培训，赋能了 80 位乡村优秀青年教师，助力乡村教师掌握先进的教育理念与教学方法。

金融慈善方面，积极探索创新公益新模式，在中国基金业协会的指导和支持下，举办第二期、第三期“基业上善”慈善资产管理研修营，三期累计已为 87 家基金会培养了 190 名慈善资产管理专业人才，涵盖的慈善资产规模超过 148 亿元，用专业力量推动我国公益慈善事业的可持续发展。参与中国慈善联合会《慈善组织投资管理指南》团体标准起草，助力慈善资产管理的规范化和高质量发展。爱国拥军方面，携手上海市拥军优属基金会开展“崇敬英雄”公益项目，成为“爱国拥军支持单位”，进一步服务国防建设及拥军优属事业。社区公益方面，携手小东门街道开展南外滩健康直通车项目，参与小东门社区公益发展专项基金，支持本地社区建设，共建更有温度的美好社区。乡村振兴方面，参加云南、青海、内蒙古等地产业、教育和养老助老帮扶等项目，深化东西部协作帮扶，助力乡村振兴。

2024 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
李威	本基金的基金经理	2015 年 07 月 10 日	-	14	国籍：中国。学历：清华大学工学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2008 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任行业分析师。2015 年 1 月 29 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富外延增长主题股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月 25 日至 2017 年 5

					月 19 日任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理助理。2015 年 5 月 25 日至 2017 年 5 月 19 日任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理助理。2015 年 5 月 25 日至 2017 年 5 月 19 日任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理助理。2015 年 7 月 10 日至今任汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 22 日至今任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 13 日至今任汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 31 日至今任汇添富成长焦点混合型证券投资基金的基金经理。

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制

度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 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，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

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。

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。

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，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 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 45 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。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年经济整体逐渐走弱，大幅低于投资者年初对于经济反弹的预期。虽然全年出台了一些经济托底政策，但是对于目前的核心经济问题难以解决。在外部环境复杂，国内政策定力较强的情况下，投资者对短期和中长期经济的预期都越发悲观。在这种情况下，和经济有相关度的资产都表现较差；成长板块出现分化，过去热度极高的新能源板块，因为全球增速短期降档表现较差；AI 今年取得突破性进展，所以在年内一段时间从算力到模型到应用整个产业链形成很强的投资脉络，但是目前整体还距离落地应用有些差距，很少有企业能兑现到业绩上，下半年波动巨大。全年来看，深度价值的防御性板块表现较好。

本基金持仓较为均衡，随着对经济判断更加明晰，逐渐减少组合中和经济相关度大的持仓。持仓包括经济调整中确定性较强的部分高端消费；分红稳定的深度价值股；和经济相关度不大的外需、医药、军工、部分新能源等成长方向；也有周期底部产能收缩确定性强的资产；对于商业模式还没有稳定成熟的人工智能板块，做了一些早期布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富国企创新增长股票 A 类份额净值增长率为-12.30%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%。本报告期汇添富国企创新增长股票 C 类份额净值增长率为-12.80%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%。本报告期汇添富国企创新增长股票 D 类份额净值增长率为-12.61%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，经济压力仍然较大。除非在房地产、地方债务、消费等关键领域出现重

大政策刺激，否则经济预期难出现变化。

在这种情况下，市场不会出现明显机会，可能以存量博弈为主。经济强相关的资产仍然需要回避；极其优秀的公司虽然短期受经济影响，但是估值水平出现大幅下降，安全边际充足的时候值得增加配置；经济相关度不大的成长类资产要重视，比如外需中竞争力强的企业，比如人工智能领域能够形成成熟商业模式的企业，比如在新能源领域沉淀下品牌或者成本护城河的企业，以及国内需求强劲的半导体、军工等子行业。本基金仍会坚持寻找中长期确定性强的投资机会，把自下而上和中观比较结合，努力给投资者带来超越市场的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规法务管理

公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的公司价值观，完善合规管理体系，提升专业能力，优化合规资源配置，不断提升合规管理工作的有效性。公司坚持广泛开展合规培训、强化从业人员合规意识，不断夯实公司合规文化体系基础；持续完善公司制度流程体系、优化合规管理制度机制，通过统一的合规审核标准、动态调整的合规管理指引，有效把控各类业务的合规关键点，防范潜在风险，保障各项业务规范开展；深入细致开展合规审查工作，为各部门提供有效的合规咨询与法务支持，督促强化一线合规执行效果；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；优化从业人员管理机制，加强管理措施，严格执行合规考核问责机制，引导全体员工不断提升合规执业意识，强化公司合规履职保障。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报告与监督；通过协调并协助监管机构、第三方独立机构开展各项自查、核查以及审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过对各项检查、审计发现的风险隐患的整改情况进行跟踪检查，持续优化内控管理水平，切实维护基金持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的相应类别的基金份额净值折

算成基金份额，红利再投资的份额免收申购费；基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 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 托管人对本年度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 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2024)审字第 70015647_B51 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富国企创新增长股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的财务报

	表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富国企创新增长股票型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富国企创新增长股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富国企创新增长股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督汇添富国企创新增长股票型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风

	险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富国企创新增长股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富国企创新增长股票型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔺育化　　韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2024 年 03 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富国企创新增长股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	31,503,742.57	138,064,474.16
结算备付金		12,035.35	289,336.18
存出保证金		41,562.41	119,572.90
交易性金融资产	7.4.7.2	569,997,545.18	667,911,502.41
其中：股票投资		553,227,657.50	655,842,007.28

