

汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金
2023 年中期报告
2023 年 06 月 30 日

基金管理人:汇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:2023 年 08 月 25 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 2023 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 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	8
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的真实、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(基金净值)变动表	13
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53

§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 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	238,699,063.99 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	205,965,198.91 份	32,733,865.08 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	秦一楠
	联系电话	010-81925263	010-66060069
	电子邮箱	xunwg@springsfund.com	tgxxpl@abchina.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（2023 年 01 月 01 日-2023 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	-5,601,169.31	-982,668.19
本期利润	-1,434,085.51	-323,879.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0071	-0.0102
本期加权平均净值利润率	-0.71%	-1.03%
本期基金份额净值增长率	-0.64%	-0.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-5,891,766.21	-1,087,288.06
期末可供分配基金份额利润	-0.0286	-0.0332
期末基金资产净值	200,934,817.42	31,782,544.25
期末基金份额净值	0.9756	0.9709
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-2.44%	-2.91%

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

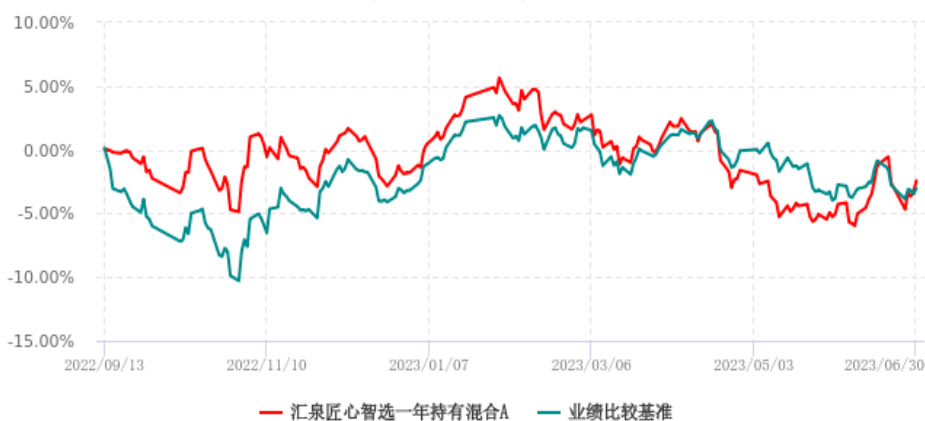
过去一个月	2.99%	1.02%	0.97%	0.65%	2.02%	0.37%
过去三个月	-3.33%	0.82%	-3.40%	0.60%	0.07%	0.22%
过去六个月	-0.64%	0.77%	0.17%	0.60%	-0.81%	0.17%
自基金合同生效起至今	-2.44%	0.79%	-3.04%	0.73%	0.60%	0.06%

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	2.93%	1.02%	0.97%	0.65%	1.96%	0.37%
过去三个月	-3.48%	0.82%	-3.40%	0.60%	-0.08%	0.22%
过去六个月	-0.95%	0.77%	0.17%	0.60%	-1.12%	0.17%
自基金合同生效起至今	-2.91%	0.79%	-3.04%	0.73%	0.13%	0.06%

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-2023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-2023年06月30日)



注：1、本基金合同于 2022 年 9 月 13 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；
2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇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 5 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。

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	-	25 年	中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任天同（万家）基金管理有限公司投资管理部总经理，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，金贝塔网络金融科技（深圳）有限公司联席 CEO。现任汇泉基金管理有限公司基金经理。

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。

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

上半年，对于经济预期的反复，很大程度上导致了市场情绪的波动。尤其是二季度，预期和库存的波动放大了需求不足的担忧，导致市场大幅回调。从当前股债反映的增长预期来看，隐含的悲观程度已接近 2022 年 10 月底的水平，近期经济体感最悲观的时刻已在过去。

上半年，上证 50 下跌 5.43%，沪深 300 下跌 0.75%，中证 500 上涨 2.29%，中证 1000 上涨 5.10%，从风格上看小盘风格更为占优。行业表现分化较大，通信、传媒、计算机、家电、机械、电子、建筑、石油石化等行业表现较好，消费者服务、综合、房地产、农林牧渔、建材、基础化工、食品饮料等行业表现较弱。上半年市场沿着 TMT 和中特估两条主线轮动。

从上半年偏股基金整体表现来看，由于传统基金重仓行业电力设备及新能源、医药、食品饮料表现不佳，中证偏股基金指数下跌 3.60%，除上证 50 指数以外，中证偏股基金指数均跑输了沪深 300、中证 500、中证 1000 等宽基指数，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。

下半年，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 0.9756 元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-0.64%,同期业绩比较基准收益率为 0.17%;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 0.9709 元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-0.95%,同期业绩比较基准收益率为 0.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,在中央政治局会议政策定调之后,在政策导向下,短期内因债务收缩带来的经济下行风险已经缓解。经济内生修复力量主要来自于短期内库存周期从底部反弹的力量,而需求刺激政策主要集中耐用消费品(汽车、家电、电子产品)以及投资方面(城中村改造、房地产政策的优化等)。从海外来看,全球制造业的 PMI 已经接近正常周期的底部,这将拉动中国制造业出口需求。当前市场对美国加息的预期已经充分计入,来自美债利率上行、汇率贬值的外部压力已经减弱。我们对下半年 A 股的市场表现更为乐观。

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一

泉基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 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：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	491,717.55	112,504.64
结算备付金		11,741,302.22	18,135,714.05
存出保证金		10,574,561.47	8,580,213.61
交易性金融资产	6.4.7.2	210,596,615.77	198,048,010.49
其中：股票投资		200,009,635.17	185,462,308.43
基金投资		-	-
债券投资		10,586,980.60	12,585,702.06
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		24,547.54	-
应收申购款		591.13	20,500.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		233,429,335.68	224,896,942.79
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		227,861.40	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		283,552.77	290,057.96
应付托管费		47,258.79	48,343.00
应付销售服务费		15,493.20	15,597.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	5,670.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	137,807.85	94,000.00
负债合计		711,974.01	453,669.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	238,699,063.99	228,625,087.88
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-5,981,702.32	-4,181,814.88
净资产合计		232,717,361.67	224,443,273.00
负债和净资产总计		233,429,335.68	224,896,942.79

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 238,699,063.99 份。其中汇泉匠心智选一年持有混合 A 基金份额净值 0.9756 元，基金份额总额 205,965,198.91 份；汇泉匠心智选一年持有混合 C 基金份额净值 0.9709 元，基金份额总额 32,733,865.08 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		440,081.40
1. 利息收入		145,234.40
其中：存款利息收入	6.4.7.9	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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,531,025.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,540,074.42
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	92,585.80
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-961,951.74
股利收益	6.4.7.15	1,878,414.56
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	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		2,198,046.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,729,191.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	288,198.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	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		-
8. 其他费用	6.4.7.18	87,017.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,757,964.70
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,757,964.70
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-1,757,964.70

6.3 净资产（基金净值）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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	228,625,087.88	-	-4,181,814.88	224,443,273.00
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	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基金净值变动数（净值减少以“-”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基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	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	武罍
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 \times 65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 \times 10%+一年期定期存款利率(税后) \times 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“企业会计第15页,共57页

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 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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。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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	491,717.55

等于：本金	491,601.06
加：应计利息	116.49
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	491,717.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	198,904,119.30	-	200,009,635.17	1,105,515.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	188,020.60	10,586,980.60	-7,666.45
	银行间市场	-	-	-
	合计	188,020.60	10,586,980.60	-7,666.45
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	209,310,745.75	188,020.60	210,596,615.77	1,097,849.42

