

汇添富新兴消费股票型证券投资基金 2023 年 中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录	
§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	57
7.1 期末基金资产组合情况	57
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	58
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	81
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	84
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	85
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	85
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	85
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	85

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	85
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	85
7.12 投资组合报告附注.....	85
§ 8 基金份额持有人信息.....	86
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	86
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	87
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.....	87
§ 9 开放式基金份额变动.....	88
§ 10 重大事件揭示.....	88
10.1 基金份额持有人大会决议.....	88
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.....	88
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	89
10.4 基金投资策略的改变.....	89
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	89
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.....	89
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	89
10.8 其他重大事件.....	94
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	94
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	94
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	94
§ 12 备查文件目录.....	94
12.1 备查文件目录.....	94
12.2 存放地点.....	95
12.3 查阅方式.....	95

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富新兴消费股票型证券投资基金		
基金简称	汇添富新兴消费股票		
基金主代码	001726		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 12 月 02 日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额（份）	201,536,123.81		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富新兴消费股票 A	汇添富新兴消费股票 C	汇添富新兴消费股票 D
下属分级基金的交易代码	001726	015194	015195
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	191,118,972.75	2,506,548.45	7,910,602.61

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新兴消费主题的优质上市公司。本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为股票型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘新兴消费主题中商业模式独特、竞争优势明显、具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司。本基金的投资策略还包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、权证投资策略、融资投资策略。
业绩比较基准	中证主要消费行业指数*40%+中证可选消费行业指数*40%+中债综合指数*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	报告期(2023年01月01日 - 2023年06月30日)		
	汇添富新兴消费股票 A	汇添富新兴消费股票 C	汇添富新兴消费股票 D
本期已实现收益	-3,684,445.82	-97,804.63	-562,601.49
本期利润	-30,062,137.83	-318,461.93	-2,308,205.56

加权平均基金份额本期利润	-0.1348	-0.1210	-0.5905
本期加权平均净值利润率	-8.13%	-7.33%	-36.97%
本期基金份额净值增长率	-8.40%	-8.68%	-8.61%
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	96,457,937.73	1,238,673.00	3,929,883.19
期末可供分配基金份额利润	0.5047	0.4942	0.4968
期末基金资产净值	287,576,910.48	3,745,221.45	11,840,485.80
期末基金份额净值	1.505	1.494	1.497
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	50.50%	-10.38%	-10.20%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富新兴消费股票 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益	①—③	②—④

		准差②		率标准差 ④		
过去一个月	-1.83%	1.73%	3.06%	0.90%	-4.89%	0.83%
过去三个月	-13.51%	1.33%	-6.65%	0.76%	-6.86%	0.57%
过去六个月	-8.40%	1.27%	-4.84%	0.80%	-3.56%	0.47%
过去一年	-19.65%	1.49%	-14.31%	0.92%	-5.34%	0.57%
过去三年	0.20%	1.70%	2.59%	1.13%	-2.39%	0.57%
自基金合同生效日起至今	50.50%	1.56%	48.52%	1.13%	1.98%	0.43%
汇添富新兴消费股票 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.90%	1.73%	3.06%	0.90%	-4.96%	0.83%
过去三个月	-13.69%	1.33%	-6.65%	0.76%	-7.04%	0.57%
过去六个月	-8.68%	1.28%	-4.84%	0.80%	-3.84%	0.48%
过去一年	-20.15%	1.49%	-14.31%	0.92%	-5.84%	0.57%
自基金合同生效日起至今	-10.38%	1.61%	-6.52%	1.07%	-3.86%	0.54%
汇添富新兴消费股票 D						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.90%	1.73%	3.06%	0.90%	-4.96%	0.83%
过去三个月	-13.62%	1.33%	-6.65%	0.76%	-6.97%	0.57%
过去六个月	-8.61%	1.27%	-4.84%	0.80%	-3.77%	0.47%

过去一年	-19.99%	1.49%	-14.31%	0.92%	-5.68%	0.57%
自基金合同生效日起至今	-10.20%	1.60%	-6.52%	1.07%	-3.68%	0.53%

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

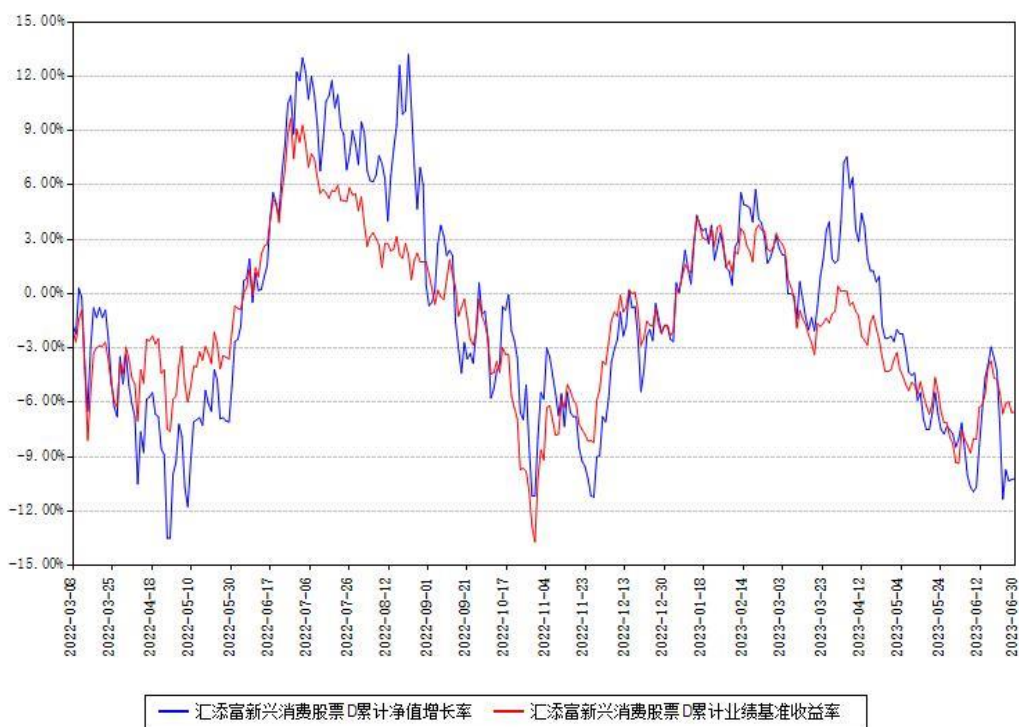
汇添富新兴消费股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



汇添富新兴消费股票C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富新兴消费股票D累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2015年12月02日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金于2022年03月07日新增C、D类份额，新增份额自实际有资产之日起披露业绩数

据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟林	本基金的基金经理, 研究总监	2015 年 12 月 02 日		15	国籍：中国。学历：北京大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2008 年 7 月加入汇添