基金投资		-	-
债券投资		16,769,887.68	12,069,495.13
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		4,094,454.88	-
应收股利		-	-
应收申购款		200,110.40	65,439.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		605,849,450.79	806,450,324.72
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 12 月 31 日**	**上年度末 2022 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	807.49
应付赎回款		5,537,570.68	430,728.46
应付管理人报酬		674,860.41	957,137.26
应付托管费		112,476.74	159,522.89
应付销售服务费		4,767.26	8,361.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		177.42	88.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	252,059.42	431,529.81
负债合计		6,581,911.93	1,988,175.67
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	357,727,968.22	421,340,178.17
未分配利润	7.4.7.9	241,539,570.64	383,121,970.88
净资产合计		599,267,538.86	804,462,149.05
负债和净资产总计		605,849,450.79	806,450,324.72

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 357,727,968.22 份。本基金下属汇添富国企创新增长股票 A 基金份额净值 1.675 元，基金份额总额 351,720,782.09 份；本基金

下属汇添富国企创新增长股票 C 基金份额净值 1.656 元，基金份额总额 2,901,734.95 份；本基金下属汇添富国企创新增长股票 D 基金份额净值 1.663 元，基金份额总额 3,105,451.18 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富国企创新增长股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		**-94,714,727.82**	**-178,602,144.22**
1.利息收入		331,989.08	421,610.74
其中：存款利息收入	7.4.7.10	331,989.08	421,610.74
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-20,909,070.55	2,302,010.82
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-31,079,356.81	-8,574,704.60
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	51,311.32	277,568.66
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	10,118,974.94	10,599,146.76
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）	7.4.7.18	-74,364,945.21	-181,523,291.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	227,298.86	197,525.55
减：二、营业总支出		**12,914,309.92**	**14,154,682.43**
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	10,840,512.43	11,927,698.37
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	1,806,752.04	1,987,949.67
3．销售服务费		58,012.40	30,086.39
4．投资顾问费		-	-

5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7．税金及附加		182.05	64.00
8．其他费用	7.4.7.21	208,851.00	208,884.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-107,629,037.74**	**-192,756,826.65**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-107,629,037.74**	**-192,756,826.65**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**-107,629,037.74**	**-192,756,826.65**

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富国企创新增长股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	421,340,178.17	383,121,970.88	804,462,149.05
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	421,340,178.17	383,121,970.88	804,462,149.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-63,612,209.95	-141,582,400.24	-205,194,610.19
（一）、综合收益总额	-	-107,629,037.74	-107,629,037.74
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-63,612,209.95	-33,953,362.50	-97,565,572.45
其中：1.基金申购款	83,881,413.81	76,516,831.99	160,398,245.80
2.基金赎回款	-147,493,623.76	-110,470,194.49	-257,963,818.25
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-

净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	357,727,968.22	241,539,570.64	599,267,538.86
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	413,626,184.38	569,772,769.38	983,398,953.76
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	413,626,184.38	569,772,769.38	983,398,953.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,713,993.79	-186,650,798.50	-178,936,804.71
（一）、综合收益总额	-	-192,756,826.65	-192,756,826.65
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	7,713,993.79	6,106,028.15	13,820,021.94
其中：1.基金申购款	147,796,956.19	149,491,274.02	297,288,230.21
2.基金赎回款	-140,082,962.40	-143,385,245.87	-283,468,208.27
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	421,340,178.17	383,121,970.88	804,462,149.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富国企创新增长股票型证券投资基金（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[2015]1116 号文《关于准予汇添富国企创新增长股票型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2015 年 7 月 10 日生效。首次设立基金募集规模为 3,104,408,914.03 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2015）验字第 60466941_B28 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。

自 2022 年 2 月 14 日起，本基金增设 C 类和 D 类基金份额，原基金份额变更为 A 类基金份额，基金注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股票期权、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证不低于基金资产的 80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的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。本基金主要投资于国企创新主题的上市公司股票及存托凭证，投资于国企创新主题的上市公司股票资产及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，精选国企创新主题的优质上市公司，结合市场脉络，做中长期布局，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：中证国有企业综合指数×80%+中债综合指数×20%。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存

款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8)其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的相应类别的基金份额净值折算成基金份额，红利再投资的份额免收申购费；

3、基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

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

2.增值税

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

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

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

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

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

3.城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4.企业所得税

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

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

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

5.个人所得税

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	31,503,742.57	138,064,474.16
等于：本金	31,499,928.80	138,047,551.30
加：应计利息	3,813.77	16,922.86

减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	31,503,742.57	138,064,474.16

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		655,516,795.31	-	553,227,657.50	-102,289,137.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	18,879,308.25	63,253.58	16,769,887.68	-2,172,674.15
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	18,879,308.25	63,253.58	16,769,887.68	-2,172,674.15
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		674,396,103.56	63,253.58	569,997,545.18	-104,461,811.96
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		684,504,002.88	-	655,842,007.28	-28,661,995.60
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,492,268.25	12,098.03	12,069,495.13	-1,434,871.15

	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	13,492,268.25	12,098.03	12,069,495.13	-1,434,871.15
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		697,996,271.13	12,098.03	667,911,502.41	- 30,096,866.75

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1.48	10.51
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	62,057.94	241,519.30
其中：交易所市场	62,057.94	241,519.30
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	70,000.00	70,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00

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	-	-
应付或有管理费	-	-
其他	-	-
合计	252,059.42	431,529.81

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富国企创新增长股票 A		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	409,558,503.17	409,558,503.17
本期申购	78,288,343.35	78,288,343.35
本期赎回（以“-”号填列）	-136,126,064.43	-136,126,064.43
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	351,720,782.09	351,720,782.09
汇添富国企创新增长股票 C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,327,111.77	11,327,111.77
本期申购	1,014,501.45	1,014,501.45
本期赎回（以“-”号填列）	-9,439,878.27	-9,439,878.27
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	2,901,734.95	2,901,734.95
汇添富国企创新增长股票 D		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	454,563.23	454,563.23
本期申购	4,578,569.01	4,578,569.01
本期赎回（以“-”号填列）	-1,927,681.06	-1,927,681.06
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,105,451.18	3,105,451.18

