

汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金
2024 年中期报告
2024 年 06 月 30 日

基金管理人:汇泉基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2024 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注	49

§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	汇泉匠心智选一年持有混合	
基金主代码	016091	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 09 月 13 日	
基金管理人	汇泉基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	169,213,491.59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇泉匠心智选一年持有混合 A	汇泉匠心智选一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	016091	016092
报告期末下属分级基金的份额总额	146,951,128.57 份	22,262,363.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制投资组合风险的前提下，依托基金管理人的研究平台和研究能力，通过对不同资产类别的动态配置和个股精选，追求超越基金业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括： 1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、股票期权投资策略；8、国债期货投资策略；9、参与融资业务的投资策略
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+一年期定期存款利率（税后）*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇泉基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	寻卫国
	联系电话	010-81925263
	电子邮箱	xunwg@springsfund.com
客户服务电话	400-001-5252、010-81925252	95599
传真	010-81925299	010-68121816
注册地址	北京市通州区贡院街 1 号院 1 号楼二层 206-40 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100044	100031
法定代表人	梁永强	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.springsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇泉基金管理有限公司	北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层

§ 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（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）	
	汇泉匠心智选一年持有混合 A	汇泉匠心智选一年持有混合 C
本期已实现收益	-9,045,859.04	-1,415,775.68
本期利润	-4,048,638.40	-664,404.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0259	-0.0283
本期加权平均净值利润率	-3.15%	-3.48%
本期基金份额净值增长率	-3.01%	-3.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-27,772,245.75	-4,401,041.00
期末可供分配基金份额利润	-0.1890	-0.1977
期末基金资产净值	119,178,882.82	17,861,322.02
期末基金份额净值	0.8110	0.8023
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-18.90%	-19.77%

注：1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、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；

3、期末可供分配利润，为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

汇泉匠心智选一年持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.62%	0.64%	-2.90%	0.39%	-0.72%	0.25%
过去三个月	-2.73%	0.82%	-1.23%	0.60%	-1.50%	0.22%
过去六个月	-3.01%	1.12%	-0.19%	0.75%	-2.82%	0.37%

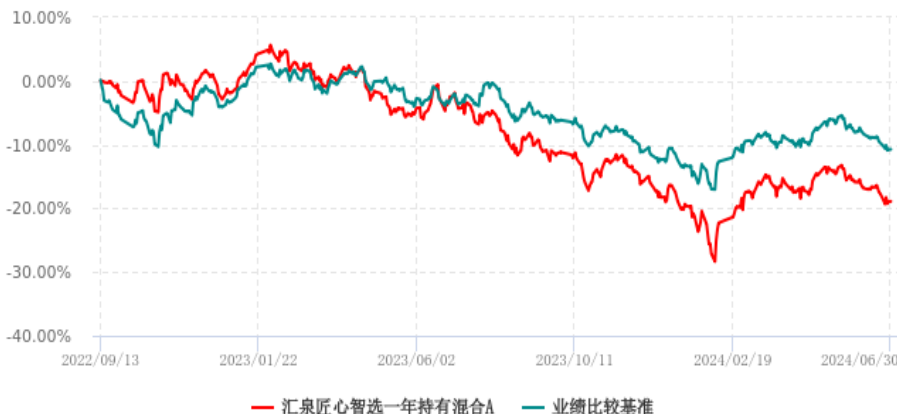
过去一年	-16.87%	0.98%	-7.93%	0.69%	-8.94%	0.29%
自基金合同生效起至今	-18.90%	0.90%	-10.72%	0.71%	-8.18%	0.19%

汇泉匠心智选一年持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.66%	0.64%	-2.90%	0.39%	-0.76%	0.25%
过去三个月	-2.88%	0.82%	-1.23%	0.60%	-1.65%	0.22%
过去六个月	-3.30%	1.12%	-0.19%	0.75%	-3.11%	0.37%
过去一年	-17.37%	0.98%	-7.93%	0.69%	-9.44%	0.29%
自基金合同生效起至今	-19.77%	0.90%	-10.72%	0.71%	-9.05%	0.19%

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

汇泉匠心智选一年持有混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年09月13日-2024年06月30日)



汇泉匠心智选一年持有混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年09月13日-2024年06月30日)



§ 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

汇泉基金管理有限公司（以下简称“我公司”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2020】1028 号文批准，于 2020 年 6 月 15 日在北京市注册成立，注册资本 1 亿元人民币。并于 2020 年 12 月 21 日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。我公司目前股东及其出资比例：杨宇先生 55.30%，梁永强先生 30.00%，北京溪泉企业管理中心（有限合伙）4.90%，上海澹泉企业管理中心（有限合伙）4.90%，上海沛泉企业管理中心（有限合伙）4.90%。

截至本报告期末，我公司共管理 8 只公募基金，具体包括汇泉策略优选混合型证券投资基金、汇泉臻心致远混合型证券投资基金、汇泉兴至未来一年持有期混合型证券投资基金、汇泉安盈回报债券型证券投资基金、汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金、汇泉启元未来混合型发起式证券投资基金、汇泉中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、汇泉安阳纯债债券型证券投资基金。

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	说明
		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金的基金经理	2022-09-13	-	26 年	中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任万家（天同）基金管理有限公司投资管理部总经理，金贝塔网络金融科技（深圳）有限公司联席 CEO，嘉实基金管理有限公司董事总经理、指数及量化首席投资官、基金经理。现任汇泉基金管理有限公司基金经理。
沈鑫	本基金的基金经理助理	2024-01-08	-	8 年	中国国籍，博士研究生，具有基金从业资格。曾任华西证券股份有限公司固定收益研究员、中国国际期货有限公司权益研究员、大家资产管理有限公司量化研究员。现任汇泉基金管理有限公司量化投资部副总监、基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基

金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司于每季度、每年度对旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率进行分析，对连续四个季度期间内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内、10 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现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。

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

2024 年上半年，制造业 PMI 数据大部分时间处于荣枯线下方，CPI 同比微正，但 PPI 同比仍为负数。北上资金净流入 386 亿元，主要集中在沪市。离岸人民币贬值 2.17%。A 股、港股经历较大幅度震荡。海外方面，美股表现亮眼，美国或在年内降息。

2024 年上半年，中证 100 下跌 0.04%，沪深 300 下跌 0.99%，中证 500 下跌 10.86%，中证 1000 下跌 19.48%，中证 2000 下跌 24.98%，大盘股优于小盘股；国证成长下跌 10.34%，国证价值上涨 9.26%，价值股优于成长股。从行业来看，银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业、有色金属、交通运输、通信、汽车、建筑表现较好，纺织服装、综合金融、轻工制造、房地产、医药、传媒、商贸零售、计算机、消费者服务的综合表现较弱。