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

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 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	182.03
其中：交易所市场	182.03
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	126,286.32
其他应付	11,339.50
合计	137,807.85

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	197,829,038.41	197,829,038.41
本期申购	8,136,160.50	8,136,160.50
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	205,965,198.91	205,965,198.91

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,796,049.47	30,796,049.47
本期申购	1,937,815.61	1,937,815.61
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	32,733,865.08	32,733,865.08

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	-344,987.89	-3,226,680.48	-3,571,668.37
本期利润	-5,601,169.31	4,167,083.80	-1,434,085.51
本期基金份额交易产生的变动数	54,390.99	-79,018.60	-24,627.61
其中：基金申购款	54,390.99	-79,018.60	-24,627.61

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,891,766.21	861,384.72	-5,030,381.49

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	-108,360.38	-501,786.13	-610,146.51
本期利润	-982,668.19	658,789.00	-323,879.19
本期基金份额交易产生的变动数	3,740.51	-21,035.64	-17,295.13
其中：基金申购款	3,740.51	-21,035.64	-17,295.13
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,087,288.06	135,967.23	-951,320.83

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	6,375.48
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	118,538.31
其他	20,320.61
合计	145,234.40

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	902,440,666.12
减：卖出股票成本总额	905,555,672.45
减：交易费用	2,425,068.09
买卖股票差价收入	-5,540,074.42

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	97,280.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,695.18
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	92,585.80

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,115,376.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,101,338.03
减：应计利息总额	18,712.44
减：交易费用	21.15
买卖债券差价收入	-4,695.18

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	本期收益金额 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-715,114.00
个股期权投资收益	-236,644.00
减：交易费用	10,193.74
合计	-961,951.74

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,878,414.56
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	1,878,414.56

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,829,232.80
——股票投资	4,805,184.77

——债券投资	24,048.03
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-3,360.00
——权证投资	-
——期货投资	-3,360.00
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	4,825,872.80

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	26,778.95
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	731.50
合计	87,017.82

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,729,191.79
其中：支付销售机构的客户维护费	858,541.99

注：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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	288,198.61

注：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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	0.00005%	98.84	0.00005%

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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	3.06%	1,000,333.33	3.25%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	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（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
300346	南大光电	2023-06-26	重大事项	34.39	2023-07-06	35.60	100	3,548.00	3,439.00	-

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、监察稽核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监察稽核部负责，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监察稽核工作。

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，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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,586,980.60	12,585,702.06
合计	10,586,980.60	12,585,702.06

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 2023 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 2023 年 06 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 0.0015%。

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 2023 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 211,085,368.96 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银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年06 月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	491,717.55	-	-	-	491,717.55
结算备付金	10,751,102.22	-	-	990,200.00	11,741,302.22
存出保证金	10,574,561.47	-	-	-	10,574,561.47
交易性金融资产	10,586,980.60	-	-	200,009,635.17	210,596,615.77
应收股利	-	-	-	24,547.54	24,547.54
应收申购款	-	-	-	591.13	591.13
资产总计	32,404,361.84	-	-	201,024,973.84	233,429,335.68
负债					
应付清算款	-	-	-	227,861.40	227,861.40
应付管理人报酬	-	-	-	283,552.77	283,552.77
应付托管费	-	-	-	47,258.79	47,258.79
应付销售服务费	-	-	-	15,493.20	15,493.20
其他负债	-	-	-	137,807.85	137,807.85
负债总计	-	-	-	711,974.01	711,974.01
利率敏感度缺口	32,404,361.84	-	-	200,312,999.83	232,717,361.67
上年度末 2022年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	112,504.64	-	-	-	112,504.64
结算备付金	18,135,714.05	-	-	-	18,135,714.05
存出保证金	8,127,852.01	-	-	452,361.60	8,580,213.61
交易性金融	12,585,702.06	-	-	185,462,308.43	198,048,010.49

资产					
应收申购款	-	-	-	20,500.00	20,500.00
资产总计	38,961,772.76	-	-	185,935,170.03	224,896,942.79
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	290,057.96	290,057.96
应付托管费	-	-	-	48,343.00	48,343.00
应付销售服务费	-	-	-	15,597.93	15,597.93
应交税费	-	-	-	5,670.90	5,670.90
其他负债	-	-	-	94,000.00	94,000.00
负债总计	-	-	-	453,669.79	453,669.79
利率敏感度缺口	38,961,772.76	-	-	185,481,500.24	224,443,273.00

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1. 市场利率上升 25 个基点	-	-16,600.63
2. 市场利率下降 25 个基点	-	16,631.92	

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净值的比例并不重大，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有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 2023 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	8,891,759.52	-	8,891,759.52

应收股利	-	24,547.54	-	24,547.54
资产合计	-	8,916,307.06	-	8,916,307.06
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	-	8,916,307.06	-	8,916,307.06
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	8,041,556.00	-	8,041,556.00
资产合计	-	8,041,556.00	-	8,041,556.00
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	-	8,041,556.00	-	8,041,556.00

6.4.13.4.2 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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	445,815.35	402,077.80
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-445,815.35	-402,077.80

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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	200,009,635.17	85.95	185,462,308.43	82.63
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	-	-	-	-
合计	200,009,635.17	85.95	185,462,308.43	82.63

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1. 中证 800 指数收益率上升 5%	9,930,497.43	7,124,789.17
2. 中证 800 指数收益率下降 5%	-9,930,497.43	-7,124,789.17	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	200,009,635.17	185,438,511.72
第二层次	10,586,980.60	12,609,498.77

第三层次	-	-
合计	210,596,615.77	198,048,010.49

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 2023 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(2022 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	200,009,635.17	85.68
	其中：股票	200,009,635.17	85.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,586,980.60	4.54
	其中：债券	10,586,980.60	4.54
	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	-	-
	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	12,233,019.77	5.24
8	其他各项资产	10,599,700.14	4.54
9	合计	233,429,335.68	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 8,891,759.52 元，占净值比例

3.82%。

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	1,757,679.00	0.76
B	采矿业	4,400,928.00	1.89
C	制造业	131,823,091.13	56.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,121,377.00	0.91
E	建筑业	6,260,294.00	2.69
F	批发和零售业	3,879,036.66	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	3,272,935.00	1.41
H	住宿和餐饮业	825,393.00	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,887,080.36	9.83
J	金融业	7,283,411.00	3.13
K	房地产业	2,783,144.00	1.20
L	租赁和商务服务业	733,142.50	0.32
M	科学研究和技术服务业	207,362.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	1,124,410.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	204,177.00	0.09
Q	卫生和社会工作	1,000,994.00	0.43
R	文化、体育和娱乐业	545,658.00	0.23
S	综合	7,763.00	0.00
	合计	191,117,875.65	82.12

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（%）
基础材料	254,466.48	0.11
非日常生活消费品	2,594,696.05	1.11
日常消费品	380,593.34	0.16
金融	1,017,865.92	0.44
医疗保健	639,987.80	0.28
工业	28,065.07	0.01
信息技术	670,085.85	0.29
电信服务	2,790,289.49	1.20
地产业	515,709.52	0.22
合计	8,891,759.52	3.82