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富国企创新增长股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	484,501,347.10	-111,968,323.89	372,533,023.21
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	484,501,347.10	-111,968,323.89	372,533,023.21
本期利润	-32,813,167.04	-73,981,564.48	-106,794,731.52
本期基金份额交易产生的变动数	-63,047,515.32	34,886,890.63	-28,160,624.69
其中：基金申购款	91,526,944.84	-19,182,211.23	72,344,733.61
基金赎回款	-154,574,460.16	54,069,101.86	-100,505,358.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	388,640,664.74	-151,062,997.74	237,577,667.00
汇添富国企创新增长股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,270,889.32	-3,092,240.71	10,178,648.61
加：会计政策变更	-	-	-

本期期初	13,270,889.32	-3,092,240.71	10,178,648.61
本期利润	-358,411.60	-161,816.71	-520,228.31
本期基金份额交易产生的变动数	-9,768,022.69	2,013,174.24	-7,754,848.45
其中：基金申购款	1,158,990.80	-305,301.04	853,689.76
基金赎回款	-10,927,013.49	2,318,475.28	-8,608,538.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,144,455.03	-1,240,883.18	1,903,571.85
汇添富国企创新增长股票 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	534,489.20	-124,190.14	410,299.06
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	534,489.20	-124,190.14	410,299.06
本期利润	-92,513.89	-221,564.02	-314,077.91
本期基金份额交易产生的变动数	2,946,771.87	-984,661.23	1,962,110.64
其中：基金申购款	5,093,064.23	-1,774,655.61	3,318,408.62
基金赎回款	-2,146,292.36	789,994.38	-1,356,297.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,388,747.18	-1,330,415.39	2,058,331.79

7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	326,036.88	409,829.40
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	4,834.79	9,656.16
其他	1,117.41	2,125.18
合计	331,989.08	421,610.74

注:“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	362,554,476.62	815,253,731.89
减：卖出股票成本总额	392,777,667.76	821,596,277.97
减：交易费用	856,165.67	2,232,158.52
买卖股票差价收入	-31,079,356.81	-8,574,704.60

7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	51,311.32	17,788.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	259,779.77
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	51,311.32	277,568.66

7.4.7.13.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	1,035,715.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	775,000.00
减：应计利息总额	-	383.47
减：交易费用	-	552.08
买卖债券差价收入	-	259,779.77

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	10,118,974.94	10,599,146.76
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	10,118,974.94	10,599,146.76

7.4.7.18 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-74,364,945.21	-181,523,291.33
——股票投资	-73,627,142.21	-180,088,420.18
——债券投资	-737,803.00	-1,434,871.15
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品	-	-

公允价值变动产生的预估增值税		
合计	-74,364,945.21	-181,523,291.33

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	227,298.86	197,525.55
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	227,298.86	197,525.55

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	851.00	884.00
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	-	-
或有管理费	-	-
其他	-	-
合计	208,851.00	208,884.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
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
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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	12,200,794.97	1.79	75,535,731.50	4.68

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.1.6 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 12 月 31 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	7,373.11	1.49	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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	35,877.00	3.05	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,840,512.43	11,927,698.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,125,410.33	2,698,702.78
应支付基金管理人的净管理费	8,715,102.10	9,228,995.59

注：2023 年 7 月 10 日前，本基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 7 月 10 日起，基金管理费按前一日的基金资产净值 1.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.20%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,806,752.04	1,987,949.67

注：2023 年 7 月 10 日前，本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。经与本基金的基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 7 月 10 日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.2%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	汇添富国企创新增长股票 A	汇添富国企创新增长股票 C	汇添富国企创新增长股票 D	合计
中国工商银行股份有限公司	-	453.47	-	453.47
汇添富基金管理股份有限公司	-	12,215.43	4,716.62	16,932.05
合计	-	12,668.90	4,716.62	17,385.52

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 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	汇添富国企创新增长股票 A	汇添富国企创新增长股票 C	汇添富国企创新增长股票 D	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	20,407.75	1,018.59	21,426.34
合计	-	20,407.75	1,018.59	21,426.34

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60%年费率计提，D 类基金份额的销售服务费按前一日 D 类基金份额资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×基金销售服务费年费率÷当年天数

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金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 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富国企创新增长股票 A		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2015 年 07 月 10 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	47,813,660.95	47,813,660.95
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,721,829.07	-
报告期末持有的基金份额	45,091,831.88	47,813,660.95
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	12.82	11.67
汇添富国企创新增长股票 C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2015 年 07 月 10 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/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（%）	-	-
汇添富国企创新增长股票 D		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至	上年度可比期间 2022 年 01 月

	2023 年 12 月 31 日	01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2015 年 07 月 10 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 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	31,503,742.57	326,036.88	138,064,474.16	409,829.40

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	688347	华虹公司	IPO 网下配售	26,906.00	1,399,112.00

上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
				-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

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

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023 年 12 月 04 日	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	
301172	君逸数	2023 年 07	6 个月	新股流	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	

	码	月19日		通受限						
301202	朗威股份	2023年06月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	
301251	威尔高	2023年08月30日	6个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	
301261	恒工精密	2023年06月29日	6个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	
301272	英华特	2023年07月06日	6个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	
301329	信音电子	2023年07月05日	6个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	
301348	蓝箭电子	2023年08月01	6个月	新股流通受	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	