				<p>富基金任行业分析师；2010 年 5 月至 2011 年 3 月在国家发展和改革委员会工作。2011 年 3 月至 2015 年 12 月在汇添富基金管理股份有限公司担任高级策略分析师，现任研究总监。2015 年 12 月 2 日至今任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 7 月 5 日至 2021 年 8 月 3 日任汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 8 月 19 日至 2022 年 8 月 29 日任汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 17 日至 2022 年 10 月 25 日任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 3 日至今任汇</p>
--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>添富核心精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2021 年 8 月 3 日至今任汇添富稳健收益混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 17 日至 2023 年 6 月 14 日任汇添富均衡配置个股精选六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至今任汇添富中盘潜力增长一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
韩超	本基金的基金经理助理	2023 年 06 月 05 日		5	<p>国籍：中国。学历：北京大学金融学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2018 年 7 月至 2023 年 6 月任汇添富基金管理股份有限公司行业分析师、高级行业分析师。2023 年 6 月 5 日至今任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理助理。</p>

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3日内、5日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 25 次，投资组合因投资策略与其

他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场上半年跌宕起伏，是非常有挑战性的一个投资阶段。指数整体呈现出先扬后抑走势，与宏观经济相关的总量资产，包括白酒为代表的消费品、传统制造业和资源行业等经历了一个较长时间的调整。但是，以计算机、电子、传媒和通信为代表的科技类资产表现活跃，机构性机会丰富，但是波动也非常大。而以光伏、新能源汽车等为代表的高端制造业，由于供给大幅增加，不少环节盈利能力在下降，呈现出估值持续收缩的状态。如何规避风险？如何把握机构性机会？如何平衡长期的价值和短期的压力等？对投资人提出了较大的挑战。

上半年从大的市场环境来看，有三个显著特征。第一、整体宏观经济在一季度复苏后，二季度出现持续调整的态势。尤其以 PMI、PPI、CPI、消费增速等为代表的宏观经济数据逐渐走弱，企业的盈利持续承压。尤其是不少制造业企业，前几年资本支出比较大，正在形成的新增供给持续增加，加剧了这种盈利压力。大部分与宏观经济相关的消费、制造和资源等资产股价持续走弱。第二、流动性环境非常宽裕。国内货币环境保持了相对宽松的状态，同时实体经济相对偏弱，利率水平持续走低，宏观流动性是非常宽裕的。这为主题投资、科技股投资提供了很好的流动性环境。第三、人工智能产业蓬勃发展，在资产市场产生共振。Chatgpt 的横空出世，宣布人工智能进入新的时代，全球展开了人工智能的激烈竞赛。处在产业前端的光模块、芯片、服务器等感受到了这种需求的快速上升。人工智能在应用端的创新也在逐步展开，这带动了相关科技行业的投资机会。

上半年我们的行业配置围绕着两条主线展开。第一条，对于大部分传统消费类资产，确实面临着一个中长期价值越来越突出与短期基本面疲软的压力。我们判断消费行业也面临着分化。比如可选消费里的汽车：电动化、智能化成为车企转型的方向，传统的车型面临着巨大的竞争压力。比如白酒行业：企业的经营策略、品牌策略、渠道策略的不同，导致经营也出现了显著的分化，真正有品牌力，或者进行渠道深耕的公司慢慢走出来。比如不少新兴消费行业，出现了不少流星现象，过去几年高增长的转瞬即逝，但是也有持续保持高增长的优企业。在消费整体泥沙俱下的环境下，现在是真正去伪存真，抓住下一轮赢家的好时机，这一点我们是充满信心和耐心的，对于真正优秀的公司，我们愿意陪企业共同成长。另一方面，我们看到 AI 大浪潮下，确实对不少行业产生了深远影响。比如对于传媒，AI 大幅降低了内容生产的成本，同时大幅增加了内容的丰富度。比如传统的小家电，很可能成为 AI 的重要

终端，作为智能终端的价值在上升。我们适当加大了这些新兴消费行业的配置，努力通过挖掘出一些有特色、高成长空间的优质个股，来提升组合的收益风险比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富新兴消费股票 A 类份额净值增长率为-8.40%，同期业绩比较基准收益率为-4.84%。本报告期汇添富新兴消费股票 C 类份额净值增长率为-8.68%，同期业绩比较基准收益率为-4.84%。本报告期汇添富新兴消费股票 D 类份额净值增长率为-8.61%，同期业绩比较基准收益率为-4.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断下半年的市场将是积极可为的阶段。一方面，宏观经济经历了上半年的调整压力，不少中游制造业库存水平处在非常低的位置，客观上存在补库需求。随着财政政策和刺激内需政策的发力，宏观经济有望逐步改善。第二、政策明确提出活跃资本市场、提振投资者信心。政策层面对资本市场的呵护非常明显，对于提升投资人风险偏好有积极作用。第三、从估值水平看，无论横向的国际对比还是纵向的历史估值水平对比，A 股和港股都处在估值非常有吸引力的位置。

我们未来看好消费三条主线。第一、很多经典消费都进入了相对低估水平，我们结合公司质地和估值，将加大配置；二是中国的消费品公司迈向“国际化、全球化”发展阶段，龙头公司市场空间大幅增长，我们关注国际化拓展大幅加快的消费品公司；三是高成长的新兴消费行业，包括新的消费形式、新的消费产品、新的消费渠道等，经过过去几年市场检验，不少行业逐渐沉淀下来，进入相对稳定的高速增长阶段，我们可以在这一块成长类资产里进行精挑细选。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估

值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富新兴消费股票型证券投资基金

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	39,568,534.52	21,051,979.58
结算备付金		625,770.89	1,427,153.23
存出保证金		202,480.04	157,119.43
交易性金融资产	6.4.7.2	282,691,019.33	312,266,585.62
其中：股票投资		282,068,370.70	311,626,734.65
基金投资		-	-
债券投资		622,648.63	639,850.97
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		1,673,780.69	6,228,314.22
应收股利		-	-
应收申购款		95,405.35	305,490.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		324,856,990.82	341,436,642.94
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		1,928,988.32	-
应付赎回款		18,286,423.27	35,424.99
应付管理人报酬		418,769.59	425,686.95
应付托管费		69,794.94	70,947.83
应付销售服务费		5,901.26	2,286.46
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.35	2.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	984,493.36	776,688.03

负债合计		21,694,373.09	1,311,036.69
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	201,536,123.81	207,013,785.22
未分配利润	6.4.7.9	101,626,493.92	133,111,821.03
净资产合计		303,162,617.73	340,125,606.25
负债和净资产总计		324,856,990.82	341,436,642.94

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 201,536,123.81 份。本基金下属汇添富新兴消费股票 A 基金份额净值 1.505 元，基金份额总额 191,118,972.75 份；本基金下属汇添富新兴消费股票 C 基金份额净值 1.494 元，基金份额总额 2,506,548.45 份；本基金下属汇添富新兴消费股票 D 基金份额净值 1.497 元，基金份额总额 7,910,602.61 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富新兴消费股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-29,254,192.21	-32,672,630.73
1. 利息收入		69,268.69	62,597.90
其中：存款利息收入	6.4.7.10	69,268.69	62,597.90
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）		-1,127,851.86	-27,812,355.53
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-2,930,172.70	-31,750,570.82
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	449.89	401,877.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,801,870.95	3,536,337.59
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-28,343,953.38	-5,013,529.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	148,344.34	90,656.45

减：二、营业总支出		3,434,613.11	3,331,441.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,833,522.04	2,766,827.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	472,253.67	461,138.01
3. 销售服务费		25,453.32	84.13
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		1.52	4.02
8. 其他费用	6.4.7.21	103,382.56	103,387.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,688,805.32	-36,004,072.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,688,805.32	-36,004,072.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-32,688,805.32	-36,004,072.43