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	2,300	3,889,300.00	1.67
2	300750	宁德时代	16,860	3,857,399.40	1.66
3	603662	柯力传感	85,000	3,128,000.00	1.34
4	603019	中科曙光	54,600	2,779,140.00	1.19
5	600633	浙数文化	168,960	2,738,841.60	1.18
6	688320	禾川科技	55,000	2,652,100.00	1.14
7	688031	星环科技	19,299	2,571,398.76	1.10
8	601989	中国重工	510,000	2,458,200.00	1.06
9	688111	金山办公	4,900	2,313,878.00	0.99
10	300503	昊志机电	110,000	2,185,700.00	0.94
11	000858	五粮液	13,100	2,142,767.00	0.92
12	03690	美团-W	18,950	2,136,767.02	0.92
13	000063	中兴通讯	43,000	1,958,220.00	0.84
14	00700	腾讯控股	5,800	1,773,225.69	0.76
15	002459	晶澳科技	42,180	1,758,906.00	0.76
16	601360	三六零	136,900	1,716,726.00	0.74
17	300394	天孚通信	15,900	1,698,597.00	0.73
18	300168	万达信息	148,400	1,681,372.00	0.72
19	600048	保利发展	126,300	1,645,689.00	0.71
20	002179	中航光电	36,040	1,634,414.00	0.70
21	002757	南兴股份	100,000	1,613,000.00	0.69
22	300760	迈瑞医疗	5,000	1,499,000.00	0.64
23	688017	绿的谐波	9,200	1,494,080.00	0.64
24	600839	四川长虹	281,600	1,422,080.00	0.61
25	002865	钧达股份	9,300	1,418,529.00	0.61
26	601012	隆基绿能	49,400	1,416,298.00	0.61
27	601390	中国中铁	180,100	1,365,158.00	0.59
28	003031	中瓷电子	10,000	1,331,200.00	0.57
29	002049	紫光国微	14,200	1,324,150.00	0.57
30	605117	德业股份	8,560	1,280,148.00	0.55
31	002304	洋河股份	9,700	1,274,095.00	0.55
32	601021	春秋航空	22,000	1,264,340.00	0.54
33	688579	山大地纬	76,600	1,262,368.00	0.54
34	000032	深桑达 A	38,100	1,253,490.00	0.54
35	601138	工业富联	48,400	1,219,680.00	0.52
36	688556	高测股份	22,720	1,207,340.80	0.52
37	002230	科大讯飞	17,600	1,196,096.00	0.51
38	601318	中国平安	19,800	918,720.00	0.39
38	02318	中国平安	6,000	275,764.22	0.12
39	601899	紫金矿业	80,700	917,559.00	0.39
39	02899	紫金矿业	24,000	254,466.48	0.11

40	300316	晶盛机电	16,200	1,148,580.00	0.49
41	002180	纳思达	33,200	1,137,100.00	0.49
42	601186	中国铁建	114,000	1,122,900.00	0.48
43	002371	北方华创	3,500	1,111,775.00	0.48
44	603444	吉比特	2,200	1,080,442.00	0.46
45	002519	银河电子	149,500	1,062,945.00	0.46
46	300308	中际旭创	7,100	1,046,895.00	0.45
47	688599	天合光能	24,458	1,042,155.38	0.45
48	002555	三七互娱	29,800	1,039,424.00	0.45
49	000568	泸州老窖	4,900	1,026,893.00	0.44
50	01024	快手-W	20,600	1,017,063.80	0.44
51	002174	游族网络	60,000	1,008,000.00	0.43
52	603118	共进股份	75,700	1,006,053.00	0.43
53	002025	航天电器	15,400	982,520.00	0.42
54	600900	长江电力	44,300	977,258.00	0.42
55	600239	云南城投	468,700	974,896.00	0.42
56	002271	东方雨虹	35,400	965,004.00	0.41
57	688012	中微公司	5,800	907,410.00	0.39
58	002465	海格通信	86,500	894,410.00	0.38
59	600438	通威股份	25,900	888,629.00	0.38
60	600165	宁科生物	208,200	859,866.00	0.37
61	002594	比亚迪	3,300	852,291.00	0.37
62	688557	兰剑智能	23,400	825,552.00	0.35
63	601838	成都银行	66,600	813,186.00	0.35
64	000830	鲁西化工	76,700	809,952.00	0.35
65	603290	斯达半导	3,700	796,240.00	0.34
66	600674	川投能源	52,700	793,135.00	0.34
67	301125	腾亚精工	25,900	791,504.00	0.34
68	300880	迦南智能	31,000	791,120.00	0.34
69	002670	国盛金控	89,700	787,566.00	0.34
70	688258	卓易信息	11,700	780,741.00	0.34
71	002568	百润股份	21,200	770,620.00	0.33
72	688819	天能股份	20,680	761,851.20	0.33
73	600835	上海机电	44,300	761,074.00	0.33
74	300433	蓝思科技	64,500	758,520.00	0.33
75	300896	爱美客	1,700	756,415.00	0.33
76	600741	华域汽车	40,700	751,322.00	0.32
77	300143	盈康生命	65,700	745,038.00	0.32
78	000333	美的集团	12,500	736,500.00	0.32
79	002176	江特电机	60,900	725,928.00	0.31
80	002222	福晶科技	25,700	712,918.00	0.31
81	002475	立讯精密	21,900	710,655.00	0.31
82	603399	吉翔股份	61,109	707,031.13	0.30

83	002463	沪电股份	33,600	703,584.00	0.30
84	002223	鱼跃医疗	19,300	694,607.00	0.30
85	600610	中毅达	59,600	690,764.00	0.30
86	300117	嘉寓股份	219,300	679,830.00	0.29
87	002668	奥马电器	78,300	676,512.00	0.29
88	600522	中天科技	42,500	676,175.00	0.29
89	002483	润邦股份	115,700	671,060.00	0.29
90	300510	金冠股份	96,100	670,778.00	0.29
91	002353	杰瑞股份	26,600	668,458.00	0.29
92	688176	亚虹医药	57,000	666,330.00	0.29
93	688037	芯源微	3,845	657,302.75	0.28
94	600928	西安银行	186,500	656,480.00	0.28
95	300059	东方财富	46,200	656,040.00	0.28
96	603012	创力集团	105,700	652,169.00	0.28
97	002938	鹏鼎控股	26,600	646,114.00	0.28
98	000430	张家界	82,900	642,475.00	0.28
99	600546	山煤国际	44,200	639,574.00	0.27
100	002318	久立特材	37,000	630,110.00	0.27
101	000963	华东医药	14,500	628,865.00	0.27
102	600352	浙江龙盛	66,400	620,840.00	0.27
103	603605	珀莱雅	5,520	620,448.00	0.27
104	000933	神火股份	47,600	618,800.00	0.27
105	601163	三角轮胎	38,700	614,169.00	0.26
106	000651	格力电器	16,800	613,368.00	0.26
107	603927	中科软	15,900	613,104.00	0.26
108	688167	炬光科技	5,600	602,280.00	0.26
109	600153	建发股份	55,200	602,232.00	0.26
110	002241	歌尔股份	33,800	599,950.00	0.26
111	688409	富创精密	5,483	597,647.00	0.26
112	688072	拓荆科技	1,400	596,358.00	0.26
113	603986	兆易创新	5,600	595,000.00	0.26
114	688390	固德威	3,520	587,347.20	0.25
115	000408	藏格矿业	26,000	586,820.00	0.25
116	600256	广汇能源	85,100	583,786.00	0.25
117	301227	森鹰窗业	20,928	580,333.44	0.25
118	600873	梅花生物	64,400	575,092.00	0.25
119	600809	山西汾酒	3,100	573,717.00	0.25
120	688256	寒武纪	3,000	564,000.00	0.24
121	600089	特变电工	25,300	563,937.00	0.24
122	002048	宁波华翔	41,600	557,440.00	0.24
123	002096	易普力	46,900	554,827.00	0.24
124	600166	福田汽车	162,200	551,480.00	0.24
125	600100	同方股份	67,800	550,536.00	0.24