		日		限						
301393	昊帆生物	2023年07月05日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	
301421	波长光电	2023年08月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	
301456	盘古智能	2023年07月06日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	
301468	博盈特焊	2023年07月12日	6个月	新股流通受限	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	
301469	恒达新材	2023年08月10日	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	
301487	盟固利	2023年08月01日	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	
301489	思	2023	6	新	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	

	泉新材	年10月16日	个月	股流通受限						
301498	乖宝宠物	2023年08月09日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	483	19,315.17	18,745.23	
301499	维科精密	2023年07月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	
301500	飞南资源	2023年09月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	
301505	苏州规划	2023年07月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	
301507	民生健康	2023年08月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	
301509	金凯生	2023年07	6个月	新股流	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	

	科	月 26 日		通受限						
301510	固高科技	2023 年 08 月 04 日	6 个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	
301511	德福科技	2023 年 08 月 08 日	6 个月	新股流通受限	28.00	22.67	893	25,004.00	20,244.31	
301516	中远通	2023 年 12 月 01 日	6 个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	
301517	陕西华达	2023 年 10 月 09 日	6 个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	
301519	舜禹股份	2023 年 07 月 19 日	6 个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	
301525	儒竞科技	2023 年 08 月 23 日	6 个月	新股流通受限	99.57	81.46	208	20,710.56	16,943.68	
301526	国际复材	2023 年 12 月 19	6 个月	新股流通受	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	

		日		限						
301528	多浦乐	2023年08月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	
301529	福赛科技	2023年08月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	
301533	威马农机	2023年08月07日	6个月	新股流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	
301548	崇德科技	2023年09月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	
301550	斯菱股份	2023年09月06日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	
301559	中集环科	2023年09月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	827	20,029.94	15,084.48	
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	
301568	思	2023	6	新	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	

	泰克	年11月21日	个月	股流通受限						
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	
601096	宏盛华源铁塔集团	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	
603075	热威科技股份	2023年09月01日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	
603193	润本生物技术股	2023年10月09日	6个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	

	份									
603231	索宝蛋白	2023年12月06日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	
603270	金帝精密科技股份	2023年08月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	
603275	上海众辰科技	2023年08月16日	6个月	新股流通受限	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	
603276	恒兴新材料科技	2023年09月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	
603296	华勤技术	2023年08月01日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	324	26,179.20	25,191.00	
603373	安邦护卫	2023年12月	6个月	新股流通	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	

	集团股份	13日		受限						
688347	华虹半导体公司	2023年07月27日	6个月	新股流通受限	52.00	42.06	18,835	979,420.00	792,200.10	
688450	光格科技	2023年07月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	
688548	广钢气体股份	2023年08月08日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	3,045	30,054.15	38,823.75	
688549	中巨芯科技	2023年08月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	4,255	22,040.90	34,422.95	
688563	航空材料股份	2023年07月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	542	42,812.58	32,785.58	
688573	信宇人	2023年08月09日	6个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	
688582	芯动联	2023年06	6个月	新股流	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	

	科	月 21 日		通受限						
688591	泰凌微	2023 年 08 月 18 日	6 个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	
688610	埃科光电	2023 年 07 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	
688627	精智达技术	2023 年 07 月 11 日	6 个月	新股流通受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	新股流通受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	6 个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	
688657	浩辰软件	2023 年 09 月 25 日	6 个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	
688671	碧兴物联	2023 年 08 月 02	6 个月	新股流通受	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	

		日		限						
688693	锴威特	2023年08月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	
688716	中研股份	2023年09月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	
688717	艾罗能源	2023年12月26日	5个交易日	新股流通受限	55.66	55.66	3,258	181,340.28	181,340.28	
688717	艾罗能源	2023年12月26日	6个月	新股流通受限	55.66	55.66	7,604	423,238.64	423,238.64	
688719	爱科赛博	2023年09月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注

					-	-	-	-	-	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	31,503,742.57	-	-	-	-	-	31,503,742.57
结算备付金	12,035.35	-	-	-	-	-	12,035.35
存出保证金	41,562.41	-	-	-	-	-	41,562.41
交易性金融资产	11,341,630.15	-	5,428,257.53	-	-	553,227,657.50	569,997,545.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	4,094,454.88	4,094,454.88
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	200,110.40	200,110.40
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	42,898,970.48	-	5,428,257.53	-	-	557,522,222.78	605,849,450.79
负债							
短	-	-	-	-	-	-	-

期借款							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,537,570.68	5,537,570.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	674,860.41	674,860.41
应付	-	-	-	-	-	112,476.74	112,476.74

托管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,767.26	4,767.26
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	177.42	177.42
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	252,059.42	252,059.42
负债总计	-	-	-	-	-	6,581,911.93	6,581,911.93
利率敏感	42,898,970.48	-	5,428,257.53	-	-	550,940,310.85	599,267,538.86

度缺口							
上年度末2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	138,064,474.16	-	-	-	-	-	138,064,474.16
结算备付金	289,336.18	-	-	-	-	-	289,336.18
存出保证金	119,572.90	-	-	-	-	-	119,572.90
交易性金融资产	12,069,495.13	-	-	-	-	655,842,007.28	667,911,502.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买	-	-	-	-	-	-	-

入返售金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	65,439.07	65,439.07
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	150,542,878.37	-	-	-	-	655,907,446.35	806,450,324.72
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	-	-	-	-	-	807.49	807.49
应付赎回款	-	-	-	-	-	430,728.46	430,728.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	957,137.26	957,137.26
应付托	-	-	-	-	-	159,522.89	159,522.89

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,361.23	8,361.23
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	88.53	88.53
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	431,529.81	431,529.81
负债总计	-	-	-	-	-	1,988,175.67	1,988,175.67
利率敏感度	150,542,878.37	-	-	-	-	653,919,270.68	804,462,149.05