从 2024 年上半年偏股基金整体表现来看，中证偏股基金指数下跌 7.77%，逊于以中证 100 及沪深 300 为代表的大盘指数，优于中证 500、中证 1000、中证 2000 等中小盘指数，基金赚钱效应不佳。

报告期间，产品一直坚持按照系统化主动投资的思路运作：在行业配置层面，以偏股混合基金

行业配置水平为中枢，根据行业配置模型，采取有限偏离，严格控制行业错配风险；在个股选择层面，通过多因子模型进行股票优选；在组合优化层面，根据风险偏好，在控制风险暴露的前提下，寻求超额收益与风险之间的最优化平衡。

本基金管理人将继续坚持系统化主动投资的运作思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有长期竞争力的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇泉匠心智选一年持有混合 A 基金份额净值为 0.8110 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.01%，同期业绩比较基准收益率为-0.19%；截至报告期末汇泉匠心智选一年持有混合 C 基金份额净值为 0.8023 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.30%，同期业绩比较基准收益率为-0.19%。

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 年下半年，无论是从赔率或是胜率的视角，股票市场已大概率接近底部。虽然很难精准预测权益资产溢价何时回归，但方向较为明确。随着我国政策持续的助力，以及海外流动性的逐步宽松，需严密关注股票市场随时可能发生的风格切换。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人设有估值委员会，负责对估值政策和程序进行定期评价和适时调整，指导和监督估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备基金估值运作、行业研究、风险管理和法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理参与估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇泉基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,404,747.97	3,569,092.35
结算备付金		350,080.10	11,262,990.88
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	126,655,013.21	145,147,650.65
其中：股票投资		119,037,900.20	137,501,932.84
基金投资		-	-
债券投资		7,617,113.01	7,645,717.81
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	-	7,300.00

买入返售金融资产	6.4.7.4	8,000,008.00	-
应收清算款		-	91,924.39
应收股利		47,773.04	960.00
应收申购款		1,182.26	1,684.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		137,458,804.58	160,081,603.14
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		158,509.81	261,665.65
应付管理人报酬		139,081.86	164,692.44
应付托管费		23,180.32	27,448.74
应付销售服务费		9,040.17	10,815.85
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	6.4.7.6	88,787.58	214,073.62
负债合计		418,599.74	678,696.30
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	169,213,491.59	190,812,796.11
未分配利润	6.4.7.8	-32,173,286.75	-31,409,889.27
净资产合计		137,040,204.84	159,402,906.84
负债和净资产总计		137,458,804.58	160,081,603.14

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 169,213,491.59 份。其中汇泉匠心智选一年持有混合 A 基金份额净值 0.8110 元，基金份额总额 146,951,128.57 份；汇泉匠心智选一年持有混合 C 基金份额净值 0.8023 元，基金份额总额 22,262,363.02 份。

6.2 利润表

会计主体：汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
-----	-----	---	--

一、营业总收入		-3,540,838.63	440,081.40
1. 利息收入		76,352.75	145,234.40
其中：存款利息收入	6.4.7.9	75,124.76	145,234.40
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,227.99	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,365,782.92	-4,531,025.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-10,899,268.28	-5,540,074.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	72,100.78	92,585.80
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	3,989.17	-961,951.74
股利收益	6.4.7.15	1,457,395.41	1,878,414.56
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,748,591.54	4,825,872.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、营业总支出		1,172,204.55	2,198,046.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	879,193.68	1,729,191.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	146,532.22	288,198.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	57,005.85	93,637.88
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. 税金及附加		58.24	-
8. 其他费用	6.4.7.18	89,414.56	87,017.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,713,043.18	-1,757,964.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,713,043.18	-1,757,964.70
五、其他综合收益的税		-	-

后净额			
六、综合收益总额		-4,713,043.18	-1,757,964.70

6.3 净资产变动表

会计主体：汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	190,812,796.11	-31,409,889.27	159,402,906.84
二、本期期初净资产	190,812,796.11	-31,409,889.27	159,402,906.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,599,304.52	-763,397.48	-22,362,702.00
（一）、综合收益总额	-	-4,713,043.18	-4,713,043.18
（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）	-21,599,304.52	3,949,645.70	-17,649,658.82
其中：1. 基金申购款	345,968.44	-73,864.92	272,103.52
2. 基金赎回款	-21,945,272.96	4,023,510.62	-17,921,762.34
（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	169,213,491.59	-32,173,286.75	137,040,204.84
项目	上年度可比期间 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	228,625,087.88	-4,181,814.88	224,443,273.00
二、本期期初净资产	228,625,087.88	-4,181,814.88	224,443,273.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,073,976.11	-1,799,887.44	8,274,088.67
（一）、综合收益总额	-	-1,757,964.70	-1,757,964.70
（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）	10,073,976.11	-41,922.74	10,032,053.37
其中：1. 基金申购款	10,073,976.11	-41,922.74	10,032,053.37
2. 基金赎回款	-	-	-
（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	238,699,063.99	-5,981,702.32	232,717,361.67

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：

梁永强

陈磊

武翌

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

汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2022]1169号《关于准予汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册,由汇泉基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 228,444,852.09 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0760 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 9 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 228,565,471.68 份基金份额,其中认购资金利息折合 120,619.59 份基金份额。本基金的基金管理人为汇泉基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金对于每份基金份额设定一年(一年按 365 天计算)最短持有期限,投资者认购或申购、转换转入基金份额后,自基金合同生效日或申购、转换转入确认日起一年内不得赎回或转换转出。

根据《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》,本基金将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,并不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码,分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票(包括沪港通股票及深港通股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资

范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%(其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的 0%-50%)。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%，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。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+一年期定期存款利率(税后)×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年中期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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《财

第16页，共53页

政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2014]81号《财政部、国家税务总局、证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2016]36号《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部、国家税务总局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》、财税[2016]70号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部、国家税务总局、证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《财政部、国家税务总局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》、财税[2017]2号《财政部、国家税务总局关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《财政部、税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《财政部、税务总局关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	73,705.65
等于：本金	73,677.06
加：应计利息	28.59
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	2,331,042.32
等于：本金	2,330,361.63
加：应计利息	680.69
减：坏账准备	-
合计	2,404,747.97

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	125,982,286.77	-	119,037,900.20	-6,944,386.57	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	7,489,922.90	115,613.01	7,617,113.01	11,577.10
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,489,922.90	115,613.01	7,617,113.01	11,577.10

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	133,472,209.67	115,613.01	126,655,013.21	-6,932,809.47

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,000,008.00	-
银行间市场	-	-
合计	8,000,008.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	87,021.48
其他应付	1,766.10
合计	88,787.58

6.4.7.7 实收基金

汇泉匠心智选一年持有混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	165,799,507.75	165,799,507.75
本期申购	333,724.72	333,724.72
本期赎回（以“-”号填列）	-19,182,103.90	-19,182,103.90
本期末	146,951,128.57	146,951,128.57