126	601800	中国交建	50,000	545,500.00	0.23
127	00388	香港交易所	2,000	544,336.99	0.23
128	600489	中金黄金	52,500	542,325.00	0.23
129	601117	中国化学	65,000	538,200.00	0.23
130	002422	科伦药业	18,100	537,208.00	0.23
131	000860	顺鑫农业	15,900	535,671.00	0.23
132	002123	梦网科技	40,300	535,587.00	0.23
133	688981	中芯国际	10,600	535,512.00	0.23
134	688521	芯原股份	7,400	532,208.00	0.23
135	600660	福耀玻璃	14,800	530,580.00	0.23
136	002518	科士达	13,200	528,132.00	0.23
137	601877	正泰电器	19,100	528,115.00	0.23
138	603233	大参林	18,840	527,708.40	0.23
139	300274	阳光电源	4,500	524,835.00	0.23
140	600015	华夏银行	97,000	524,770.00	0.23
141	601825	沪农商行	96,000	523,200.00	0.22
142	300713	英可瑞	22,900	518,914.00	0.22
143	601958	金铂股份	46,500	518,475.00	0.22
144	688041	海光信息	7,400	505,198.00	0.22
145	600000	浦发银行	69,400	502,456.00	0.22
146	300238	冠昊生物	32,300	498,389.00	0.21
147	688569	铁科轨道	11,800	496,426.00	0.21
148	002458	益生股份	40,000	494,000.00	0.21
149	002129	TCL 中环	14,875	493,850.00	0.21
150	600129	太极集团	8,300	493,767.00	0.21
151	002727	一心堂	18,700	493,680.00	0.21
152	688580	伟思医疗	6,800	491,640.00	0.21
153	000739	普洛药业	27,500	487,850.00	0.21
154	300146	汤臣倍健	20,300	486,794.00	0.21
155	600084	中葡股份	62,400	478,608.00	0.21
156	600573	惠泉啤酒	38,800	459,780.00	0.20
157	301089	拓新药业	7,100	439,774.00	0.19
158	600696	岩石股份	17,500	435,575.00	0.19
159	300498	温氏股份	23,700	434,895.00	0.19
160	600050	中国联通	89,600	430,080.00	0.18
161	002603	以岭药业	16,600	426,454.00	0.18
162	002624	完美世界	25,000	422,250.00	0.18
163	002698	博实股份	24,000	419,760.00	0.18
164	600009	上海机场	9,200	417,864.00	0.18
165	300422	博世科	68,400	411,084.00	0.18
166	300534	陇神戎发	40,400	408,848.00	0.18
167	600754	锦江酒店	9,600	406,464.00	0.17
168	600170	上海建工	150,800	405,652.00	0.17

169	000488	晨鸣纸业	81,900	397,215.00	0.17
170	600600	青岛啤酒	3,800	393,794.00	0.17
171	000683	远兴能源	53,500	384,665.00	0.17
172	688025	杰普特	4,400	384,340.00	0.17
173	00291	华润啤酒	8,000	380,593.34	0.16
174	600177	雅戈尔	60,300	380,493.00	0.16
175	600028	中国石化	59,700	379,692.00	0.16
176	603215	比依股份	21,100	378,534.00	0.16
177	601333	广深铁路	95,400	377,784.00	0.16
178	300972	万辰生物	8,500	376,890.00	0.16
179	000048	京基智农	19,200	374,784.00	0.16
180	688122	西部超导	6,720	374,505.60	0.16
181	600941	中国移动	4,000	373,200.00	0.16
182	002395	双象股份	31,800	372,060.00	0.16
183	002008	大族激光	14,100	369,420.00	0.16
184	688395	正弦电气	13,600	361,624.00	0.16
185	000910	大亚圣象	46,100	360,041.00	0.15
186	603369	今世缘	6,800	359,040.00	0.15
187	300866	安克创新	4,100	358,750.00	0.15
188	600221	海航控股	226,800	358,344.00	0.15
189	601988	中国银行	89,800	351,118.00	0.15
190	688533	上声电子	7,400	345,802.00	0.15
191	600309	万华化学	3,900	342,576.00	0.15
192	603040	新坐标	12,800	340,352.00	0.15
193	300432	富临精工	29,200	339,304.00	0.15
194	300638	广和通	14,880	337,478.40	0.15
195	603768	常青股份	18,745	333,098.65	0.14
196	601225	陕西煤业	18,300	332,877.00	0.14
197	301043	绿岛风	10,400	332,488.00	0.14
198	000895	双汇发展	13,400	328,166.00	0.14
199	300847	中船汉光	14,100	323,595.00	0.14
200	605066	天正电气	34,100	320,881.00	0.14
201	000997	新大陆	16,800	317,520.00	0.14
202	603313	梦百合	31,600	316,948.00	0.14
203	600409	三友化工	57,500	313,375.00	0.13
204	002610	爱康科技	122,300	313,088.00	0.13
205	02269	药明生物	9,000	311,583.14	0.13
206	600261	阳光照明	85,100	310,615.00	0.13
207	300545	联得装备	11,100	308,247.00	0.13
208	300315	掌趣科技	39,500	308,100.00	0.13
209	000630	铜陵有色	105,300	304,317.00	0.13
210	300532	今天国际	14,700	302,232.00	0.13
211	002913	奥士康	7,900	301,622.00	0.13

212	600031	三一重工	18,100	301,003.00	0.13
213	688019	安集科技	1,820	299,990.60	0.13
214	002912	中新赛克	6,700	294,867.00	0.13
215	600585	海螺水泥	12,400	294,376.00	0.13
216	600197	伊力特	10,800	293,436.00	0.13
217	301116	益客食品	19,000	292,600.00	0.13
218	688223	晶科能源	20,800	292,448.00	0.13
219	600517	国网英大	51,200	291,840.00	0.13
220	603787	新日股份	17,300	290,813.00	0.12
221	09992	泡泡玛特	18,000	289,096.05	0.12
222	02382	舜宇光学科技	4,000	288,210.95	0.12
223	601766	中国中车	44,200	287,300.00	0.12
224	300857	协创数据	10,800	283,824.00	0.12
225	600406	国电南瑞	12,240	282,744.00	0.12
226	300779	惠城环保	5,200	277,108.00	0.12
227	002027	分众传媒	40,200	273,762.00	0.12
228	300615	欣天科技	15,400	272,426.00	0.12
229	601975	招商南油	94,700	270,842.00	0.12
230	600998	九州通	25,777	267,565.26	0.11
231	601668	中国建筑	46,600	267,484.00	0.11
232	03888	金山软件	9,400	267,364.98	0.11
233	600011	华能国际	28,400	262,984.00	0.11
234	002352	顺丰控股	5,800	261,522.00	0.11
235	603367	辰欣药业	17,100	259,578.00	0.11
236	688310	迈得医疗	7,840	256,916.80	0.11
237	301103	何氏眼科	6,100	255,956.00	0.11
238	688698	伟创电气	6,400	255,872.00	0.11
239	603757	大元泵业	8,500	253,640.00	0.11
240	601169	北京银行	54,400	251,872.00	0.11
241	06078	海吉亚医疗	6,400	250,188.49	0.11
242	601336	新华保险	6,800	250,036.00	0.11
243	000589	贵州轮胎	44,200	247,520.00	0.11
244	600583	海油工程	42,000	245,700.00	0.11
245	002612	朗姿股份	10,300	244,934.00	0.11
246	688510	航亚科技	12,200	242,658.00	0.10
247	600478	科力远	33,600	239,904.00	0.10
248	600096	云天化	13,900	237,273.00	0.10
249	002234	民和股份	13,000	236,730.00	0.10
250	688718	唯赛勃	13,400	231,954.00	0.10
251	688626	翔宇医疗	5,000	227,550.00	0.10
252	688108	赛诺医疗	21,400	225,984.00	0.10
253	600229	城市传媒	26,500	225,780.00	0.10
254	000721	西安饮食	18,300	225,639.00	0.10