缺口							

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4.银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5.该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	7,529.77	-
	基准利率增加 25 个基点	-7,508.79	-

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	553,227,657.50	92.32	655,842,007.28	81.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	16,769,887.68	2.80	12,069,495.13	1.50
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	569,997,545.18	95.12	667,911,502.41	83.03

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证国有企业综合指数上涨 5%	25,521,340.56	32,495,001.03
	中证国有企业综合指数下跌 5%	-25,521,340.56	-32,495,001.03

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	562,252,892.41	666,073,970.63
第二层次	6,057,894.61	385,863.40
第三层次	1,686,758.16	1,451,668.38
合计	569,997,545.18	667,911,502.41

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,451,668.38	1,451,668.38
当期购买	-	1,720,896.77	1,720,896.77
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,451,668.38	1,451,668.38
当期利得或损失总额	-	-34,138.61	-34,138.61
其中：计入损益的利得或损失	-	-34,138.61	-34,138.61
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,686,758.16	

			1,686,758.16
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-34,138.61	-34,138.61

项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,092,978.02	3,092,978.02
当期购买	-	1,346,543.24	1,346,543.24
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,092,978.02	3,092,978.02
当期利得或损失总额	-	105,125.14	105,125.14
其中：计入损益的利得或损失	-	105,125.14	105,125.14
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,451,668.38	1,451,668.38
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	105,125.14	105,125.14

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,686,758.16	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1462-2.1988	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,451,668.38	平均价格亚式期权模型	波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.5 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。

7.4.15 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，除本报告“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”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	553,227,657.50	91.31
	其中：股票	553,227,657.50	91.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,769,887.68	2.77
	其中：债券	16,769,887.68	2.77
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	31,515,777.92	5.20

8	其他各项资产	4,336,127.69	0.72
9	合计	605,849,450.79	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	12,130,035.60	2.02
C	制造业	456,526,207.84	76.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,324.59	0.00
E	建筑业	3,347.28	0.00
F	批发和零售业	16,784.31	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	6,435,633.00	1.07
H	住宿和餐饮业	1,043,510.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,614,516.15	3.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	23,561,901.00	3.93
L	租赁和商务服务业	1,459,711.40	0.24
M	科学研究和技术服务业	28,623,145.33	4.78
N	水利、环境和公共设施管理业	3,091,957.74	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	716,583.26	0.12
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	553,227,657.50	92.32

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	32,185	55,551,310.00	9.27
2	000568	泸州老窖	304,800	54,687,216.00	9.13
3	000858	五粮液	216,100	30,320,991.00	5.06
4	603259	药明康	350,526	25,504,271.76	4.26

		德			
5	600160	巨化股份	1,489,000	24,553,610.00	4.10
6	600048	保利发展	2,379,990	23,561,901.00	3.93
7	002068	黑猫股份	1,652,800	19,172,480.00	3.20
8	300750	宁德时代	107,280	17,514,532.80	2.92
9	600309	万华化学	209,884	16,123,288.88	2.69
10	603379	三美股份	352,600	11,988,400.00	2.00
11	002475	立讯精密	344,547	11,869,644.15	1.98
12	600760	中航沈飞	270,916	11,427,236.88	1.91
13	600399	抚顺特钢	1,173,200	11,403,504.00	1.90
14	002179	中航光电	274,100	10,689,900.00	1.78
15	002036	联创电子	990,000	10,107,900.00	1.69
16	300122	智飞生物	160,500	9,808,155.00	1.64
17	600372	中航机载	697,935	9,198,783.30	1.54
18	832982	锦波生物	35,200	9,196,704.00	1.53
19	603505	金石资源	315,784	8,573,535.60	1.43
20	002484	江海股份	515,000	8,270,900.00	1.38
21	601890	亚星锚链	791,000	7,830,900.00	1.31
22	600237	铜峰电子	1,000,000	7,740,000.00	1.29
23	600588	用友网络	434,933	7,737,458.07	1.29
24	688777	中控技术	169,650	7,693,627.50	1.28
25	000333	美的集团	135,000	7,375,050.00	1.23

26	600085	同仁堂	134,800	7,238,760.00	1.21
27	603277	银都股份	250,000	6,705,000.00	1.12
28	603757	大元泵业	247,000	5,987,280.00	1.00
29	002011	盾安环境	399,000	5,486,250.00	0.92
30	301061	匠心家居	100,000	4,975,000.00	0.83
31	600765	中航重机	230,000	4,395,300.00	0.73
32	688563	航空材料股份	70,416	4,309,074.38	0.72
33	002675	东诚药业	230,000	4,215,900.00	0.70
34	000651	格力电器	125,000	4,021,250.00	0.67
35	002352	顺丰控股	97,000	3,918,800.00	0.65
36	688378	奥来德光电	75,000	3,550,500.00	0.59
37	600298	安琪酵母	99,956	3,516,452.08	0.59
38	688789	杭州宏华数码科技	33,730	3,369,964.30	0.56
39	300567	精测电子	37,000	3,241,940.00	0.54
40	300666	江丰电子	55,000	3,221,900.00	0.54
41	300174	元力股份	200,000	3,202,000.00	0.53
42	000888	峨眉山 A	342,833	3,061,498.69	0.51
43	688179	阿拉丁科技	154,000	2,950,640.00	0.49
44	688025	杰普特光电	30,000	2,776,500.00	0.46
45	603699	纽威股份	200,000	2,772,000.00	0.46
46	688037	芯源微电子	20,720	2,768,399.20	0.46
47	300848	美瑞新材	138,175	2,643,287.75	0.44