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富新兴消费股票型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	207,013,785.22	133,111,821.03	340,125,606.25
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	207,013,785.22	133,111,821.03	340,125,606.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,477,661.41	-31,485,327.11	-36,962,988.52
（一）、综合收益总额	-	-32,688,805.32	-32,688,805.32
（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）	-5,477,661.41	1,203,478.21	-4,274,183.20

其中：1. 基金申购款	47,316,540.60	32,313,897.15	79,630,437.75
2. 基金赎回款	-52,794,202.01	-31,110,418.94	-83,904,620.95
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	201,536,123.81	101,626,493.92	303,162,617.73
项目	上年度可比期间		
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	226,691,048.33	227,947,205.66	454,638,253.99
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	226,691,048.33	227,947,205.66	454,638,253.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,345,708.21	-43,349,534.34	-58,695,242.55
(一)、综合收益总额	-	-36,004,072.43	-36,004,072.43
(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）	-15,345,708.21	-7,345,461.91	-22,691,170.12
其中：1. 基金申购款	21,717,221.57	15,838,416.70	37,555,638.27
2. 基金赎回款	-37,062,929.78	-23,183,878.61	-60,246,808.39
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	211,345,340.12	184,597,671.32	395,943,011.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富新兴消费股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1545 号文《关于准予汇添富新兴消费股票型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2015 年 12 月 2 日生效。首次设立基金募集规模为 2,891,766,352.32 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2015）验字第 60466941_B37 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自 2022 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类和 D 类基金份额，原基金份额变更为 A 类基金份额，基金注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券、货币市场工具、股指期货、股票期权、权证、资产支持证券、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证投资不低于基金资产的 80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金主要投资于新兴消费主题上市公司股票及存托凭证，投资于新兴消费主题上市公司股票资产及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金主要投资于新兴消费主题的优质上市公司。本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：中证主要消费行业指数×40%+中证可选消费行业指数×40%+中债综合指数×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

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

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增

增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

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

6. 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	39,568,534.52
等于：本金	39,565,387.02
加：应计利息	3,147.50
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	39,568,534.52

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	297,630,942.81	-	282,068,370.70	15,562,572.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	583,000.00	879.13	38,769.50
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	583,000.00	879.13	38,769.50
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	298,213,942.81	879.13	282,691,019.33	15,523,802.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	45,772.00
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	804,418.80
其中：交易所市场	804,418.80
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	74,795.19
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	984,493.36

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富新兴消费股票 A		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	203,128,435.16	203,128,435.16
本期申购	38,036,731.08	38,036,731.08
本期赎回（以“-”号填列）	-50,046,193.49	-50,046,193.49
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	191,118,972.75	191,118,972.75
汇添富新兴消费股票 C		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,630,982.81	3,630,982.81
本期申购	1,026,814.03	1,026,814.03
本期赎回（以“-”号填列）	-2,151,248.39	-2,151,248.39
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,506,548.45	2,506,548.45
汇添富新兴消费股票 D		
项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	254,367.25	254,367.25
本期申购	8,252,995.49	8,252,995.49
本期赎回（以“-”号填列）	-596,760.13	-596,760.13
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,910,602.61	7,910,602.61

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富新兴消费股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	194,745,254.91	-64,106,055.58	130,639,199.33
本期利润	-3,684,445.82	-26,377,692.01	-30,062,137.83

本期基金份额交易产生的变动数	-13,218,048.18	9,098,924.41	-4,119,123.77
其中：基金申购款	37,047,972.53	-11,953,138.97	25,094,833.56
基金赎回款	-50,266,020.71	21,052,063.38	-29,213,957.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	177,842,760.91	-81,384,823.18	96,457,937.73
汇添富新兴消费股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,459,165.11	-1,148,728.09	2,310,437.02
本期利润	-97,804.63	-220,657.30	-318,461.93
本期基金份额交易产生的变动数	-1,054,909.02	301,606.93	-753,302.09
其中：基金申购款	1,022,895.61	-306,845.23	716,050.38
基金赎回款	-2,077,804.63	608,452.16	-1,469,352.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,306,451.46	-1,067,778.46	1,238,673.00
汇添富新兴消费股票 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	242,671.53	-80,486.85	162,184.68
本期利润	-562,601.49	-1,745,604.07	-2,308,205.56
本期基金份额交易产生的变动数	7,620,974.07	-1,545,070.00	6,075,904.07
其中：基金申购款	8,207,421.18	-1,704,407.97	6,503,013.21
基金赎回款	-586,447.11	159,337.97	-427,109.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,301,044.11	-3,371,160.92	3,929,883.19

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	54,762.04
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	13,005.56
其他	1,501.09
合计	69,268.69

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,231,213,095.99
减：卖出股票成本总额	1,230,930,942.96
减：交易费用	3,212,325.73
买卖股票差价收入	-2,930,172.70

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	449.89
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-
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	449.89

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,801,870.95
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	1,801,870.95

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-28,343,953.38
——股票投资	-28,326,288.48
——债券投资	-17,664.90
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-28,343,953.38

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

基金赎回费收入	148,344.34
替代损益	-
其他	-
合计	148,344.34

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	480.00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	103,382.56

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	113,103,539.66	4.61	23,912,321.84	1.70

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	81,581.23	4.57	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	22,125.85	2.12	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,833,522.04	2,766,827.98
其中：支付销售机构的客户维护费	824,885.74	849,506.36

注：基金管理费按前一日的基金资产净值 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	472,253.67	461,138.01

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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			
	汇添富新兴消费股票 A	汇添富新兴消费股票 C	汇添富新兴消费股票 D	合计
中国工商银行股份有限公司	-	1.38	-	1.38
汇添富基金管理股份有限公司	-	-	736.68	736.68
合计	-	1.38	736.68	738.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	汇添富新兴消费股票 A	汇添富新兴消费股票 C	汇添富新兴消费股票 D	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	1.14	27.87	29.01
合计	-	1.14	27.87	29.01

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.6%，D 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.6% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

本基金 D 类基金份额的销售服务费按前一日 D 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 D 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 D 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	39,568,534.52	54,762.04	26,130,608.63	51,392.48

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	
001287	中电港	2023年03月	6个月	新股流通	11.88	21.02	508	6,035.04	10,678.16	

		30日		受限						
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	
001380	华纬科技	2023年05月09日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	
300804	广康生化	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	
301170	锡南科技	2023年06月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	228	7,752.00	7,964.04	
301202	朗威股份	2023年06月28日	5个交易日	新股流通受限	25.82	25.82	2,563	66,176.66	66,176.66	

301202	朗威股份	2023年06月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	285	7,358.70	7,358.70
301203	国泰环保	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00
301225	恒勃股份	2023年06月08日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	328	11,696.48	10,909.28
301232	飞沃科技	2023年06月08日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	157	11,382.50	9,171.94
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	691	21,317.35	16,328.33
301261	恒工精密	2023年06月29日	7个交易日	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50
301261	恒工精密	2023年06月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20
301262	海看	2023年	6个月	新股	30.22	25.50	420	12,692.40	10,710.00