255	002689	远大智能	46,500	224,595.00	0.10
256	688617	惠泰医疗	600	224,250.00	0.10
257	688697	纽威数控	8,600	222,138.00	0.10
258	002192	融捷股份	3,300	220,539.00	0.09
259	000792	盐湖股份	11,500	220,455.00	0.09
260	002648	卫星化学	14,700	219,912.00	0.09
261	688190	云路股份	3,000	219,000.00	0.09
262	301083	百胜智能	9,300	217,620.00	0.09
263	600213	亚星客车	21,000	215,670.00	0.09
264	002050	三花智控	7,100	214,846.00	0.09
265	300777	中简科技	4,500	212,670.00	0.09
266	000426	兴业银锡	23,900	212,232.00	0.09
267	688029	南微医学	2,600	212,056.00	0.09
268	688338	赛科希德	3,800	210,710.00	0.09
269	601398	工商银行	43,700	210,634.00	0.09
270	688010	福光股份	8,600	209,840.00	0.09
271	601222	林洋能源	25,600	209,664.00	0.09
272	000688	国城矿业	13,700	207,829.00	0.09
273	688516	奥特维	1,100	207,240.00	0.09
274	03958	东方证券	50,000	197,764.71	0.08
275	002607	中公教育	42,000	197,400.00	0.08
276	688551	科威尔	3,000	196,740.00	0.08
277	688085	三友医疗	7,480	196,424.80	0.08
278	600030	中信证券	9,800	193,844.00	0.08
279	688358	祥生医疗	3,800	193,800.00	0.08
280	600258	首旅酒店	10,200	193,290.00	0.08
281	688658	悦康药业	9,200	191,452.00	0.08
282	300144	宋城演艺	14,900	184,760.00	0.08
283	01109	华润置地	6,000	183,658.42	0.08
284	601888	中国中免	1,600	176,848.00	0.08
285	688013	天臣医疗	7,400	175,454.00	0.08
286	002466	天齐锂业	2,500	174,775.00	0.08
287	600655	豫园股份	25,100	172,186.00	0.07
288	600436	片仔癀	600	171,816.00	0.07
289	300759	康龙化成	4,400	168,432.00	0.07
290	000538	云南白药	3,200	167,936.00	0.07
291	002392	北京利尔	46,100	166,882.00	0.07
292	600104	上汽集团	11,500	162,955.00	0.07
293	600598	北大荒	12,200	162,626.00	0.07
294	600694	大商股份	9,100	161,343.00	0.07
295	605388	均瑶健康	11,900	151,249.00	0.06
296	600143	金发科技	17,100	149,283.00	0.06
297	02669	中海物业	20,000	145,488.44	0.06

298	603529	爱玛科技	4,500	144,990.00	0.06
299	600036	招商银行	4,400	144,144.00	0.06
300	002489	浙江永强	35,100	142,155.00	0.06
301	600026	中远海能	10,800	136,512.00	0.06
302	06049	保利物业	3,800	132,958.74	0.06
303	688389	普门科技	5,600	131,544.00	0.06
304	603398	沐邦高科	5,300	130,327.00	0.06
305	002012	凯恩股份	20,000	130,200.00	0.06
306	600210	紫江企业	23,800	126,616.00	0.05
307	002602	世纪华通	15,600	118,404.00	0.05
308	601966	玲珑轮胎	5,300	117,766.00	0.05
309	00020	商汤-W	60,000	114,509.92	0.05
310	688166	博瑞医药	5,000	109,950.00	0.05
311	600887	伊利股份	3,800	107,616.00	0.05
312	300002	神州泰岳	7,600	106,400.00	0.05
313	601006	大秦铁路	13,800	102,534.00	0.04
314	301066	万事利	5,600	96,544.00	0.04
315	600019	宝钢股份	17,000	95,540.00	0.04
316	01797	东方甄选	4,000	94,041.96	0.04
317	300364	中文在线	5,000	89,100.00	0.04
318	000975	银泰黄金	7,600	88,920.00	0.04
319	688036	传音控股	600	88,200.00	0.04
320	603345	安井食品	600	88,080.00	0.04
321	600176	中国巨石	6,200	87,792.00	0.04
322	000932	华菱钢铁	17,500	83,475.00	0.04
323	600057	厦门象屿	9,500	82,650.00	0.04
324	03347	泰格医药	1,900	78,216.17	0.03
325	300795	米奥会展	1,850	77,163.50	0.03
326	688219	会通股份	7,400	70,670.00	0.03
327	600859	王府井	3,400	67,286.00	0.03
328	601918	新集能源	15,100	64,175.00	0.03
329	300803	指南针	1,300	63,167.00	0.03
330	600298	安琪酵母	1,700	61,557.00	0.03
331	600967	内蒙一机	6,000	60,600.00	0.03
332	601233	桐昆股份	4,300	56,975.00	0.02
333	09868	小鹏汽车-W	1,200	55,318.80	0.02
334	002841	视源股份	800	53,472.00	0.02
335	002508	老板电器	2,100	53,109.00	0.02
336	601601	中国太保	2,000	51,960.00	0.02
337	000906	浙商中拓	5,600	49,952.00	0.02
338	603138	海量数据	2,600	49,504.00	0.02
339	300379	东方通	2,300	47,311.00	0.02
340	300688	创业黑马	1,300	45,123.00	0.02