48	601799	星宇股份	20,000	2,622,200.00	0.44
49	603713	密尔克卫	47,300	2,516,833.00	0.42
50	601001	晋控煤业	190,000	2,342,700.00	0.39
51	601233	桐昆股份	150,000	2,269,500.00	0.38
52	002648	卫星化学	150,000	2,212,500.00	0.37
53	000683	远兴能源	368,000	2,160,160.00	0.36
54	002371	北方华创	8,700	2,137,677.00	0.36
55	688232	国泰新点软件	57,000	2,063,400.00	0.34
56	688269	西安凯立新材	49,000	1,813,490.00	0.30
57	002156	通富微电	78,000	1,803,360.00	0.30
58	603501	韦尔股份	16,845	1,797,529.95	0.30
59	300161	华中数控	50,000	1,795,000.00	0.30
60	002709	天赐材料	60,000	1,504,800.00	0.25
61	600872	中炬高新	52,000	1,461,200.00	0.24
62	601888	中国中免	17,000	1,422,730.00	0.24
63	688246	嘉和美康科技	42,000	1,403,640.00	0.23
64	603100	川仪股份	50,000	1,386,000.00	0.23
65	600256	广汇能源	170,000	1,213,800.00	0.20
66	600055	万东医疗	70,000	1,195,600.00	0.20
67	000703	恒逸石化	160,000	1,075,200.00	0.18
68	600754	锦江酒店	34,900	1,043,510.00	0.17
69	000938	紫光股份	43,600	843,660.00	0.14

70	688347	华虹半导体公司	18,835	792,200.10	0.13
71	688305	科德数控	10,000	764,500.00	0.13
72	000516	国际医学	87,000	705,570.00	0.12
73	688717	艾罗能源	10,862	604,578.92	0.10
74	688112	鼎阳科技	14,900	596,596.00	0.10
75	300451	创业慧康	87,600	573,780.00	0.10
76	000733	振华科技	9,000	529,560.00	0.09
77	301526	国际复材	97,225	527,153.41	0.09
78	688548	广钢气体股份	30,447	396,693.87	0.07
79	688392	骄成超声波	3,843	320,544.63	0.05
80	688652	京仪装备	4,157	247,131.25	0.04
81	601096	宏盛华源铁塔集团	39,171	213,323.88	0.04
82	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.03
83	301508	中机认检	4,186	140,801.39	0.02
84	688653	康希通信	6,478	127,078.12	0.02
85	301516	中远通	6,033	124,517.13	0.02
86	301568	思泰克	2,456	109,572.88	0.02
87	688720	艾森股份	1,644	97,348.14	0.02
88	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.01
89	603004	鼎龙科技	1,948	69,190.05	0.01
90	688361	中科飞测	831	61,851.33	0.01
91	688443	智翔金泰	1,309	52,294.55	0.01

92	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.01
93	001358	兴欣新材	867	41,281.92	0.01
94	688627	精智达技术	453	40,074.42	0.01
95	603231	索宝蛋白	1,610	37,546.81	0.01
96	603373	安邦护卫集团股份	876	36,981.40	0.01
97	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
98	688549	中巨芯科技	4,255	34,422.95	0.01
99	603296	华勤技术	439	34,378.35	0.01
100	688472	阿特斯阳光电力	2,692	33,999.96	0.01
101	301383	天键股份	493	32,045.00	0.01
102	301488	豪恩汽电	418	28,965.42	0.00
103	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
104	301511	德福科技	1,125	25,624.39	0.00
105	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
106	301393	昊帆生物	397	23,657.57	0.00
107	301468	博盈特焊	779	23,590.25	0.00
108	688552	航天南湖	956	22,456.44	0.00
109	301509	金凯生科	357	22,298.92	0.00
110	301172	君逸数码	576	22,075.38	0.00
111	301262	海看股份	692	21,555.80	0.00
112	688581	安杰思医学	163	20,344.03	0.00
113	301310	鑫宏业	409	19,897.85	0.00

114	301528	多浦乐	278	19,752.38	0.00
115	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
116	301510	固高科技	557	19,658.35	0.00
117	301559	中集环科	1,062	19,516.58	0.00
118	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
119	688610	埃科光电	366	18,749.72	0.00
120	301498	乖宝宠物	483	18,745.23	0.00
121	301550	斯菱股份	400	17,821.40	0.00
122	301499	维科精密	609	17,732.61	0.00
123	688562	航天软件股份	726	17,424.00	0.00
124	301456	盘古智能	561	17,111.93	0.00
125	688458	美芯晟科技	221	17,008.16	0.00
126	301525	儒竞科技	208	16,943.68	0.00
127	301397	溯联股份	362	16,355.16	0.00
128	688719	爱科赛博	259	15,833.70	0.00
129	688629	四川华丰科技	708	15,505.20	0.00
130	688334	西高院	888	15,389.04	0.00
131	301548	崇德科技	251	15,047.99	0.00
132	688535	华海诚科新材料	161	14,937.58	0.00
133	301202	朗威股份	460	14,678.82	0.00
134	301382	蜂助手	408	14,532.96	0.00
135	301251	威尔高	407	14,186.49	0.00
136	301292	海科新源	724	14,030.55	0.00
137	301261	恒工精	273	13,939.80	0.00

		密			
138	301305	朗坤环境	753	13,591.65	0.00
139	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
140	603275	上海众辰科技	329	13,168.74	0.00
141	301329	信音电子	577	12,882.64	0.00
142	688523	航天环宇科技	472	12,659.04	0.00
143	688623	双元科技	178	12,634.44	0.00
144	301519	舜禹股份	614	12,482.90	0.00
145	688716	中研股份	335	12,402.13	0.00
146	301272	英华特	229	12,276.66	0.00
147	301529	福赛科技	316	12,234.06	0.00
148	301505	苏州规划	334	12,043.14	0.00
149	688620	安凯微电子	1,016	12,009.12	0.00
150	301489	思泉新材	178	11,986.08	0.00
151	301315	威士顿	226	11,946.36	0.00
152	301225	恒勃股份	333	11,921.40	0.00
153	301320	豪江智能	642	11,857.74	0.00
154	688631	莱斯信息	336	11,844.00	0.00
155	301500	飞南资源	550	11,563.60	0.00
156	301533	威马农机	343	11,547.34	0.00
157	301469	恒达新材	343	11,397.47	0.00
158	301399	英特科技	293	11,213.11	0.00
159	301517	陕西华达	241	11,213.05	0.00