汇泉匠心智选一年持有混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,013,288.36	25,013,288.36
本期申购	12,243.72	12,243.72
本期赎回（以“-”号填列）	-2,763,169.06	-2,763,169.06
本期末	22,262,363.02	22,262,363.02

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

汇泉匠心智选一年持有混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-18,301,684.56	-8,849,443.68	-27,151,128.24
本期期初	-18,301,684.56	-8,849,443.68	-27,151,128.24
本期利润	-9,045,859.04	4,997,220.64	-4,048,638.40
本期基金份额交易产生的变动数	3,011,903.94	415,616.95	3,427,520.89
其中：基金申购款	-52,851.82	-18,687.60	-71,539.42
基金赎回款	3,064,755.76	434,304.55	3,499,060.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,335,639.66	-3,436,606.09	-27,772,245.75

汇泉匠心智选一年持有混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,930,875.52	-1,327,885.51	-4,258,761.03
本期期初	-2,930,875.52	-1,327,885.51	-4,258,761.03
本期利润	-1,415,775.68	751,370.90	-664,404.78
本期基金份额交易产生的变动数	464,483.63	57,641.18	522,124.81
其中：基金申购款	-2,193.75	-131.75	-2,325.50
基金赎回款	466,677.38	57,772.93	524,450.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,882,167.57	-518,873.43	-4,401,041.00

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	654.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,995.18
结算备付金利息收入	65,474.78
其他	-
合计	75,124.76

注：其他存款利息收入所列金额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	347,648,350.82
减：卖出股票成本总额	357,830,010.56
减：交易费用	717,608.54
买卖股票差价收入	-10,899,268.28

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	63,062.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,038.09
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	72,100.78

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,627,500.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,379,092.17
减：应计利息总额	239,094.57
减：交易费用	275.95
买卖债券差价收入	9,038.09

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
个股期权投资收益	16,661.00
股指期货投资收益	-8,840.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	485.27
减：交易费用	3,346.56
合计	3,989.17

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,457,395.41
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	1,457,395.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,738,751.54
——股票投资	5,731,674.44
——债券投资	7,077.10
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	9,840.00
——权证投资	-
——期权投资	9,840.00
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	5,748,591.54

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,703.50
其他	400.00
证券组合费	289.58
合计	89,414.56

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
汇泉基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
杨宇	基金管理人股东
梁永强	基金管理人股东
上海沛泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海澹泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
北京溪泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东

注：下述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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	879,193.68	1,729,191.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	438,500.29	858,541.99
应支付基金管理人的净管理费	440,693.39	870,649.80

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 27 日，支付基金管理人汇泉基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

根据《汇泉基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，支付基金管理人汇泉基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	146,532.22	288,198.61

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 27 日，支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

根据《汇泉基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇泉匠心智选一年持有混合 A	汇泉匠心智选一年持有混合 C	合计
汇泉基金管理有限公司	-	30.24	30.24
农业银行	-	42,958.56	42,958.56
合计	-	42,988.80	42,988.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇泉匠心智选一年持有混合 A	汇泉匠心智选一年持有混合 C	合计
汇泉基金管理有限公司	-	20.30	20.30
农业银行	-	64,942.20	64,942.20
合计	-	64,962.50	64,962.50

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇泉基金管理有限公司，再由汇泉基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

汇泉匠心智选一年持有混合 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
杨宇	98.84	0.00007%	98.84	0.00006%

汇泉匠心智选一年持有混合 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
杨宇	1,000,333.33	4.49%	1,000,333.33	4.00%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书的规定费率执行。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	73,705.65	654.80	491,717.55	6,375.48

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024 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

无。

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
000413	东旭光电	2024-05-06	重大事项	1.43	2024-07-09	1.36	88,900	155,517.38	127,127.00	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金是混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导合规风控工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人农业银行，其他存款存放于恒泰证券股份有限公司、国新证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,617,113.01	7,645,717.81
合计	7,617,113.01	7,645,717.81

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于锁定期届满后要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下

以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人自基金合同生效日满一年起对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.09%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2024 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 136,773,415.09 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及

对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金和债券投资。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,404,747.97	-	-	-	2,404,747.97
结算备付金	67,839.30	-	-	282,240.80	350,080.10
交易性金融资产	7,617,113.01	-	-	119,037,900.20	126,655,013.21
买入返售金融资产	8,000,008.00	-	-	-	8,000,008.00
应收股利	-	-	-	47,773.04	47,773.04
应收申购款	-	-	-	1,182.26	1,182.26
资产总计	18,089,708.28	-	-	119,369,096.30	137,458,804.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	158,509.81	158,509.81
应付管理人报酬	-	-	-	139,081.86	139,081.86
应付托管费	-	-	-	23,180.32	23,180.32
应付销售服务费	-	-	-	9,040.17	9,040.17

其他负债	-	-	-	88,787.58	88,787.58
负债总计	-	-	-	418,599.74	418,599.74
利率敏感度缺口	18,089,708.28	-	-	118,950,496.56	137,040,204.84
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,569,092.35	-	-	-	3,569,092.35
结算备付金	9,011,251.08	-	-	2,251,739.80	11,262,990.88
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	7,645,717.81	-	-	137,501,932.84	145,147,650.65
应收清算款	-	-	-	91,924.39	91,924.39
应收股利	-	-	-	960.00	960.00
应收申购款	-	-	-	1,684.87	1,684.87
衍生金融资产	-	-	-	7,300.00	7,300.00
资产总计	20,226,061.24	-	-	139,855,541.90	160,081,603.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	261,665.65	261,665.65
应付管理人报酬	-	-	-	164,692.44	164,692.44
应付托管费	-	-	-	27,448.74	27,448.74
应付销售服务费	-	-	-	10,815.85	10,815.85
其他负债	-	-	-	214,073.62	214,073.62
负债总计	-	-	-	678,696.30	678,696.30
利率敏感度缺口	20,226,061.24	-	-	139,176,845.60	159,402,906.84

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1. 市场利率上升 25 个基点	-1,389.20	-
	2. 市场利率下降 25 个基点	1,391.04	-

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金净资产的比例为 4.80%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本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 2024 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				
交易性金融资产	-	7,721,049.19	-	7,721,049.19
应收股利	-	47,773.04	-	47,773.04
资产合计	-	7,768,822.23	-	7,768,822.23
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,768,822.23	-	7,768,822.23
项目	上年度末 2023 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
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	7,245,564.21	-	7,245,564.21
应收股利	-	960.00	-	960.00
资产合计	-	7,246,524.21	-	7,246,524.21
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,246,524.21	-	7,246,524.21

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	388,441.11	362,326.21
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-388,441.11	-362,326.21	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定

期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%(其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的 0%-50%)。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	119,037,900.20	86.86	137,501,932.84	86.261
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	7,300.00	0.005
合计	119,037,900.20	86.86	137,509,232.84	86.266