341	600361	创新新材	8,900	42,720.00	0.02
342	002207	准油股份	6,400	41,920.00	0.02
343	603833	欧派家居	400	38,320.00	0.02
344	603031	安孚科技	800	37,640.00	0.02
345	06098	碧桂园服务	4,000	37,321.75	0.02
346	688295	中复神鹰	1,000	36,680.00	0.02
347	002460	赣锋锂业	600	36,576.00	0.02
348	600301	华锡有色	2,000	35,900.00	0.02
349	002306	中科云网	7,200	30,312.00	0.01
350	000560	我爱我家	11,300	29,945.00	0.01
351	603788	宁波高发	2,400	29,568.00	0.01
352	03808	中国重汽	2,000	28,065.07	0.01
353	601919	中远海控	2,900	27,260.00	0.01
354	600705	中航产融	6,900	26,427.00	0.01
355	300729	乐歌股份	1,430	25,511.20	0.01
356	600257	大湖股份	4,100	25,338.00	0.01
357	600415	小商品城	2,900	24,737.00	0.01
358	600569	安阳钢铁	11,900	23,681.00	0.01
359	002789	建艺集团	1,600	23,248.00	0.01
360	002571	德力股份	3,300	22,407.00	0.01
361	300109	新开源	900	22,383.00	0.01
362	600178	东安动力	3,300	22,077.00	0.01
363	300199	翰宇药业	2,100	21,378.00	0.01
364	002666	德联集团	4,100	21,197.00	0.01
365	600159	大龙地产	7,700	20,713.00	0.01
366	002160	常铝股份	5,100	20,604.00	0.01
367	600302	标准股份	3,900	20,553.00	0.01
368	300169	天晟新材	4,900	20,482.00	0.01
369	002224	三力士	4,300	20,425.00	0.01
370	600470	六国化工	3,800	20,406.00	0.01
371	600626	申达股份	5,900	20,355.00	0.01
372	002798	帝欧家居	3,000	20,310.00	0.01
373	000626	远大控股	2,700	20,115.00	0.01
374	000599	青岛双星	4,700	20,069.00	0.01
375	600235	民丰特纸	3,700	20,054.00	0.01
376	600716	凤凰股份	5,300	20,034.00	0.01
377	002228	合兴包装	6,200	20,026.00	0.01
378	600565	迪马股份	12,600	19,908.00	0.01
379	600168	武汉控股	3,300	19,833.00	0.01
380	002114	罗平锌电	3,000	19,830.00	0.01
381	600292	远达环保	3,400	19,822.00	0.01
382	002495	佳隆股份	8,100	19,764.00	0.01
383	000698	沈阳化工	4,800	19,728.00	0.01

384	000407	胜利股份	5,400	19,710.00	0.01
385	600697	欧亚集团	1,600	19,696.00	0.01
386	603610	麒盛科技	1,700	19,686.00	0.01
387	601996	丰林集团	8,000	19,680.00	0.01
388	300237	美晨生态	10,400	19,656.00	0.01
389	600693	东百集团	5,000	19,650.00	0.01
390	600540	新赛股份	4,300	19,565.00	0.01
391	000536	华映科技	10,800	19,548.00	0.01
392	600743	华远地产	12,500	19,500.00	0.01
393	600408	安泰集团	8,700	19,488.00	0.01
394	06169	宇华教育	24,000	19,472.22	0.01
395	603900	莱绅通灵	3,100	19,468.00	0.01
396	000759	中百集团	4,300	19,393.00	0.01
397	002734	利民股份	2,100	19,362.00	0.01
398	002688	金河生物	4,100	19,352.00	0.01
399	688098	申联生物	2,600	19,188.00	0.01
400	600844	丹化科技	7,000	19,180.00	0.01
401	300190	维尔利	4,800	19,152.00	0.01
402	300289	利德曼	3,400	19,040.00	0.01
403	002551	尚荣医疗	4,900	18,865.00	0.01
404	603188	亚邦股份	5,400	18,792.00	0.01
405	600547	山东黄金	800	18,784.00	0.01
406	002187	广百股份	2,900	18,676.00	0.01
407	600076	康欣新材	7,200	18,504.00	0.01
408	603086	先达股份	2,660	18,221.00	0.01
409	600295	鄂尔多斯	1,960	17,581.20	0.01
410	000785	居然之家	4,300	16,383.00	0.01
411	688211	中科微至	334	15,086.78	0.01
412	603799	华友钴业	300	13,773.00	0.01
413	300012	华测检测	700	13,650.00	0.01
414	002188	中天服务	2,100	13,440.00	0.01
415	003010	若羽臣	600	12,756.00	0.01
416	603338	浙江鼎力	200	11,202.00	0.00
417	000423	东阿阿胶	200	10,690.00	0.00
418	603678	火炬电子	300	10,338.00	0.00
419	300639	凯普生物	1,000	10,020.00	0.00
420	600776	东方通信	700	9,975.00	0.00
421	603368	柳药集团	400	9,884.00	0.00
422	603489	八方股份	140	9,816.80	0.00
423	300627	华测导航	300	9,741.00	0.00
424	002978	安宁股份	300	9,633.00	0.00
425	600990	四创电子	300	9,492.00	0.00
426	600729	重庆百货	300	9,432.00	0.00

427	603298	杭叉集团	400	9,420.00	0.00
428	603279	景津装备	300	9,408.00	0.00
429	300470	中密控股	200	9,244.00	0.00
430	002884	凌霄泵业	600	9,150.00	0.00
431	300127	银河磁体	500	9,065.00	0.00
432	300726	宏达电子	200	8,944.00	0.00
433	603301	振德医疗	300	8,886.00	0.00
434	600681	百川能源	1,900	8,873.00	0.00
435	002675	东诚药业	600	8,826.00	0.00
436	603277	银都股份	400	8,736.00	0.00
437	002643	万润股份	500	8,705.00	0.00
438	002929	润建股份	200	8,682.00	0.00
439	301047	义翘神州	100	8,570.00	0.00
440	002249	大洋电机	1,500	8,550.00	0.00
441	603220	中贝通信	500	8,525.00	0.00
442	002484	江海股份	400	8,516.00	0.00
443	605507	国邦医药	400	8,508.00	0.00
444	002847	盐津铺子	100	8,505.00	0.00
445	002402	和而泰	500	8,490.00	0.00
446	603718	海利生物	900	8,487.00	0.00
447	600273	嘉化能源	900	8,478.00	0.00
448	603043	广州酒家	300	8,478.00	0.00
449	002677	浙江美大	800	8,472.00	0.00
450	01030	新城发展	6,000	8,463.78	0.00
451	600645	中源协和	500	8,450.00	0.00
452	603766	隆鑫通用	1,600	8,448.00	0.00
453	601609	金田股份	1,300	8,437.00	0.00
454	000951	中国重汽	500	8,425.00	0.00
455	603989	艾华集团	400	8,424.00	0.00
456	000935	四川双马	500	8,420.00	0.00
457	603103	横店影视	500	8,420.00	0.00
458	601311	骆驼股份	900	8,352.00	0.00
459	601678	滨化股份	1,800	8,352.00	0.00
460	002322	理工能科	800	8,320.00	0.00
461	002859	洁美科技	300	8,310.00	0.00
462	002636	金安国纪	900	8,307.00	0.00
463	002950	奥美医疗	800	8,304.00	0.00
464	600894	广日股份	1,100	8,283.00	0.00
465	603328	依顿电子	1,000	8,280.00	0.00
466	000039	中集集团	1,200	8,268.00	0.00
467	600711	盛屯矿业	1,700	8,262.00	0.00
468	002266	浙富控股	2,000	8,260.00	0.00
469	601965	中国汽研	400	8,260.00	0.00