160	688573	信宇人	379	11,009.20	0.00
161	688657	浩辰软件	135	10,703.51	0.00
162	688671	碧兴物联	305	10,512.85	0.00
163	688693	锴威特	237	10,348.35	0.00
164	301376	致欧科技	420	10,046.40	0.00
165	301337	亚华电子	318	9,733.98	0.00
166	603062	麦加芯彩	158	9,282.14	0.00
167	301428	世纪恒通	229	8,850.85	0.00
168	301355	南王科技	563	8,529.45	0.00
169	688484	南芯科技	213	8,488.05	0.00
170	301232	飞沃科技	165	8,000.85	0.00
171	300804	广康生化	257	7,931.02	0.00
172	688479	用友汽车信息科技	332	7,742.24	0.00
173	301293	三博脑科	124	7,740.08	0.00
174	301170	锡南科技	250	7,607.50	0.00
175	603075	热威科技股份	312	7,397.52	0.00
176	688450	光格科技	201	7,336.06	0.00
177	603270	金帝精密科技股份	243	7,241.70	0.00
178	603193	润本生物技术股份	422	7,211.40	0.00
179	603276	恒兴新材料科技	236	6,018.56	0.00
180	001380	华纬科技	170	5,922.80	0.00

181	688507	索辰科技	42	5,743.50	0.00
182	603273	天元智能	272	5,732.30	0.00
183	301307	美利信	165	5,723.85	0.00
184	301358	湖南裕能	160	5,432.00	0.00
185	301301	川宁生物	540	4,536.00	0.00
186	688352	颀中科技	293	4,515.13	0.00
187	301281	科源制药	128	4,357.12	0.00
188	301157	华塑科技	98	4,194.40	0.00
189	301260	格力博	240	4,171.20	0.00
190	001286	陕西能源	467	3,992.85	0.00
191	001282	三联锻造	105	3,797.85	0.00
192	301360	荣旗科技	40	3,744.00	0.00
193	688146	中船派瑞特气	100	3,401.00	0.00
194	301267	华厦眼科	102	3,273.18	0.00
195	301345	涛涛车业	52	3,166.80	0.00
196	001287	中电港	150	3,124.50	0.00
197	603125	江苏常青树科技	96	2,881.92	0.00
198	603135	中重科技	173	2,830.28	0.00
199	601061	中信金属	367	2,829.57	0.00
200	301398	星源卓镁	49	2,415.21	0.00
201	601065	江西省盐业集团	198	2,265.12	0.00
202	301049	超越科技	96	2,223.36	0.00

203	001367	海森药业	49	2,154.04	0.00
204	301373	凌玮科技	64	1,897.60	0.00
205	301317	鑫磊股份	94	1,848.04	0.00
206	688433	华曙高科	56	1,750.00	0.00
207	601133	柏诚系统股份公司	132	1,738.44	0.00
208	301203	国泰环保	43	1,671.84	0.00
209	603137	恒尚节能	82	1,608.84	0.00
210	001311	多利科技	29	1,435.79	0.00
211	001328	登康口腔	45	1,273.95	0.00
212	301439	泓淋电力	86	1,257.32	0.00
213	001360	南矿集团	62	1,078.18	0.00
214	301263	泰恩康	48	783.84	0.00
215	688485	九州一轨环科	35	489.30	0.00
216	300996	普联软件	20	458.00	0.00
217	001331	胜通能源	19	331.74	0.00
218	688410	山外山血液净化	6	175.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002068	黑猫股份	23,740,002.04	2.95
2	300848	美瑞新材	13,546,904.00	1.68
3	601318	中国平安	12,740,863.00	1.58

4	688777	中控技术	11,424,381.78	1.42
5	600372	中航机载	11,319,000.00	1.41
6	002036	联创电子	10,715,385.00	1.33
7	002155	湖南黄金	9,246,388.00	1.15
8	002484	江海股份	9,155,106.62	1.14
9	300170	汉得信息	8,674,187.09	1.08
10	603859	能科科技	8,438,245.00	1.05
11	600760	中航沈飞	8,427,425.00	1.05
12	600237	铜峰电子	7,722,548.00	0.96
13	603757	大元泵业	7,594,785.00	0.94
14	603868	飞科电器	7,312,663.25	0.91
15	000858	五 粮 液	7,255,877.00	0.90
16	600085	同仁堂	6,692,245.00	0.83
17	600765	中航重机	5,990,112.00	0.74
18	603277	银都股份	5,989,108.00	0.74
19	832982	锦波生物	5,567,890.04	0.69
20	000888	峨眉山Ａ	5,402,304.00	0.67

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	33,028,922.00	4.11
2	600519	贵州茅台	18,291,612.00	2.27
3	300470	中密控股	14,187,062.00	1.76
4	002013	中航机电	11,319,000.00	1.41
5	601318	中国平安	9,431,581.00	1.17
6	603859	能科科技	9,300,441.00	1.16
7	600036	招商银行	9,230,511.60	1.15
8	300274	阳光电源	9,131,822.00	1.14
9	000733	振华科技	9,068,839.00	1.13
10	002484	江海股份	9,051,848.00	1.13
11	603866	桃李面包	8,602,398.00	1.07
12	002714	牧原股份	8,570,788.25	1.07
13	688053	思科瑞微电子	7,887,023.69	0.98
14	002155	湖南黄金	7,528,722.32	0.94
15	300848	美瑞新材	7,434,961.50	0.92
16	603868	飞科电器	6,413,358.05	0.80
17	300170	汉得信息	6,346,509.00	0.79