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1. 中证 800 指数收益率上升 5%		7,123,058.11
2. 中证 800 指数收益率下降 5%		-7,123,058.11	-7,101,964.37

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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	118,910,773.20	137,509,232.84
第二层次	7,744,240.01	7,645,717.81
第三层次	-	-
合计	126,655,013.21	145,154,950.65

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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(%)
1	权益投资	119,037,900.20	86.60
	其中：股票	119,037,900.20	86.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,617,113.01	5.54
	其中：债券	7,617,113.01	5.54
	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	8,000,008.00	5.82
	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	2,754,828.07	2.00
8	其他各项资产	48,955.30	0.04
9	合计	137,458,804.58	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 7,721,049.19 元，占净值比例 5.63%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,321,505.00	0.96
B	采矿业	6,603,306.00	4.82
C	制造业	77,574,091.60	56.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,337,891.00	3.17
E	建筑业	982,441.00	0.72
F	批发和零售业	1,021,466.00	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	2,571,377.00	1.88
H	住宿和餐饮业	217,857.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,111,732.41	4.46
J	金融业	5,545,251.00	4.05
K	房地产业	1,059,069.00	0.77
L	租赁和商务服务业	914,919.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	705,702.00	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	779,388.00	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	148,885.00	0.11
Q	卫生和社会工作	635,944.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	786,026.00	0.57
S	综合	-	-
	合计	111,316,851.01	81.23

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
原材料	958,788.59	0.70
非日常生活消费品	2,176,700.73	1.59
日常消费品	191,662.80	0.14
金融	735,985.15	0.54

医疗保健	142,651.88	0.10
信息技术	359,568.54	0.26
通讯业务	2,398,605.18	1.75
房地产	757,086.32	0.55
合计	7,721,049.19	5.63

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,900	2,788,041.00	2.03
2	300750	宁德时代	12,560	2,261,176.80	1.65
3	00700	腾讯控股	5,000	1,699,410.16	1.24
4	002463	沪电股份	43,600	1,591,400.00	1.16
5	000333	美的集团	24,600	1,586,700.00	1.16
6	300308	中际旭创	10,220	1,409,133.60	1.03
7	000858	五粮液	10,900	1,395,636.00	1.02
8	002371	北方华创	3,900	1,247,571.00	0.91
9	601899	紫金矿业	43,400	762,538.00	0.56
9	02899	紫金矿业	24,000	360,983.19	0.26
10	03690	美团-W	10,850	1,100,176.42	0.80
11	300760	迈瑞医疗	3,500	1,018,185.00	0.74
12	09992	泡泡玛特	28,000	977,480.28	0.71
13	601225	陕西煤业	37,900	976,683.00	0.71
14	600900	长江电力	33,200	960,144.00	0.70
15	600809	山西汾酒	4,400	927,872.00	0.68
16	300498	温氏股份	46,600	923,612.00	0.67
17	603501	韦尔股份	9,100	904,267.00	0.66
18	688012	中微公司	6,261	884,428.86	0.65
19	002595	豪迈科技	23,100	881,727.00	0.64
20	601857	中国石油	85,300	880,296.00	0.64
21	002600	领益智造	123,500	879,320.00	0.64
22	600276	恒瑞医药	22,200	853,812.00	0.62
23	002475	立讯精密	21,700	853,027.00	0.62
24	600741	华域汽车	51,900	850,122.00	0.62
25	600027	华电国际	119,800	831,412.00	0.61
26	601398	工商银行	145,500	829,350.00	0.61
27	601088	中国神华	18,600	825,282.00	0.60
28	300502	新易盛	7,400	781,070.00	0.57
29	600919	江苏银行	103,900	771,977.00	0.56
30	000975	银泰黄金	47,300	770,517.00	0.56
31	000630	铜陵有色	208,400	752,324.00	0.55

32	300679	电连技术	18,600	748,278.00	0.55
33	600406	国电南瑞	29,300	731,328.00	0.53
34	002422	科伦药业	24,000	727,920.00	0.53
35	002236	大华股份	46,800	723,528.00	0.53
36	000807	云铝股份	52,600	710,626.00	0.52
37	600941	中国移动	6,600	709,500.00	0.52
38	001309	德明利	8,100	699,840.00	0.51
39	01024	快手-W	16,600	699,195.02	0.51
40	688506	百利天恒	3,800	689,320.00	0.50
41	603160	汇顶科技	10,000	687,500.00	0.50
42	601138	工业富联	25,000	685,000.00	0.50
43	601168	西部矿业	37,800	678,510.00	0.50
44	300394	天孚通信	7,600	671,992.00	0.49
45	605333	沪光股份	23,800	662,830.00	0.48
46	300782	卓胜微	8,500	660,790.00	0.48
47	002472	双环传动	29,900	658,398.00	0.48
48	002138	顺络电子	23,900	656,294.00	0.48
49	688029	南微医学	10,600	652,536.00	0.48
50	002465	海格通信	62,800	650,608.00	0.47
51	600031	三一重工	39,200	646,800.00	0.47
52	600642	申能股份	73,200	646,356.00	0.47
53	600699	均胜电子	43,100	638,742.00	0.47
54	601058	赛轮轮胎	44,500	623,000.00	0.45
55	002139	拓邦股份	58,600	622,332.00	0.45
56	603806	福斯特	42,280	621,516.00	0.45
57	688798	艾为电子	10,949	619,932.38	0.45
58	000725	京东方 A	150,400	615,136.00	0.45
59	600879	航天电子	78,700	611,499.00	0.45
60	300896	爱美客	3,500	602,350.00	0.44
61	688469	芯联集成	152,000	601,920.00	0.44
62	601127	赛力斯	6,600	601,392.00	0.44
63	000887	中鼎股份	49,000	599,760.00	0.44
64	01818	招金矿业	50,000	597,805.40	0.44
65	600690	海尔智家	20,800	590,304.00	0.43
66	300207	欣旺达	38,900	590,113.00	0.43
67	000513	丽珠集团	15,800	587,918.00	0.43
68	601318	中国平安	14,100	583,176.00	0.43
69	002001	新和成	30,300	581,760.00	0.42
70	600436	片仔癀	2,800	580,076.00	0.42
71	300054	鼎龙股份	25,500	578,340.00	0.42
72	300015	爱尔眼科	55,800	575,856.00	0.42
73	600015	华夏银行	88,300	565,120.00	0.41
74	002245	蔚蓝锂芯	72,800	564,200.00	0.41