470	002274	华昌化工	1,100	8,239.00	0.00
471	000828	东莞控股	900	8,235.00	0.00
472	000902	新洋丰	800	8,224.00	0.00
473	600403	大有能源	2,000	8,220.00	0.00
474	600572	康恩贝	1,200	8,220.00	0.00
475	601038	一拖股份	700	8,218.00	0.00
476	600740	山西焦化	1,600	8,208.00	0.00
477	002214	大立科技	600	8,190.00	0.00
478	600742	一汽富维	1,000	8,190.00	0.00
479	600308	华泰股份	2,200	8,184.00	0.00
480	000559	万向钱潮	1,500	8,175.00	0.00
481	603300	华铁应急	1,500	8,175.00	0.00
482	600582	天地科技	1,400	8,162.00	0.00
483	600252	中恒集团	3,300	8,151.00	0.00
484	601952	苏垦农发	700	8,148.00	0.00
485	601827	三峰环境	1,100	8,140.00	0.00
486	300401	花园生物	700	8,134.00	0.00
487	603599	广信股份	300	8,124.00	0.00
488	002405	四维图新	700	8,106.00	0.00
489	600562	国睿科技	500	8,100.00	0.00
490	300185	通裕重工	2,900	8,091.00	0.00
491	603113	金能科技	1,000	8,090.00	0.00
492	600688	上海石化	2,600	8,086.00	0.00
493	300219	鸿利智汇	1,100	8,085.00	0.00
494	600548	深高速	900	8,082.00	0.00
495	600618	氯碱化工	900	8,073.00	0.00
496	002038	双鹭药业	800	8,072.00	0.00
497	002376	新北洋	1,000	8,070.00	0.00
498	000090	天健集团	1,600	8,064.00	0.00
499	603053	成都燃气	800	8,056.00	0.00
500	600120	浙江东方	2,100	8,043.00	0.00
501	002839	张家港行	1,900	8,037.00	0.00
502	600098	广州发展	1,300	8,034.00	0.00
503	601860	紫金银行	3,200	8,032.00	0.00
504	600285	羚锐制药	500	8,030.00	0.00
505	002498	汉缆股份	2,000	8,020.00	0.00
506	300455	航天智装	700	8,015.00	0.00
507	600682	南京新百	1,000	8,010.00	0.00
508	600868	梅雁吉祥	2,900	8,004.00	0.00
509	002004	华邦健康	1,600	8,000.00	0.00
510	300255	常山药业	1,600	8,000.00	0.00
511	600643	爱建集团	1,600	8,000.00	0.00
512	601099	太平洋	3,100	7,998.00	0.00

513	603171	税友股份	200	7,996.00	0.00
514	603297	永新光学	100	7,990.00	0.00
515	000650	仁和药业	1,300	7,982.00	0.00
516	002390	信邦制药	1,800	7,974.00	0.00
517	600717	天津港	1,800	7,974.00	0.00
518	600761	安徽合力	400	7,972.00	0.00
519	600267	海正药业	700	7,966.00	0.00
520	600284	浦东建设	1,300	7,956.00	0.00
521	002332	仙琚制药	600	7,950.00	0.00
522	601399	国机重装	2,500	7,950.00	0.00
523	603386	骏亚科技	700	7,945.00	0.00
524	600929	雪天盐业	1,000	7,940.00	0.00
525	000517	荣安地产	2,600	7,930.00	0.00
526	002461	珠江啤酒	900	7,929.00	0.00
527	002267	陕天然气	1,000	7,920.00	0.00
528	600888	新疆众和	1,000	7,920.00	0.00
529	000718	苏宁环球	2,900	7,917.00	0.00
530	002034	旺能环境	500	7,905.00	0.00
531	600420	国药现代	700	7,903.00	0.00
532	603730	岱美股份	500	7,900.00	0.00
533	601212	白银有色	2,900	7,888.00	0.00
534	601515	东风股份	1,800	7,884.00	0.00
535	300034	钢研高纳	200	7,878.00	0.00
536	600184	光电股份	600	7,878.00	0.00
537	600935	华塑股份	2,100	7,875.00	0.00
538	002517	恺英网络	500	7,870.00	0.00
539	601908	京运通	1,300	7,865.00	0.00
540	600480	凌云股份	1,000	7,860.00	0.00
541	600649	城投控股	2,000	7,860.00	0.00
542	002456	欧菲光	1,400	7,840.00	0.00
543	603013	亚普股份	500	7,840.00	0.00
544	600746	江苏索普	1,200	7,836.00	0.00
545	600320	振华重工	2,100	7,833.00	0.00
546	600496	精工钢构	2,100	7,833.00	0.00
547	000036	华联控股	1,900	7,828.00	0.00
548	600812	华北制药	1,400	7,826.00	0.00
549	600637	东方明珠	1,000	7,820.00	0.00
550	01755	新城悦服务	2,000	7,818.39	0.00
551	600820	隧道股份	1,300	7,813.00	0.00
552	002063	远光软件	900	7,812.00	0.00
553	002724	海洋王	900	7,812.00	0.00
554	300326	凯利泰	1,200	7,800.00	0.00
555	000061	农产品	1,300	7,787.00	0.00

556	002545	东方铁塔	1,100	7,766.00	0.00
557	000532	华金资本	700	7,763.00	0.00
558	600997	开滦股份	1,300	7,761.00	0.00
559	000088	盐田港	1,600	7,760.00	0.00
560	600783	鲁信创投	600	7,758.00	0.00
561	002135	东南网架	1,200	7,752.00	0.00
562	000789	万年青	1,000	7,750.00	0.00
563	002258	利尔化学	600	7,746.00	0.00
564	603387	基蛋生物	600	7,734.00	0.00
565	002233	塔牌集团	1,000	7,720.00	0.00
566	600789	鲁抗医药	1,200	7,704.00	0.00
567	600966	博汇纸业	1,300	7,696.00	0.00
568	002106	莱宝高科	900	7,650.00	0.00
569	002041	登海种业	500	7,635.00	0.00
570	000727	冠捷科技	3,600	7,632.00	0.00
571	603337	杰克股份	400	7,616.00	0.00
572	002226	江南化工	1,500	7,605.00	0.00
573	600305	恒顺醋业	700	7,602.00	0.00
574	000823	超声电子	800	7,584.00	0.00
575	601567	三星医疗	600	7,578.00	0.00
576	600323	瀚蓝环境	400	7,572.00	0.00
577	000685	中山公用	1,000	7,570.00	0.00
578	000030	富奥股份	1,500	7,560.00	0.00
579	002091	江苏国泰	1,000	7,540.00	0.00
580	600075	新疆天业	1,600	7,536.00	0.00
581	000927	中国铁物	2,700	7,506.00	0.00
582	600037	歌华有线	900	7,479.00	0.00
583	002815	崇达技术	600	7,470.00	0.00
584	002726	龙大美食	900	7,461.00	0.00
585	600639	浦东金桥	600	7,446.00	0.00
586	300739	明阳电路	500	7,445.00	0.00
587	600662	外服控股	1,300	7,436.00	0.00
588	603025	大豪科技	600	7,416.00	0.00
589	600007	中国国贸	400	7,408.00	0.00
590	002421	达实智能	2,100	7,392.00	0.00
591	000555	神州信息	600	7,380.00	0.00
592	002088	鲁阳节能	400	7,376.00	0.00
593	601929	吉视传媒	4,000	7,360.00	0.00
594	002440	闰土股份	1,100	7,337.00	0.00
595	000672	上峰水泥	800	7,304.00	0.00
596	300377	赢时胜	900	7,290.00	0.00
597	300685	艾德生物	300	7,278.00	0.00
598	300623	捷捷微电	400	7,248.00	0.00