	股份	06月13日	月	流通受限						
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	
301292	海科新源	2023年06月29日	6个交易日	新股流通受限	19.99	19.99	4,961	99,170.39	99,170.39	
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	552	11,034.48	11,034.48	
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	2,645	13,225.00	23,699.20	
301305	朗坤环境	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	556	14,039.00	10,947.64	
301307	美利信	2023年04月	6个月	新股流通	32.34	31.86	467	15,102.78	14,878.62	

		14 日		受 限						
301310	鑫 宏 业	2023 年 05 月 26 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	67.28	65.43	294	19,780.32	19,236.42	
301315	威 士 顿	2023 年 06 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	
301317	鑫 磊 股 份	2023 年 01 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	
301320	豪 江 智 能	2023 年 06 月 01 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	
301337	亚 华 电 子	2023 年 05 月 16 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	
301345	涛 涛 车 业	2023 年 03 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	73.45	46.64	130	9,548.50	6,063.20	
301355	南 王 科 技	2023 年 06 月 02 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	

301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	470	11,171.90	20,158.30
301360	荣旗科技	2023年04月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45
301376	致欧科技	2023年06月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	392	9,666.72	8,823.92
301382	蜂助手	2023年05月09日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	379	9,020.20	12,446.36
301383	天键股份	2023年05月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	348	16,063.68	12,430.56
301397	溯联股份	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	223	11,879.21	8,964.60
301399	英特	2023年	6个月	新股	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01

	科技	05月16日	月	流通受限						
301428	世纪恒通	2023年05月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	472	9,435.28	7,976.80	
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个交易日	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	
601061	中信金属	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,205	7,928.90	9,133.90	
601065	江西省盐业集团	2023年03月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	372	3,853.92	4,404.48	
601133	柏诚系	2023年03	6个月	新股流	11.66	12.26	351	4,092.66	4,303.26	

	统 股 份 公 司	月 31 日		通 受 限						
603135	中 重 科 技	2023 年 03 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	17.80	17.89	375	6,675.00	6,708.75	
603137	恒 尚 节 能	2023 年 04 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	
688146	中 船 派 瑞 特 气	2023 年 04 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	36.15	38.13	338	12,218.70	12,887.94	
688334	西 高 院	2023 年 06 月 09 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	14.16	16.21	693	9,812.88	11,233.53	
688352	顾 中 科 技	2023 年 04 月 11 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	12.10	12.07	1,051	12,717.10	12,685.57	
688361	中 科 飞 测	2023 年 05 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	23.60	64.67	439	10,360.40	28,390.13	
688433	华 曙 高	2023 年 04	6 个 月	新 股 流	26.66	31.50	316	8,424.56	9,954.00	

	科	月 07 日		通 受 限						
688435	英方软件	2023 年 01 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	38.66	73.03	2,728	105,464.48	199,225.84	
688443	智翔金泰	2023 年 06 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	37.88	29.49	572	21,667.36	16,868.28	
688458	美芯晟科技	2023 年 05 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	75.00	90.76	147	11,025.00	13,341.72	
688472	阿特斯阳光电力	2023 年 06 月 02 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.10	17.04	1,190	13,209.00	20,277.60	
688479	用友汽车信息科技	2023 年 05 月 04 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	33.99	29.49	255	8,667.45	7,519.95	
688484	南芯科技	2023 年 03 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	39.99	36.71	335	13,396.65	12,297.85	
688507	索辰	2023 年	6 个	新 股	166.35	122.11	93	15,470.28	11,356.23	

	科技	04月10日	月	流通受限						
688523	航天环宇科技	2023年05月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	
688535	华海诚科新材料	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	
688552	航天南湖	2023年05月08日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	502	10,627.34	11,797.00	
688562	航天软件股份	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	
688581	安杰思医学	2023年05月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	92	11,573.60	10,858.76	
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	375	10,027.50	15,255.00	
688620	安凯微	2023年06月	6个月	新股流	10.68	12.34	901	9,622.68	11,118.34	

	电子	月 15 日		通 受 限						
688623	双 元 科 技	2023 年 05 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	125.88	86.79	87	10,951.56	7,550.73	
688629	四 川 华 丰 科 技	2023 年 06 月 16 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	
688631	莱 斯 信 息	2023 年 06 月 19 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	25.28	29.87	254	6,421.12	7,586.98	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代 码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代 码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“科源制药”（证券代码：301281）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 97 股（根据山东科源制药股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告，科源制药以公司现有总股本 77,350,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 4 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 4 股，除权除息日为

2023 年 5 月 26 日。)。本基金持有的流通受限股票“索辰科技”（证券代码：688507）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 30 股（根据上海索辰信息科技股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告，索辰科技以公司现有总股本 41,333,400 股为基数，向全体股东每股派 0.15 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每股转增 0.48 股，除权除息日为 2023 年 6 月 20 日。))。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	39,568,534.52	-	-	-	-	-	39,568,534.52
结算备付金	625,770.89	-	-	-	-	-	625,770.89
存出保证金	202,480.04	-	-	-	-	-	202,480.04
交易性金融资产	622,648.63	-	-	-	-	282,068,370.70	282,691,019.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,673,780.69	1,673,780.69
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收	-	-	-	-	-	95,405.35	95,405.35

申购款							
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	41,019,434.08	-	-	-	-	283,837,556.74	324,856,990.82
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	1,928,988.32	1,928,988.32
应付赎回款	-	-	-	-	-	18,286,423.27	18,286,423.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	418,769.59	418,769.59
应付托管费	-	-	-	-	-	69,794.94	69,794.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,901.26	5,901.26
应付投资	-	-	-	-	-	-	-

顾问费							
应交税费	-	-	-	-	-	2.35	2.35
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	984,493.36	984,493.36
负债总计	-	-	-	-	-	21,694,373.09	21,694,373.09
利率敏感度缺口	41,019,434.08	-	-	-	-	262,143,183.65	303,162,617.73
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,051,979.58	-	-	-	-	-	21,051,979.58
结算备付金	1,427,153.23	-	-	-	-	-	1,427,153.23
存出保证金	157,119.43	-	-	-	-	-	157,119.43
交易性金融资产	639,850.97	-	-	-	-	311,626,734.65	312,266,585.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	6,228,314.22	6,228,314.22
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	305,490.86	305,490.86
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,276,103.21	-	-	-	-	318,160,539.73	341,436,642.94
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	35,424.99	35,424.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	425,686.95	425,686.95
应付	-	-	-	-	-	70,947.83	70,947.83

托管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,286.46	2,286.46
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	2.43	2.43
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	776,688.03	776,688.03
负债总计	-	-	-	-	-	1,311,036.69	1,311,036.69
利率敏感度缺口	23,276,103.21	-	-	-	-	316,849,503.04	340,125,606.25

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	282,068,370.70	93.04	311,626,734.65	91.62
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	622,648.63	0.21	639,850.97	0.19
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	282,691,019.33	93.25	312,266,585.62	91.81

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证主要消费指数上涨 5%	9,882,293.24	13,212,181.73
	中证主要消费指数下跌 5%	-9,882,293.24	-13,212,181.73

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日
第一层次	281,415,822.15
第二层次	384,387.17
第三层次	890,810.01
合计	282,691,019.33

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	282,068,370.70	86.83
	其中：股票	282,068,370.70	86.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	622,648.63	0.19
	其中：债券	622,648.63	0.19
	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	40,194,305.41	12.37
8	其他各项资产	1,971,666.08	0.61
9	合计	324,856,990.82	100.00