75	600150	中国船舶	13,800	561,798.00	0.41
76	300012	华测检测	55,200	555,312.00	0.41
77	600905	三峡能源	127,100	554,156.00	0.40
78	600309	万华化学	6,800	549,848.00	0.40
79	600369	西南证券	153,000	547,740.00	0.40
80	300857	协创数据	9,600	547,200.00	0.40
81	600535	天士力	43,200	543,456.00	0.40
82	600157	永泰能源	458,300	540,794.00	0.39
83	600109	国金证券	71,100	536,805.00	0.39
84	002517	恺英网络	55,800	532,890.00	0.39
85	688393	安必平	34,200	524,286.00	0.38
86	002414	高德红外	88,900	523,621.00	0.38
87	688510	航亚科技	28,400	522,844.00	0.38
88	002498	汉缆股份	158,500	521,465.00	0.38
89	688480	赛恩斯	18,600	518,196.00	0.38
90	688468	科美诊断	81,200	513,996.00	0.38
91	000830	鲁西化工	44,200	512,278.00	0.37
92	002158	汉钟精机	30,400	508,288.00	0.37
93	300390	天华新能	29,300	503,374.00	0.37
94	001323	慕思股份	17,400	500,598.00	0.37
95	688111	金山办公	2,200	500,500.00	0.37
96	000338	潍柴动力	30,800	500,192.00	0.36
97	688176	亚虹医药	97,000	495,670.00	0.36
98	603368	柳药集团	28,100	491,750.00	0.36
99	601975	招商南油	136,700	490,753.00	0.36
100	002692	远程股份	146,200	489,770.00	0.36
101	600965	福成股份	132,700	483,028.00	0.35
102	601865	福莱特	24,000	482,400.00	0.35
103	300217	东方电热	126,900	478,413.00	0.35
104	688062	迈威生物	16,400	474,616.00	0.35
105	603281	江瀚新材	21,000	471,450.00	0.34
106	688169	石头科技	1,200	471,120.00	0.34
107	600989	宝丰能源	26,900	466,177.00	0.34
108	02869	绿城服务	150,000	461,359.74	0.34
109	00388	香港交易所	2,000	456,705.07	0.33
110	601169	北京银行	75,900	443,256.00	0.32
111	600221	海航控股	428,100	436,662.00	0.32
112	600208	新湖中宝	274,500	433,710.00	0.32
113	000568	泸州老窖	3,000	430,470.00	0.31
114	600567	山鹰国际	284,100	426,150.00	0.31
115	600104	上汽集团	29,200	404,712.00	0.30
116	601988	中国银行	86,000	397,320.00	0.29
117	600019	宝钢股份	58,400	388,360.00	0.28

118	600008	首创环保	143,400	384,312.00	0.28
119	002352	顺丰控股	10,600	378,314.00	0.28
120	600507	方大特钢	101,000	377,740.00	0.28
121	002847	盐津铺子	8,800	376,376.00	0.27
122	002429	兆驰股份	78,100	375,661.00	0.27
123	601868	中国能建	175,100	371,212.00	0.27
124	688036	传音控股	4,760	364,330.40	0.27
125	002183	怡亚通	127,600	362,384.00	0.26
126	688516	奥特维	8,400	351,204.00	0.26
127	002497	雅化集团	39,200	349,664.00	0.26
128	601615	明阳智能	37,000	349,280.00	0.25
129	600115	中国东航	84,900	340,449.00	0.25
130	601816	京沪高铁	63,200	339,384.00	0.25
131	300274	阳光电源	5,460	338,683.80	0.25
132	600067	冠城大通	187,000	327,250.00	0.24
133	000063	中兴通讯	11,700	327,249.00	0.24
134	600887	伊利股份	12,400	320,416.00	0.23
135	601989	中国重工	64,900	319,957.00	0.23
136	300048	合康新能	69,000	319,470.00	0.23
137	600183	生益科技	15,000	315,900.00	0.23
138	002311	海大集团	6,700	315,235.00	0.23
139	002282	博深股份	48,100	307,359.00	0.22
140	300124	汇川技术	5,900	302,670.00	0.22
141	601777	力帆科技	78,500	301,440.00	0.22
142	300251	光线传媒	35,600	299,396.00	0.22
143	601877	正泰电器	15,700	299,242.00	0.22
144	601186	中国铁建	34,900	299,093.00	0.22
145	603288	海天味业	8,400	289,548.00	0.21
146	002493	荣盛石化	29,900	288,834.00	0.21
147	002648	卫星化学	15,900	285,882.00	0.21
148	000786	北新建材	9,600	284,736.00	0.21
149	300146	汤臣倍健	20,700	280,485.00	0.20
150	03958	东方证券	100,000	279,280.08	0.20
151	603999	读者传媒	58,700	277,651.00	0.20
152	600522	中天科技	17,400	275,790.00	0.20
153	002230	科大讯飞	6,300	270,585.00	0.20
154	601916	浙商银行	97,700	269,652.00	0.20
155	600873	梅花生物	26,600	266,532.00	0.19
156	600219	南山铝业	69,200	263,652.00	0.19
157	688234	天岳先进	5,600	262,752.00	0.19
158	600170	上海建工	119,600	257,140.00	0.19
159	601717	郑煤机	16,900	250,120.00	0.18
160	002027	分众传媒	41,100	249,066.00	0.18

161	002098	浔兴股份	44,300	248,966.00	0.18
162	002106	莱宝高科	22,500	245,250.00	0.18
163	600761	安徽合力	11,300	244,532.00	0.18
164	601766	中国中车	31,900	239,569.00	0.17
165	002662	京威股份	78,300	238,032.00	0.17
166	600803	新奥股份	11,400	237,120.00	0.17
167	600583	海油工程	39,600	234,036.00	0.17
168	600362	江西铜业	9,800	232,064.00	0.17
169	600132	重庆啤酒	3,800	230,660.00	0.17
170	002745	木林森	27,900	224,874.00	0.16
171	002233	塔牌集团	30,400	222,224.00	0.16
172	603605	珀莱雅	2,000	221,980.00	0.16
173	603036	如通股份	20,800	221,520.00	0.16
174	002215	诺普信	29,500	219,775.00	0.16
175	600663	陆家嘴	24,700	217,854.00	0.16
176	601825	沪农商行	32,100	215,712.00	0.16
177	600845	宝信软件	6,720	214,569.60	0.16
178	603379	三美股份	5,300	207,442.00	0.15
179	688558	国盛智科	11,200	206,976.00	0.15
180	600916	中国黄金	21,300	204,906.00	0.15
181	601728	中国电信	33,200	204,180.00	0.15
182	603369	今世缘	4,400	203,280.00	0.15
183	603893	瑞芯微	3,400	201,178.00	0.15
184	603345	安井食品	2,700	200,637.00	0.15
185	002032	苏泊尔	4,000	200,400.00	0.15
186	000795	英洛华	35,800	198,332.00	0.14
187	300628	亿联网络	5,300	194,881.00	0.14
188	600066	宇通客车	7,500	193,500.00	0.14
189	002978	安宁股份	6,900	192,234.00	0.14
190	002321	华英农业	134,400	192,192.00	0.14
191	00291	华润啤酒	8,000	191,662.80	0.14
192	000570	苏常柴 A	41,800	186,846.00	0.14
193	300033	同花顺	1,800	186,660.00	0.14
194	600033	福建高速	54,600	182,910.00	0.13
195	300097	智云股份	33,100	182,050.00	0.13
196	600258	首旅酒店	14,700	181,545.00	0.13
197	002008	大族激光	8,700	180,960.00	0.13
198	002415	海康威视	5,800	179,278.00	0.13
199	02382	舜宇光学科技	4,000	176,147.24	0.13
200	600711	盛屯矿业	47,800	175,426.00	0.13
201	000758	中色股份	34,400	174,752.00	0.13
202	601021	春秋航空	3,100	174,623.00	0.13
203	002617	露笑科技	35,500	170,400.00	0.12