18	603259	药明康德	5,877,617.00	0.73
19	688281	华秦科技实业	5,877,601.48	0.73
20	002352	顺丰控股	5,746,562.00	0.71

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	363,790,460.19
卖出股票收入（成交）总额	362,554,476.62

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,428,257.53	0.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	11,341,630.15	1.89
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	16,769,887.68	2.80

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127045	牧原转债	99,995	11,341,630.15	1.89
2	019709	23 国债 16	54,000	5,428,257.53	0.91

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，泸州老窖股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	41,562.41
2	应收清算款	4,094,454.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	200,110.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,336,127.69

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127045	牧原转债	11,341,630.15	1.89

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
汇添富国企创新增长股票 A	37,819	9,300.11	65,629,090.21	18.66	286,091,691.88	81.34
汇添富国企创新增长股票 C	50	58,034.70	2,725,321.92	93.92	176,413.03	6.08
汇添	12	258,787.60	3,045,990.16	98.09	59,461.02	1.91

富国企创新增长股票 D						
合计	37,881	9,443.47	71,400,402.29	19.96	286,327,565.93	80.04

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富国企创新增长股票 A	2,538,199.81	0.72
	汇添富国企创新增长股票 C	244.26	0.01
	汇添富国企创新增长股票 D	244.26	0.01
	合计	2,538,688.33	0.71

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富国企创新增长股票 A	>100
	汇添富国企创新增长股票 C	0
	汇添富国企创新增长股票 D	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富国企创新增长股票 A	0~10
	汇添富国企创新增长股票 C	0
	汇添富国企创新增长股票 D	0
	合计	0~10

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富国企创新增长股票 A	汇添富国企创新增长股票 C	汇添富国企创新增长股票 D
基金合同生效日（2015 年 07 月 10 日）基金份额总额	3,104,408,914.03	-	-
本报告期期初基金份额总额	409,558,503.17	11,327,111.77	454,563.23
本报告期基金总申购份额	78,288,343.35	1,014,501.45	4,578,569.01
减：本报告期基金总赎回份额	136,126,064.43	9,439,878.27	1,927,681.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	351,720,782.09	2,901,734.95	3,105,451.18

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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2015 年 07 月 10 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 70,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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况。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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（%）	
银河证券	2	118,071,518.36	17.27	85,263.23	17.23	
中信建投证券	1	58,370,808.26	8.54	42,122.61	8.51	
中泰证券	2	49,546,361.57	7.25	35,765.01	7.23	
国泰君安	2	45,949,284.45	6.72	33,210.39	6.71	
国投证券	2	45,126,422.28	6.60	32,567.99	6.58	
招商证券	2	43,647,167.92	6.39	31,956.27	6.46	
长江证券	1	39,930,557.32	5.84	28,891.45	5.84	
西部证券	1	36,517,343.37	5.34	26,420.81	5.34	
德邦证券	1	34,566,399.52	5.06	24,933.05	5.04	
方正证券	2	27,349,723.22	4.00	19,898.76	4.02	
信达证券	1	26,140,514.35	3.82	18,951.34	3.83	

东北证券	2	23,683,078.65	3.46	17,206.66	3.48	
瑞银证券	1	22,863,089.21	3.34	16,491.45	3.33	
华泰证券	1	22,835,370.08	3.34	16,471.34	3.33	
国元证券	1	14,433,439.24	2.11	10,446.18	2.11	
东方证券	3	12,200,794.97	1.79	7,373.11	1.49	
高盛中国	1	12,192,654.00	1.78	8,794.53	1.78	
中信证券	2	10,430,143.50	1.53	7,523.07	1.52	
平安证券	1	9,177,520.18	1.34	6,619.78	1.34	
兴业证券	2	9,164,876.00	1.34	6,693.40	1.35	
东方财富	2	5,811,203.40	0.85	4,254.78	0.86	
上海证券	1	5,029,900.25	0.74	4,747.46	0.96	
西南证券	2	4,083,126.87	0.60	2,945.16	0.60	
国联证券	1	3,733,932.84	0.55	3,494.62	0.71	
浙商证券	1	2,661,545.00	0.39	1,919.80	0.39	
渤海证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
诚通证券	1	-	-	-	-	
第一创业证券	1	-	-	-	-	
光大证券	1	-	-	-	-	
海通证券	1	-	-	-	-	
申万宏源证券	2	-	-	-	-	
首创证券	2	-	-	-	-	

中金公司	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。

11.7.2 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（%）
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	5,387,040.00	100.00	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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）。

11.8 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关于提高汇添富国企创新增长股票型证券投资基金 D 类份额净值精度的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 22 日

4	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
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 08 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新法律文件	上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 08 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 13 日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 19 日
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第二季度报告	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 07 月 21 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 07 月 29 日
12	关于汇添富基金管理股份有限公司运用固有资金投资旗下基金的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 08 月 21 日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年中期报告	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 08 月 31 日
14	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与南京途牛基金销售有限公司合作关系的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 04 日
15	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与凤凰金信（海口）基金销售有限公司合作关系的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 09 月 12 日
16	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第三季度报告	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 10 月 25 日

17	关于汇添富运用固有资金投资旗下基金的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 09 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富国企创新增长股票型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富国企创新增长股票型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富国企创新增长股票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、报告期内汇添富国企创新增长股票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。

13.2 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

13.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2024 年 03 月 29 日