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	61,952.58	0.02
B	采矿业	108,390.77	0.04
C	制造业	195,272,549.86	64.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	201,579.00	0.07
E	建筑业	227,175.76	0.07
F	批发和零售业	607,664.60	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	139,285.98	0.05
H	住宿和餐饮业	117,119.70	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,742,737.67	9.15
J	金融业	235,643.55	0.08
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26,749,794.09	8.82
M	科学研究和技术服务业	1,060,105.47	0.35

N	水利、环境和公共设施管理业	778,719.75	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,571.97	0.01
Q	卫生和社会工作	619,837.60	0.20
R	文化、体育和娱乐业	28,121,242.35	9.28
S	综合	-	-
	合计	282,068,370.70	93.04

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000568	泸州老窖	116,100	24,331,077.00	8.03
2	600085	同仁堂	347,100	19,979,076.00	6.59
3	000858	五粮液	118,900	19,448,473.00	6.42
4	603198	迎驾贡酒	278,800	17,787,440.00	5.87
5	300364	中文在线	880,900	15,697,638.00	5.18
6	002027	分众传媒	2,203,499	15,005,828.19	4.95
7	603369	今世缘	283,900	14,989,920.00	4.94
8	300893	松原股份	500,650	12,881,724.50	4.25
9	000860	顺鑫农业	366,300	12,340,647.00	4.07
10	600633	浙数文化	760,500	12,327,705.00	4.07
11	300413	芒果超媒	355,255	12,153,273.55	4.01
12	300496	中科创达	125,900	12,130,465.00	4.00
13	600702	舍得酒业	95,300	11,812,435.00	3.90
14	300280	紫天科	245,300	11,717,981.00	3.87

		技			
15	600809	山西汾酒	41,300	7,643,391.00	2.52
16	688630	芯碁微装	89,686	7,535,417.72	2.49
17	003021	兆威机电	83,800	7,351,774.00	2.43
18	300666	江丰电子	98,600	6,700,856.00	2.21
19	002068	黑猫股份	534,100	6,339,767.00	2.09
20	600559	老白干酒	257,100	6,301,521.00	2.08
21	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.09
22	688496	清越科技	12,000	238,560.00	0.08
23	688387	中信科移动	28,033	234,075.55	0.08
24	301368	丰立智能	3,368	233,031.92	0.08
25	301286	侨源股份	7,839	231,250.50	0.08
26	688539	高华科技	4,800	222,720.00	0.07
27	688472	阿特斯阳光电力	11,894	216,803.04	0.07
28	688486	龙迅股份	1,887	207,664.35	0.07
29	301358	湖南裕能	4,694	206,056.54	0.07
30	301310	鑫宏业	2,939	201,424.02	0.07
31	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.07
32	688562	航天软件股份	7,254	195,390.66	0.06
33	688400	凌云光技术	6,374	194,279.52	0.06
34	301185	鸥玛软件	5,776	190,723.52	0.06
35	301317	鑫磊股份	6,936	186,571.14	0.06

36	688110	东芯股份	5,150	185,915.00	0.06
37	688403	汇成股份	15,131	184,900.82	0.06
38	688410	山外山血液净化	3,478	182,595.00	0.06
39	688443	智翔金泰	5,719	175,962.05	0.06
40	688582	芯动联科	3,749	173,326.90	0.06
41	688147	微导纳米科技	3,272	172,696.16	0.06
42	301399	英特科技	2,925	171,714.01	0.06
43	301103	何氏眼科	3,963	166,287.48	0.05
44	301339	通行宝	6,485	162,968.05	0.05
45	301268	铭利达	3,890	162,874.30	0.05
46	688629	四川华丰科技	7,073	160,957.02	0.05
47	301187	欧圣电气	8,642	159,617.74	0.05
48	301307	美利信	4,668	156,914.43	0.05
49	301391	卡莱特	1,334	156,304.78	0.05
50	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.05
51	688432	有研硅	9,901	155,346.69	0.05
52	688697	纽威数控装备	5,837	150,769.71	0.05
53	301396	宏景科技	4,563	148,981.95	0.05
54	688206	概伦电子	5,240	146,929.60	0.05
55	301382	蜂助手	3,786	144,092.84	0.05
56	301366	一博科技	3,312	143,906.40	0.05
57	688195	腾景科技	2,693	143,886.99	0.05
58	688146	中船派瑞特气	3,380	141,260.34	0.05
59	688458	美芯晟科技	1,470	140,574.63	0.05

60	301179	泽宇智能	4,171	140,562.70	0.05
61	301363	美好医疗	3,194	140,504.06	0.05
62	688141	杰华特微电子	3,580	139,978.00	0.05
63	301338	凯格精机	3,595	139,845.50	0.05
64	688352	颀中科技	10,506	139,760.77	0.05
65	688237	超卓航科	2,891	139,577.48	0.05
66	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.05
67	001287	中电港	5,075	137,549.42	0.05
68	688484	南芯科技	3,342	136,186.25	0.04
69	688073	毕得医药科技股份	1,924	136,180.72	0.04
70	301212	联盛化学	4,158	136,132.92	0.04
71	301267	华夏眼科	2,204	134,333.80	0.04
72	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.04
73	301377	鼎泰高科	5,723	131,629.00	0.04
74	301383	天键股份	3,477	129,455.16	0.04
75	688728	格科微有限公司	8,176	129,344.32	0.04
76	688376	美埃科技	3,274	129,290.26	0.04
77	688292	浩瀚深度信息技术	4,503	129,236.10	0.04
78	301139	元道通信	4,464	128,964.96	0.04
79	300879	大叶股份	6,766	128,756.98	0.04
80	688351	微创电生理股份	6,613	128,755.11	0.04

81	301199	迈赫股份	4,014	127,805.76	0.04
82	688552	航天南湖	5,017	125,981.35	0.04
83	301389	隆扬电子	6,912	125,660.16	0.04
84	688291	金橙子科技	3,961	125,405.26	0.04
85	688523	航天环宇科技	4,717	125,405.25	0.04
86	688107	安路科技	2,254	124,849.06	0.04
87	301277	新天地	6,396	124,785.96	0.04
88	301052	果麦文化	2,520	124,286.40	0.04
89	688503	聚和材料股份公司	1,273	124,117.50	0.04
90	301082	久盛电气	6,858	123,786.90	0.04
91	688150	莱特光电股份	5,506	123,334.40	0.04
92	688334	西高院	6,921	123,088.41	0.04
93	301379	天山电子	4,321	120,685.53	0.04
94	688507	索辰科技	928	120,432.28	0.04
95	688620	安凯微电子	9,001	119,820.34	0.04
96	688084	晶品特装	1,375	119,446.25	0.04
97	301048	金鹰重工	8,424	117,683.28	0.04
98	301073	君亭酒店	3,222	117,119.70	0.04
99	301225	恒勃股份	3,279	116,820.67	0.04
100	688259	创耀通信科技	1,462	115,717.30	0.04
101	688121	卓然技术	3,092	115,640.80	0.04
102	301262	海看股份	4,196	115,494.00	0.04