204	002266	浙富控股	59,900	167,121.00	0.12
205	600988	赤峰黄金	10,100	165,034.00	0.12
206	000651	格力电器	4,200	164,724.00	0.12
207	603738	泰晶科技	12,000	163,680.00	0.12
208	600300	维维股份	68,100	163,440.00	0.12
209	603338	浙江鼎力	2,700	163,134.00	0.12
210	603019	中科曙光	3,900	161,850.00	0.12
211	600566	济川药业	5,100	161,721.00	0.12
212	600354	敦煌种业	33,500	159,795.00	0.12
213	300144	宋城演艺	19,800	158,994.00	0.12
214	000582	北部湾港	21,200	157,728.00	0.12
215	002301	齐心集团	31,500	152,145.00	0.11
216	002984	森麒麟	6,300	151,767.00	0.11
217	300454	深信服	2,800	141,484.00	0.10
218	300005	探路者	28,100	140,781.00	0.10
219	300017	网宿科技	17,800	140,620.00	0.10
220	600028	中国石化	21,800	137,776.00	0.10
221	601888	中国中免	2,100	131,229.00	0.10
222	688255	凯尔达	6,400	128,320.00	0.09
223	000413	东旭光电	88,900	127,127.00	0.09
224	600059	古越龙山	15,900	126,246.00	0.09
225	601016	节能风电	40,300	120,497.00	0.09
226	000792	盐湖股份	6,900	120,405.00	0.09
227	600177	雅戈尔	16,900	120,328.00	0.09
228	000973	佛塑科技	31,600	116,604.00	0.09
229	000977	浪潮信息	3,200	116,384.00	0.08
230	03888	金山软件	5,400	111,137.04	0.08
231	600570	恒生电子	6,200	109,492.00	0.08
232	300130	新国都	6,500	108,160.00	0.08
233	603408	建霖家居	8,200	108,158.00	0.08
234	601100	恒立液压	2,300	107,134.00	0.08
235	002056	横店东磁	8,500	105,995.00	0.08
236	000783	长江证券	21,500	103,845.00	0.08
237	688188	柏楚电子	560	103,348.00	0.08
238	600261	阳光照明	37,500	101,250.00	0.07
239	06049	保利物业	3,800	100,230.52	0.07
240	600529	山东药玻	3,900	98,826.00	0.07
241	000526	学大教育	1,600	98,560.00	0.07
242	600050	中国联通	20,800	97,760.00	0.07
243	01109	华润置地	4,000	96,926.62	0.07
244	002410	广联达	10,000	95,800.00	0.07
245	300496	中科创达	2,100	95,739.00	0.07
246	601101	昊华能源	10,400	95,576.00	0.07

247	002852	道道全	13,200	95,040.00	0.07
248	02269	药明生物	9,000	94,790.94	0.07
249	002340	格林美	14,700	93,639.00	0.07
250	002543	万和电气	9,300	92,628.00	0.07
251	603077	和邦生物	56,000	92,400.00	0.07
252	000938	紫光股份	4,100	91,635.00	0.07
253	688777	中控技术	2,400	90,480.00	0.07
254	600415	小商品城	12,100	89,782.00	0.07
255	600861	北京人力	5,400	88,128.00	0.06
256	600967	内蒙一机	12,200	87,840.00	0.06
257	000997	新大陆	6,300	87,633.00	0.06
258	688018	乐鑫科技	880	86,838.40	0.06
259	002315	焦点科技	3,200	86,272.00	0.06
260	300136	信维通信	4,400	86,152.00	0.06
261	02669	中海物业	20,000	85,426.85	0.06
262	601965	中国汽研	5,000	84,450.00	0.06
263	000039	中集集团	9,100	84,266.00	0.06
264	688571	杭华股份	15,800	83,582.00	0.06
265	300840	酷特智能	8,900	82,325.00	0.06
266	600985	淮北矿业	4,900	82,026.00	0.06
267	688057	金达莱	8,200	80,442.00	0.06
268	002080	中材科技	6,000	77,400.00	0.06
269	603927	中科软	4,260	77,063.40	0.06
270	688098	申联生物	18,400	76,728.00	0.06
271	000850	华茂股份	25,000	76,000.00	0.06
272	600096	云天化	3,900	75,738.00	0.06
273	600628	新世界	13,800	74,796.00	0.05
274	300068	南都电源	8,900	73,692.00	0.05
275	600556	天下秀	20,100	73,164.00	0.05
276	600684	珠江股份	27,500	72,325.00	0.05
277	00020	商汤-W	60,000	72,284.26	0.05
278	002249	大洋电机	15,200	71,896.00	0.05
279	002763	汇洁股份	10,800	71,604.00	0.05
280	300418	昆仑万维	2,200	70,928.00	0.05
281	300253	卫宁健康	11,600	68,440.00	0.05
282	002831	裕同科技	2,600	66,534.00	0.05
283	301308	江波龙	700	66,318.00	0.05
284	300492	华图山鼎	700	65,940.00	0.05
285	300627	华测导航	2,200	65,670.00	0.05
286	688208	道通科技	2,600	62,764.00	0.05
287	300230	永利股份	18,600	62,496.00	0.05
288	300415	伊之密	3,000	62,340.00	0.05
289	600351	亚宝药业	11,100	62,271.00	0.05