599	002946	新乳业	500	7,175.00	0.00
600	002558	巨人网络	400	7,172.00	0.00
601	002287	奇正藏药	300	7,170.00	0.00
602	601519	大智慧	1,000	7,160.00	0.00
603	300523	辰安科技	300	7,158.00	0.00
604	002597	金禾实业	300	7,080.00	0.00
605	600850	电科数字	300	7,077.00	0.00
606	300662	科锐国际	200	7,074.00	0.00
607	000915	华特达因	200	7,058.00	0.00
608	603919	金徽酒	300	7,044.00	0.00
609	002152	广电运通	600	7,032.00	0.00
610	600977	中国电影	500	7,025.00	0.00
611	600612	老凤祥	100	6,988.00	0.00
612	600908	无锡银行	1,300	6,968.00	0.00
613	000156	华数传媒	800	6,960.00	0.00
614	601098	中南传媒	600	6,960.00	0.00
615	601921	浙版传媒	800	6,952.00	0.00
616	603466	风语筑	500	6,950.00	0.00
617	000893	亚钾国际	300	6,882.00	0.00
618	600751	海航科技	2,900	6,873.00	0.00
619	002544	普天科技	300	6,870.00	0.00
620	600271	航天信息	500	6,845.00	0.00
621	603508	思维列控	400	6,820.00	0.00
622	603380	易德龙	300	6,786.00	0.00
623	600455	博通股份	300	6,777.00	0.00
624	600456	宝钛股份	200	6,768.00	0.00
625	300775	三角防务	200	6,756.00	0.00
626	301050	雷电微力	100	6,493.00	0.00
627	001696	宗申动力	900	6,372.00	0.00
628	600360	华微电子	900	6,192.00	0.00
629	300134	大富科技	600	6,150.00	0.00
630	300525	博思软件	400	6,136.00	0.00
631	600459	贵研铂业	400	6,120.00	0.00
632	600510	黑牡丹	1,000	6,070.00	0.00
633	002541	鸿路钢构	200	5,762.00	0.00
634	002293	罗莱生活	500	5,750.00	0.00
635	000528	柳工	700	5,530.00	0.00
636	300951	博硕科技	100	5,463.00	0.00
637	300177	中海达	800	5,416.00	0.00
638	300229	拓尔思	200	5,194.00	0.00
639	603877	太平鸟	200	5,056.00	0.00
640	002171	楚江新材	700	4,984.00	0.00
641	300476	胜宏科技	200	4,822.00	0.00

642	300770	新媒股份	100	4,586.00	0.00
643	002930	宏川智慧	200	4,554.00	0.00
644	002706	良信股份	400	4,500.00	0.00
645	300358	楚天科技	300	4,479.00	0.00
646	603010	万盛股份	400	4,348.00	0.00
647	600710	苏美达	500	4,280.00	0.00
648	600017	日照港	1,400	4,186.00	0.00
649	603733	仙鹤股份	200	4,170.00	0.00
650	300188	美亚柏科	200	4,158.00	0.00
651	002042	华孚时尚	1,300	4,082.00	0.00
652	603033	三维股份	200	4,070.00	0.00
653	300999	金龙鱼	100	3,999.00	0.00
654	601963	重庆银行	500	3,955.00	0.00
655	601010	文峰股份	1,600	3,920.00	0.00
656	600179	安通控股	1,400	3,906.00	0.00
657	000851	高鸿股份	700	3,808.00	0.00
658	000582	北部湾港	500	3,800.00	0.00
659	601366	利群股份	700	3,745.00	0.00
660	002003	伟星股份	400	3,744.00	0.00
661	002556	辉隆股份	500	3,630.00	0.00
662	002832	比音勒芬	100	3,541.00	0.00
663	002467	二六三	700	3,479.00	0.00
664	300346	南大光电	100	3,439.00	0.00
665	300439	美康生物	300	3,393.00	0.00
666	300451	创业慧康	400	3,352.00	0.00
667	000811	冰轮环境	200	3,152.00	0.00
668	601019	山东出版	300	2,751.00	0.00
669	300458	全志科技	100	2,725.00	0.00
670	002061	浙江交科	600	2,676.00	0.00
671	600151	航天机电	300	2,673.00	0.00
672	601886	江河集团	300	2,667.00	0.00
673	000034	神州数码	100	2,659.00	0.00
674	603098	森特股份	100	2,050.00	0.00
675	600206	有研新材	100	1,314.00	0.00
676	002413	雷科防务	200	1,046.00	0.00
677	300267	尔康制药	300	969.00	0.00
678	000982	中银绒业	500	760.00	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	688349	三一重能	8,183,176.19	3.65
2	600839	四川长虹	7,744,455.44	3.45
3	600633	浙数文化	7,667,941.56	3.42
4	300760	迈瑞医疗	6,235,980.00	2.78
5	03690	美团-W	5,256,114.07	2.34
6	601989	中国重工	5,146,653.00	2.29
7	688390	固德威	5,048,322.96	2.25
8	002475	立讯精密	5,043,148.00	2.25
9	688031	星环科技	4,984,038.26	2.22
10	002371	北方华创	4,957,717.99	2.21
11	688375	国博电子	4,735,248.41	2.11
12	300750	宁德时代	4,450,662.00	1.98
13	300896	爱美客	4,422,016.00	1.97
14	600037	歌华有线	4,418,301.00	1.97
15	000858	五粮液	4,338,557.00	1.93
16	002865	钧达股份	4,054,233.00	1.81
17	600519	贵州茅台	4,018,845.00	1.79
18	300503	昊志机电	3,947,827.00	1.76
19	300144	宋城演艺	3,907,245.00	1.74
20	688348	昱能科技	3,859,164.81	1.72

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	600519	贵州茅台	11,341,286.00	5.05
2	688349	三一重能	7,933,916.53	3.53
3	300750	宁德时代	7,791,663.00	3.47
4	603259	药明康德	6,965,046.77	3.10
5	601012	隆基绿能	6,823,808.00	3.04
6	000858	五粮液	6,811,078.34	3.03
7	600839	四川长虹	6,765,106.00	3.01
8	000568	泸州老窖	6,285,903.00	2.80
9	002475	立讯精密	5,629,009.00	2.51
10	600633	浙数文化	5,221,965.16	2.33
11	300896	爱美客	4,786,734.00	2.13
12	300760	迈瑞医疗	4,762,271.00	2.12
13	03690	美团-W	4,730,338.80	2.11
14	688375	国博电子	4,710,873.16	2.10

15	002371	北方华创	4,622,430.00	2.06
16	300450	先导智能	4,410,470.34	1.97
17	600037	歌华有线	4,259,955.00	1.90
18	600690	海尔智家	4,048,800.00	1.80
19	688390	固德威	4,043,659.04	1.80
20	000002	万科 A	3,889,868.00	1.73

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	915,297,814.42
卖出股票收入（成交）总额	902,440,666.12

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	10,586,980.60	4.55
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	10,586,980.60	4.55

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	019679	22 国债 14	104,000	10,586,980.60	4.55

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

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。

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	10,574,561.47
2	应收清算款	-
3	应收股利	24,547.54
4	应收利息	-
5	应收申购款	591.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,599,700.14

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)	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
汇泉匠心智选一 年持有混合 A	9,031	22,806.47	3,219,765.33	1.56%	202,745,433.58	98.44%
汇泉匠心智选一 年持有混合 C	1,747	18,737.19	550,270.82	1.68%	32,183,594.26	98.32%
合计	10,778	22,146.88	3,770,036.15	1.58%	234,929,027.84	98.42%

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	215,402.92	0.10%
	汇泉匠心智选一年持有混合 C	1,010,517.21	3.09%
	合计	1,225,920.13	0.51%

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	197,807,741.01	30,757,730.67

13 日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	197,829,038.41	30,796,049.47
本报告期基金总申购份额	8,136,160.50	1,937,815.61
减: 本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	205,965,198.91	32,733,865.08

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, 本基金托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

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	1,817,738,480.54	100.00%	1,361,561.48	100.00%	-

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。

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	2,096,664.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

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 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-20
2	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-31
3	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-21

§ 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

二〇二三年八月二十五日