103	301305	朗坤环境	5,558	115,039.26	0.04
104	301109	军信股份	6,889	113,737.39	0.04
105	301280	珠城科技	3,172	113,430.72	0.04
106	688581	安杰思医学	920	112,280.48	0.04
107	301292	海科新源	5,513	110,204.87	0.04
108	688323	瑞华泰薄膜科技	4,513	108,041.22	0.04
109	688768	容知日新	1,342	107,185.54	0.04
110	688433	华曙高科	3,158	106,582.00	0.04
111	688283	坤恒顺维	1,595	106,099.40	0.03
112	601061	中信金属	12,046	104,317.88	0.03
113	301313	凡拓数创	2,464	104,301.12	0.03
114	688663	新风光科技	3,279	104,239.41	0.03
115	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
116	301235	华康医疗	3,267	103,955.94	0.03
117	688231	隆达超合金股份	3,613	103,078.89	0.03
118	688293	奥浦迈生物	2,139	101,966.13	0.03
119	301181	标榜股份	3,333	100,289.97	0.03
120	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.03
121	301335	天元宠物	4,148	98,888.32	0.03
122	301306	西测测试	2,543	98,795.55	0.03
123	688209	英集芯科技	6,049	98,719.68	0.03

124	301136	招标股份	7,172	98,399.84	0.03
125	688230	芯导科技	2,135	96,736.85	0.03
126	688535	华海诚科新材料	1,607	96,642.01	0.03
127	688426	康为世纪生物科技	3,172	95,794.40	0.03
128	301398	星源卓镁	2,549	95,587.50	0.03
129	688143	长盈通光电	2,519	94,966.30	0.03
130	301232	飞沃科技	1,561	94,380.70	0.03
131	301397	溯联股份	2,223	93,764.60	0.03
132	688459	哈铁科技	9,657	93,093.48	0.03
133	301135	瑞德智能	3,376	92,569.92	0.03
134	301231	荣信文化	2,744	92,308.16	0.03
135	301110	青木股份	1,830	92,286.90	0.03
136	301376	致欧科技	3,913	92,271.62	0.03
137	301197	工大科雅	3,791	91,363.10	0.03
138	688353	华盛锂电	2,448	90,527.04	0.03
139	301373	凌玮科技	2,764	89,376.38	0.03
140	301365	矩阵股份	5,418	89,180.28	0.03
141	688667	菱电电控	1,191	88,884.33	0.03
142	301200	大族数控	2,227	88,812.76	0.03
143	301116	益客食品	5,764	88,765.60	0.03
144	301126	达嘉维康	6,615	88,641.00	0.03

145	301281	科源制药	3,368	88,415.20	0.03
146	301096	百诚医药	1,458	88,369.38	0.03
147	301290	东星医疗	2,720	87,176.00	0.03
148	301176	逸豪新材	5,055	86,844.90	0.03
149	688325	赛微微电子	2,203	86,027.15	0.03
150	301207	华兰疫苗	2,571	85,511.46	0.03
151	301356	天振股份	3,863	84,599.70	0.03
152	688257	新锐股份	3,179	84,275.29	0.03
153	301170	锡南科技	2,277	84,186.84	0.03
154	301118	恒光股份	3,142	83,985.66	0.03
155	301123	奕东电子	3,275	83,643.50	0.03
156	301439	泓淋电力	4,711	83,600.56	0.03
157	301157	华塑科技	1,498	83,481.42	0.03
158	688184	帕瓦股份	2,661	83,182.86	0.03
159	688115	思林杰科技	2,153	83,170.39	0.03
160	301148	嘉戎技术	3,864	82,612.32	0.03
161	301316	慧博云通	3,584	81,894.40	0.03
162	301285	鸿日达	5,643	81,767.07	0.03
163	688631	莱斯信息	2,531	81,726.10	0.03
164	301028	东亚机械	7,329	81,718.35	0.03
165	688275	万润新能源	903	81,567.99	0.03
166	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.03

167	300930	屹通新材	3,220	80,339.00	0.03
168	601059	信达证券	5,628	80,255.28	0.03
169	688307	中润光学	2,455	80,253.95	0.03
170	688162	巨一科技	1,928	79,973.44	0.03
171	301203	国泰环保	2,243	79,964.22	0.03
172	301161	唯万密封	3,460	79,960.60	0.03
173	688479	用友汽车信息科技	2,544	79,554.78	0.03
174	688623	双元科技	868	79,301.20	0.03
175	300814	中富电路	3,280	79,015.20	0.03
176	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.03
177	301227	森鹰窗业	2,840	78,753.20	0.03
178	301388	欣灵电气	2,920	78,402.00	0.03
179	300994	久祺股份	5,034	77,724.96	0.03
180	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.03
181	688163	赛伦生物	3,607	77,009.45	0.03
182	301283	聚胶股份	2,169	76,956.12	0.03
183	603135	中重科技	3,743	75,415.95	0.02
184	301202	朗威股份	2,848	73,535.36	0.02
185	688173	希荻微电子	3,210	73,444.80	0.02
186	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
187	688480	赛恩斯环保	2,302	71,269.92	0.02
188	301041	金百泽	2,150	71,208.00	0.02

189	688193	仁度生物	1,635	70,435.80	0.02
190	301092	争光股份	2,672	69,952.96	0.02
191	301011	华立科技	2,958	69,305.94	0.02
192	301093	华兰股份	2,003	69,303.80	0.02
193	301319	唯特偶	1,149	68,767.65	0.02
194	301233	盛帮股份	1,576	68,193.52	0.02
195	688448	南京磁谷科技	1,985	67,946.55	0.02
196	688420	天津美腾科技	1,754	67,932.42	0.02
197	688071	华依科技集团	1,101	67,326.15	0.02
198	601136	首创证券	4,739	67,151.63	0.02
199	301300	远翔新材	2,107	66,581.20	0.02
200	001301	尚太科技	1,164	65,544.84	0.02
201	301265	华新环保	5,629	65,408.98	0.02
202	688517	金冠电气	2,892	63,508.32	0.02
203	301038	深水规院	3,458	62,555.22	0.02
204	688659	元琛科技	3,671	62,150.03	0.02
205	301345	涛涛车业	1,292	61,502.22	0.02
206	688137	近岸蛋白	1,191	61,312.68	0.02
207	688226	威腾电气集团股份	2,693	58,761.26	0.02
208	688737	中自科技	1,492	58,173.08	0.02
209	688739	成大生物	1,729	56,987.84	0.02
210	300834	星辉环材	2,327	56,778.80	0.02

211	001269	欧晶科技	764	56,176.92	0.02
212	688211	中科微至	1,237	55,875.29	0.02
213	301098	金埔园林	4,603	55,466.15	0.02
214	688255	凯尔达机器人	1,636	55,394.96	0.02
215	301062	上海艾录	5,225	55,332.75	0.02
216	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.02
217	688260	昀冢科技	2,990	54,956.20	0.02
218	688485	九州一轨环科	3,580	54,917.20	0.02
219	001380	华伟科技	1,694	54,899.76	0.02
220	688718	唯赛勃科技	3,145	54,439.95	0.02
221	301196	唯科科技	1,595	54,150.25	0.02
222	301349	信德新材	1,079	54,101.06	0.02
223	300774	倍杰特	4,435	51,623.40	0.02
224	601133	柏诚系统股份公司	3,508	51,374.13	0.02
225	688228	开普云信息科技	1,000	51,360.00	0.02
226	301309	万得凯	1,861	51,251.94	0.02
227	688501	青岛达能环保	2,287	50,885.75	0.02
228	688328	深科达智能装备	1,499	50,186.52	0.02
229	601065	江西省盐业集团	3,718	49,341.26	0.02
230	301068	大地海洋	1,436	48,263.96	0.02
231	301033	迈普医学	1,076	47,300.96	0.02