290	002439	启明星辰	3,600	62,136.00	0.05
291	600640	国脉文化	6,000	62,100.00	0.05
292	301269	华大九天	800	61,640.00	0.04
293	000811	冰轮环境	6,300	60,795.00	0.04
294	002025	航天电器	1,300	60,294.00	0.04
295	301267	华夏眼科	2,900	60,088.00	0.04
296	300624	万兴科技	1,119	59,385.33	0.04
297	600588	用友网络	5,900	59,000.00	0.04
298	688083	中望软件	800	58,096.00	0.04
299	01797	东方甄选	5,000	57,590.11	0.04
300	688568	中科星图	1,200	57,240.00	0.04
301	603977	国泰集团	5,600	56,952.00	0.04
302	000034	神州数码	2,400	54,936.00	0.04
303	000895	双汇发展	2,300	54,671.00	0.04
304	002152	广电运通	5,100	53,346.00	0.04
305	000818	航锦科技	2,400	52,992.00	0.04
306	600143	金发科技	7,900	52,219.00	0.04
307	002068	黑猫股份	7,100	50,410.00	0.04
308	000012	南玻 A	10,000	50,400.00	0.04
309	600158	中体产业	6,500	49,985.00	0.04
310	600871	石化油服	28,700	49,938.00	0.04
311	000415	渤海租赁	19,200	48,960.00	0.04
312	002083	孚日股份	11,500	48,645.00	0.04
313	603321	梅轮电梯	7,100	48,493.00	0.04
314	301391	卡莱特	1,100	48,158.00	0.04
315	03347	泰格医药	1,900	47,860.94	0.03
316	002064	华峰化学	6,600	47,322.00	0.03
317	603236	移远通信	1,000	46,730.00	0.03
318	002607	中公教育	29,900	45,747.00	0.03
319	300450	先导智能	2,700	44,901.00	0.03
320	600959	江苏有线	16,900	44,616.00	0.03
321	002444	巨星科技	1,800	44,460.00	0.03
322	300972	万辰集团	2,100	44,373.00	0.03
323	003003	天元股份	5,500	43,835.00	0.03
324	300803	指南针	1,200	43,692.00	0.03
325	002063	远光软件	8,200	42,968.00	0.03
326	001206	依依股份	3,300	42,966.00	0.03
327	300451	创业慧康	12,200	42,212.00	0.03
328	300307	慈星股份	7,000	41,650.00	0.03
329	002091	江苏国泰	6,100	41,541.00	0.03
330	600352	浙江龙盛	4,800	41,232.00	0.03
331	300638	广和通	2,400	41,040.00	0.03
332	603859	能科科技	1,924	40,442.48	0.03

333	601886	江河集团	8,200	40,016.00	0.03
334	002891	中宠股份	1,900	39,653.00	0.03
335	603383	顶点软件	1,220	39,125.40	0.03
336	002538	司尔特	8,700	38,976.00	0.03
337	600603	广汇物流	7,600	38,304.00	0.03
338	002873	新天药业	4,600	38,180.00	0.03
339	600498	烽火通信	2,400	38,160.00	0.03
340	688100	威胜信息	1,000	38,150.00	0.03
341	600549	厦门钨业	2,200	37,950.00	0.03
342	002281	光迅科技	1,000	37,370.00	0.03
343	002609	捷顺科技	4,900	37,142.00	0.03
344	688095	福昕软件	800	36,648.00	0.03
345	688295	中复神鹰	1,800	36,540.00	0.03
346	001203	大中矿业	3,800	36,518.00	0.03
347	605108	同庆楼	1,700	36,312.00	0.03
348	300570	太辰光	1,100	35,926.00	0.03
349	301153	中科江南	1,260	35,607.60	0.03
350	002841	视源股份	1,200	35,436.00	0.03
351	000777	中核科技	2,300	35,144.00	0.03
352	300036	超图软件	2,500	34,900.00	0.03
353	600131	国网信通	2,000	33,740.00	0.02
354	300188	国投智能	3,000	33,330.00	0.02
355	09868	小鹏汽车-W	1,200	32,363.63	0.02
356	600009	上海机场	1,000	32,250.00	0.02
357	688023	安恒信息	800	32,008.00	0.02
358	300525	博思软件	2,500	31,750.00	0.02
359	600116	三峡水利	4,600	31,740.00	0.02
360	603268	松发股份	2,300	31,303.00	0.02
361	600784	鲁银投资	6,600	31,284.00	0.02
362	300996	普联软件	2,100	30,807.00	0.02
363	301162	国能日新	700	30,492.00	0.02
364	600705	中航产融	13,400	29,748.00	0.02
365	688031	星环科技	800	29,368.00	0.02
366	688088	虹软科技	1,000	28,860.00	0.02
367	300442	润泽科技	1,200	28,740.00	0.02
368	300559	佳发教育	3,000	28,710.00	0.02
369	300687	赛意信息	2,000	27,840.00	0.02
370	002292	奥飞娱乐	4,600	27,508.00	0.02
371	002123	梦网科技	3,700	26,011.00	0.02
372	688590	新致软件	2,000	25,800.00	0.02
373	603039	泛微网络	800	25,408.00	0.02
374	002145	中核钛白	7,700	25,256.00	0.02
375	688631	莱斯信息	400	24,808.00	0.02

376	600536	中国软件	800	23,936.00	0.02
377	000601	韶能股份	6,400	23,616.00	0.02
378	002583	海能达	5,600	22,792.00	0.02
379	002697	红旗连锁	4,900	22,687.00	0.02
380	002368	太极股份	1,000	22,550.00	0.02
381	600810	神马股份	3,600	22,320.00	0.02
382	300682	朗新集团	2,600	22,126.00	0.02
383	300620	光库科技	600	22,068.00	0.02
384	688369	致远互联	1,400	22,022.00	0.02
385	603373	安邦护卫	800	21,992.00	0.02
386	000778	新兴铸管	6,300	21,924.00	0.02
387	603613	国联股份	1,100	21,571.00	0.02
388	603322	超讯通信	800	21,208.00	0.02
389	002777	久远银海	1,400	20,986.00	0.02
390	002153	石基信息	3,600	20,628.00	0.02
391	688311	盟升电子	1,000	20,490.00	0.01
392	301589	诺瓦星云	100	19,450.00	0.01
393	300768	迪普科技	1,600	18,960.00	0.01
394	300383	光环新网	2,200	18,590.00	0.01
395	300378	鼎捷软件	1,100	17,897.00	0.01
396	000055	方大集团	5,100	17,850.00	0.01
397	688066	航天宏图	1,000	17,800.00	0.01
398	301236	软通动力	500	17,605.00	0.01
399	300548	博创科技	900	17,541.00	0.01
400	600169	太原重工	9,500	17,385.00	0.01
401	000810	创维数字	2,000	17,160.00	0.01
402	603496	恒为科技	700	17,115.00	0.01
403	605158	华达新材	2,600	16,718.00	0.01
404	002212	天融信	3,400	16,558.00	0.01
405	600938	中国海油	500	16,500.00	0.01
406	600409	三友化工	3,200	16,064.00	0.01
407	600120	浙江东方	4,700	15,698.00	0.01
408	601010	文峰股份	9,100	15,470.00	0.01
409	603155	新亚强	1,400	15,344.00	0.01
410	688159	有方科技	400	15,144.00	0.01
411	000032	深桑达 A	1,000	14,980.00	0.01
412	688618	三旺通信	592	14,817.76	0.01
413	688507	索辰科技	292	14,191.20	0.01
414	301191	菲菱科思	200	13,994.00	0.01
415	002296	辉煌科技	1,300	13,403.00	0.01
416	002803	吉宏股份	1,200	13,356.00	0.01
417	002701	奥瑞金	3,100	12,896.00	0.01
418	300563	神宇股份	500	12,725.00	0.01

419	000990	诚志股份	1,700	12,648.00	0.01
420	603299	苏盐井神	1,300	12,350.00	0.01
421	002929	润建股份	400	11,644.00	0.01
422	000936	华西股份	1,800	10,296.00	0.01
423	002887	绿茵生态	1,500	9,765.00	0.01
424	600137	浪莎股份	800	9,496.00	0.01
425	06169	宇华教育	24,000	9,090.29	0.01
426	603113	金能科技	1,500	8,205.00	0.01
427	000668	荣丰控股	1,300	7,930.00	0.01
428	002479	富春环保	2,200	7,744.00	0.01
429	002707	众信旅游	1,300	7,462.00	0.01
430	01030	新城发展	6,000	7,447.47	0.01
431	002416	爱施德	800	7,080.00	0.01
432	002144	宏达高科	800	6,720.00	0.00
433	600516	方大炭素	1,400	6,034.00	0.00
434	01755	新城悦服务	2,000	5,695.12	0.00
435	000563	陕国投 A	2,000	5,500.00	0.00
436	002659	凯文教育	1,400	4,578.00	0.00
437	300755	华致酒行	300	4,098.00	0.00
438	000906	浙商中拓	600	4,044.00	0.00
439	002555	三七互娱	300	3,915.00	0.00
440	002627	三峡旅游	800	3,864.00	0.00
441	000554	泰山石油	400	2,028.00	0.00
442	300952	恒辉安防	100	1,734.00	0.00
443	601718	际华集团	400	992.00	0.00
444	600097	开创国际	100	823.00	0.00
445	600467	好当家	500	710.00	0.00
446	002117	东港股份	100	708.00	0.00
447	600297	广汇汽车	1,000	690.00	0.00
448	000592	平潭发展	100	130.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,179,677.00	1.37
2	000333	美的集团	2,004,097.00	1.26
3	601899	紫金矿业	1,801,797.00	1.13
4	600276	恒瑞医药	1,725,865.88	1.08
5	601225	陕西煤业	1,696,481.00	1.06
6	600809	山西汾酒	1,675,251.00	1.05
7	002463	沪电股份	1,629,524.00	1.02

8	603501	韦尔股份	1,596,715.00	1.00
9	002472	双环传动	1,567,492.00	0.98
10	002475	立讯精密	1,561,448.00	0.98
11	002371	北方华创	1,552,117.00	0.97
12	300760	迈瑞医疗	1,521,723.00	0.95
13	688469	芯联集成	1,497,686.79	0.94
14	002600	领益智造	1,454,538.00	0.91
15	300003	乐普医疗	1,450,631.00	0.91
16	600919	江苏银行	1,450,474.00	0.91
17	601088	中国神华	1,449,385.00	0.91
18	600699	均胜电子	1,433,412.00	0.90
19	300274	阳光电源	1,370,179.00	0.86
20	601857	中国石油	1,356,793.00	0.85

注：本项的“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	688099	晶晨股份	2,285,365.52	1.43
2	601899	紫金矿业	2,115,683.00	1.33
3	600079	人福医药	2,084,401.00	1.31
4	300308	中际旭创	2,027,982.00	1.27
5	601607	上海医药	1,645,338.00	1.03
6	600219	南山铝业	1,605,576.00	1.01
7	300003	乐普医疗	1,541,048.00	0.97
8	000568	泸州老窖	1,536,779.00	0.96
9	002371	北方华创	1,535,206.00	0.96
10	600519	贵州茅台	1,512,497.00	0.95
11	600048	保利发展	1,511,562.00	0.95
12	002179	中航光电	1,510,374.20	0.95
13	600584	长电科技	1,498,861.00	0.94
14	000651	格力电器	1,490,711.00	0.94
15	600529	山东药玻	1,434,846.00	0.90
16	600089	特变电工	1,397,268.00	0.88
17	300009	安科生物	1,371,995.00	0.86
18	601600	中国铝业	1,361,180.00	0.85
19	600023	浙能电力	1,318,097.00	0.83
20	002049	紫光国微	1,315,891.00	0.83

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	333,634,303.48
卖出股票收入（成交）总额	347,648,350.82

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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	7,617,113.01	5.56
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,617,113.01	5.56

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019709	23 国债 16	75,000	7,617,113.01	5.56

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情

况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响较小，符合本基金合同约定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

除腾讯控股有限公司外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资腾讯控股有限公司的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	47,773.04
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,182.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,955.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)	额	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇泉匠心智选一年持有混合 A	6,256	23,489.63	242,199.85	0.16%	146,708,928.72	99.84%
汇泉匠心智选一年持有混合 C	1,078	20,651.54	550,270.82	2.47%	21,712,092.20	97.53%
合计	7,334	23,072.47	792,470.67	0.47%	168,421,020.92	99.53%

注：1、机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对下属分级份额，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇泉匠心智选一年持有混合 A	224,087.94	0.15%
	汇泉匠心智选一年持有混合 C	1,013,395.94	4.55%
	合计	1,237,483.88	0.73%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	汇泉匠心智选一年持有混合 A	10~50
	汇泉匠心智选一年持有混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	汇泉匠心智选一年持有混合 A	0~10
	汇泉匠心智选一年持有混合 C	>100
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇泉匠心智选一年持有混合 A	汇泉匠心智选一年持有混合 C
基金合同生效日（2022年09月13日）基金份额总额	197,807,741.01	30,757,730.67
本报告期期初基金份额总额	165,799,507.75	25,013,288.36
本报告期基金总申购份额	333,724.72	12,243.72
减：本报告期基金总赎回份额	19,182,103.90	2,763,169.06
本报告期基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	146,951,128.57	22,262,363.02
-------------	----------------	---------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

1. 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2. 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略无变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所无变化。

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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
恒泰证券	2	661,969,058.61	97.17%	485,698.12	97.12%	-
国新证券	2	19,313,595.69	2.83%	14,391.66	2.88%	-

注：1、本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度

有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准包括：公司基本面评价（财务情况、资信状况、经营情况）、公司券商结算模式服务评价（稳定性、及时性）等方面。根据前述标准由基金管理人考察后确定选用证券经纪商，并与其签订证券经纪服务协议。

3、交易单元变更情况

本报告期内，本基金新增国新证券交易单元 2 个。

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
恒泰证券	27,261,171.28	100.00%	26,650,000.00	100.00%	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-22
2	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-29
3	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金 2024 年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-20
4	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-26
5	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-26

§ 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超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

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、中国证监会批准汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.springsfund.com）查阅。

汇泉基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日