232	301007	德迈仕	3,022	46,629.46	0.02
233	301032	新柴股份	5,124	45,859.80	0.02
234	300910	瑞丰新材	901	45,320.30	0.01
235	301072	中捷精工	1,802	45,140.10	0.01
236	605376	博迁新材	1,421	44,590.98	0.01
237	301010	晶雪节能	2,172	44,069.88	0.01
238	688395	深圳正弦电气股份	1,627	43,261.93	0.01
239	301049	超越科技	1,954	43,183.40	0.01
240	688622	禾信仪器	1,204	42,742.00	0.01
241	300077	国民技术	3,200	42,560.00	0.01
242	301063	海锅股份	1,524	42,458.64	0.01
243	301239	普瑞眼科	417	40,899.36	0.01
244	600916	中国黄金	3,371	39,811.51	0.01
245	301053	远信工业	1,544	39,171.28	0.01
246	688296	和达科技	2,173	38,788.05	0.01
247	301079	邵阳液压	1,815	38,695.80	0.01
248	301036	双乐股份	2,047	38,340.31	0.01
249	688553	汇宇制药	2,544	37,981.92	0.01
250	301037	保立佳	2,115	37,689.30	0.01
251	301057	汇隆新材	2,173	37,462.52	0.01
252	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.01
253	001311	多利科技	649	37,272.07	0.01

254	688468	科美诊断	3,919	37,230.50	0.01
255	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.01
256	688267	中触媒股份	1,721	36,261.47	0.01
257	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
258	605090	九丰能源	1,526	34,075.58	0.01
259	300929	华骐环保	2,923	33,117.59	0.01
260	600955	维远股份	1,694	32,914.42	0.01
261	300854	中兰环保	2,026	32,213.40	0.01
262	688038	武汉中科通达	2,132	31,894.72	0.01
263	605186	健麾信息	626	30,987.00	0.01
264	605020	永和股份	1,190	30,713.90	0.01
265	688681	科汇电力自动化	1,899	30,687.84	0.01
266	001338	永顺泰	1,649	30,407.56	0.01
267	688367	工大高科	1,717	30,356.56	0.01
268	001258	立新能源	3,188	30,254.12	0.01
269	600927	永安期货	1,859	30,227.34	0.01
270	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.01
271	605598	上海港湾	553	29,120.98	0.01
272	300870	欧陆通	478	28,646.54	0.01
273	601089	福元医药	1,749	28,508.70	0.01
274	688361	中科飞测	439	28,390.13	0.01
275	301175	中科环保	4,470	27,848.10	0.01

276	688067	爱威科技	1,259	27,698.00	0.01
277	603324	盛剑环境	733	27,634.10	0.01
278	601921	浙版传媒	3,154	27,408.26	0.01
279	601156	东航物流	2,090	27,170.00	0.01
280	603071	物产环能	1,627	26,991.93	0.01
281	300887	谱尼测试	680	26,914.40	0.01
282	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.01
283	605337	李子园	1,434	26,213.52	0.01
284	300867	圣元环保	1,498	26,110.14	0.01
285	001213	中铁特货	5,818	25,657.38	0.01
286	605507	国邦医药	1,202	25,566.54	0.01
287	603171	税友股份	637	25,467.26	0.01
288	603255	鼎际得股份	488	24,770.88	0.01
289	001367	海森药业	549	24,687.92	0.01
290	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.01
291	605060	联德股份	883	24,247.18	0.01
292	301311	昆船智能	820	24,173.60	0.01
293	001339	智微智能	812	24,092.04	0.01
294	605167	利柏特	2,471	23,919.28	0.01
295	688272	*ST 富吉瑞光电	1,263	23,820.18	0.01
296	001308	康冠科技	867	23,807.82	0.01
297	301301	川宁生物	2,645	23,699.20	0.01
298	603211	晋拓科	1,286	23,636.68	0.01

		技股份			
299	003029	吉大正元	716	23,234.20	0.01
300	001322	箭牌家居	1,345	22,515.30	0.01
301	001227	兰州银行	7,868	22,502.48	0.01
302	603191	望变电气	1,149	22,348.05	0.01
303	301039	中集车辆	1,672	22,120.56	0.01
304	688670	金迪克生物	466	21,939.28	0.01
305	605016	百龙创园	872	21,590.72	0.01
306	001314	亿道信息	508	21,478.24	0.01
307	001236	弘业期货	1,399	21,446.67	0.01
308	603206	嘉环科技	1,210	20,872.50	0.01
309	300872	天阳科技	1,341	20,839.14	0.01
310	601022	宁波远洋	1,983	20,603.37	0.01
311	605089	味知香	511	20,082.30	0.01
312	003040	楚天龙	1,101	19,972.14	0.01
313	300869	康泰医学	862	19,791.52	0.01
314	001215	千味央厨	295	19,614.55	0.01
315	001323	慕思股份	573	19,459.08	0.01
316	301165	锐捷网络	315	19,441.80	0.01
317	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.01
318	301058	中粮科工	1,386	19,334.70	0.01
319	001201	东瑞股份	802	19,320.18	0.01
320	300982	苏文电能	317	19,197.52	0.01

321	003038	鑫铂股份	460	19,071.60	0.01
322	300972	万辰生物	430	19,066.20	0.01
323	605377	华旺科技	1,050	18,952.50	0.01
324	605011	杭州热电	525	18,574.50	0.01
325	605289	罗曼股份	474	18,158.94	0.01
326	003026	中晶科技	461	18,131.13	0.01
327	003028	振邦智能	432	18,061.92	0.01
328	600935	华塑股份	4,811	18,041.25	0.01
329	603122	合富中国	2,197	18,015.40	0.01
330	603235	天新药业	572	17,937.92	0.01
331	605305	中际联合	508	17,708.88	0.01
332	603209	兴通股份	833	17,667.93	0.01
333	603173	福斯达深冷	588	17,316.60	0.01
334	605286	同力日升	597	17,265.24	0.01
335	300973	立高食品	252	17,241.84	0.01
336	605339	南侨食品	864	17,202.24	0.01
337	001205	盛航股份	808	17,145.76	0.01
338	605268	王力安防	1,642	16,797.66	0.01
339	001208	华菱线缆	1,754	16,627.92	0.01
340	300996	普联软件	540	16,578.00	0.01
341	300878	维康药业	722	16,389.40	0.01
342	301260	格力博	691	16,328.33	0.01

343	605098	行动教育	405	16,033.95	0.01
344	605296	神农集团	739	15,829.38	0.01
345	603282	亚光科技股份	457	15,771.07	0.01
346	301367	怡和嘉业	106	15,724.04	0.01
347	605068	明新旭腾	641	15,678.86	0.01
348	003037	三和管桩	1,274	15,670.20	0.01
349	605277	新亚电子	966	15,610.56	0.01
350	003019	宸展光电	760	15,580.00	0.01
351	001216	华瓷股份	1,178	15,502.48	0.01
352	001318	阳光乳业	1,142	15,451.26	0.01
353	300909	汇创达	579	15,297.18	0.01
354	300871	回盛生物	927	15,276.96	0.01
355	603759	海天股份	1,656	15,168.96	0.01
356	605162	新中港	1,377	14,802.75	0.00
357	001228	永泰运	383	14,718.69	0.00
358	603230	内蒙新华	1,140	14,706.00	0.00
359	003025	思进智能	898	14,502.70	0.00
360	603070	万控智造	775	14,484.75	0.00
361	001298	好上好	584	14,454.00	0.00
362	001217	华尔泰	1,239	14,421.96	0.00
363	603190	烟台亚通精工机械	470	14,382.00	0.00
364	605389	长龄液压	498	14,377.26	0.00
365	605208	永茂泰	1,405	14,078.10	0.00
366	601528	瑞丰银行	2,899	14,060.15	0.00

367	300884	狄耐克	1,049	13,888.76	0.00
368	603237	五芳斋 实业	455	13,800.15	0.00
369	603057	上海紫 燕食品	549	13,796.37	0.00
370	301069	凯盛新 材	539	13,712.16	0.00
371	301327	华宝新 能	173	13,686.03	0.00
372	300997	欢乐家	928	13,520.96	0.00
373	605183	确成股 份	741	13,412.10	0.00
374	605169	洪通燃 气	1,293	13,279.11	0.00
375	605056	咸亨国 际	933	13,220.61	0.00
376	603162	海通发 展	774	13,196.70	0.00
377	605151	西上海	723	13,158.60	0.00
378	603153	上海建 科集团	740	13,135.00	0.00
379	603097	江苏华 辰	577	13,074.82	0.00
380	605599	菜百股 份	980	12,945.80	0.00
381	300908	仲景食 品	285	12,924.75	0.00
382	301015	百洋医 药	462	12,825.12	0.00
383	603051	鹿山新 材	272	12,737.76	0.00
384	605300	佳禾食 品	576	12,522.24	0.00
385	605580	恒盛能 源	916	12,356.84	0.00
386	603176	汇通集 团	1,924	12,313.60	0.00
387	300962	中金辐 照	657	12,285.90	0.00
388	605319	无锡振 华	764	12,124.68	0.00
389	605500	森林包 装	1,579	11,779.34	0.00

390	300911	亿田智能	309	11,732.73	0.00
391	003030	祖名股份	480	11,587.20	0.00
392	001229	魅视科技	347	11,555.10	0.00
393	603170	宝立食品科技	542	11,522.92	0.00
394	301180	万祥科技	654	11,464.62	0.00
395	605259	绿田机械	295	11,451.90	0.00
396	001207	联科科技	682	11,403.04	0.00
397	003042	中农联合	546	11,313.12	0.00
398	603836	海程邦达	733	11,266.21	0.00
399	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
400	001319	铭科精技	536	11,234.56	0.00
401	601279	英利汽车	2,004	11,102.16	0.00
402	300898	熊猫乳品	496	11,100.48	0.00
403	001218	丽臣实业	490	11,078.90	0.00
404	001317	三羊马	300	11,070.00	0.00
405	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
406	605378	野马电池	473	11,025.63	0.00
407	300993	玉马遮阳	959	10,980.55	0.00
408	003027	同兴环保	523	10,904.55	0.00
409	603130	云中马股份	480	10,900.80	0.00
410	605177	东亚药业	439	10,816.96	0.00
411	301201	诚达药业	262	10,794.40	0.00

412	301017	漱玉平民	555	10,567.20	0.00
413	003033	征和工业	301	10,565.10	0.00
414	603216	梦天家居	772	10,522.36	0.00
415	003036	泰坦股份	776	10,460.48	0.00
416	300891	惠云钛业	1,143	10,447.02	0.00
417	605122	四方新材	703	10,432.52	0.00
418	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
419	300986	志特新材	370	10,360.00	0.00
420	300968	格林精密	1,162	10,330.18	0.00
421	605179	一鸣食品	939	10,216.32	0.00
422	001288	运机集团	537	10,149.30	0.00
423	301013	利和兴	707	10,110.10	0.00
424	001266	宏英智能	346	10,051.30	0.00
425	300877	金春股份	569	10,037.16	0.00
426	605005	合兴股份	634	10,036.22	0.00
427	605566	福莱茵特	435	10,005.00	0.00
428	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
429	003018	金富科技	1,027	9,931.09	0.00
430	001212	中旗新材	400	9,876.00	0.00
431	001331	胜通能源	539	9,847.53	0.00
432	001313	粤海饲料	1,232	9,732.80	0.00
433	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
434	605365	立达信	645	9,662.10	0.00

435	603213	镇洋发展	799	9,532.07	0.00
436	603511	爱慕股份	553	9,511.60	0.00
437	001268	联合精密	409	9,492.89	0.00
438	301046	能辉科技	290	9,483.00	0.00
439	605488	福莱新材	603	9,461.07	0.00
440	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
441	605299	舒华体育	738	9,372.60	0.00
442	001206	依依股份	629	9,309.20	0.00
443	605086	龙高股份	443	9,205.54	0.00
444	001222	源飞宠物	608	9,199.04	0.00
445	001230	劲旅环境	375	9,191.25	0.00
446	300876	蒙泰高新	350	9,117.50	0.00
447	605007	五洲特纸	598	9,065.68	0.00
448	300614	百川畅银	329	9,011.31	0.00
449	603280	南方路面机械	363	8,922.54	0.00
450	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
451	003004	声迅股份	306	8,834.22	0.00
452	605258	协和电子	340	8,833.20	0.00
453	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
454	603151	邦基科技股份	535	8,741.90	0.00
455	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
456	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00

457	301177	迪阿股份	225	8,646.75	0.00
458	301078	孩子王	756	8,641.08	0.00
459	300933	中辰股份	1,112	8,562.40	0.00
460	003032	传智教育	586	8,538.02	0.00
461	001296	长江材料	403	8,467.03	0.00
462	001231	农心科技	355	8,445.45	0.00
463	001219	青岛食品	460	8,390.40	0.00
464	001210	金房能源	373	8,377.58	0.00
465	605196	华通线缆	1,172	8,344.64	0.00
466	605189	富春染织	506	8,303.46	0.00
467	605287	德才股份	349	8,271.30	0.00
468	603182	嘉华生物科技股份有限公司	546	8,255.52	0.00
469	605298	必得科技	508	8,107.68	0.00
470	605567	春雪食品	629	8,070.07	0.00
471	605180	华生科技	649	8,028.13	0.00
472	001209	洪兴股份	450	8,014.50	0.00
473	003041	真爱美家	503	7,977.58	0.00
474	605033	美邦股份	423	7,910.10	0.00
475	003023	彩虹集团	385	7,896.35	0.00
476	300967	晓鸣股份	507	7,736.82	0.00
477	300952	恒辉安防	340	7,670.40	0.00
478	001336	楚环科技	274	7,666.52	0.00

479	001234	泰慕士	333	7,592.40	0.00
480	603048	浙江黎明	464	7,470.40	0.00
481	300945	曼卡龙	474	7,356.48	0.00
482	300981	中红医疗	482	7,302.30	0.00
483	301026	浩通科技	203	7,251.16	0.00
484	300889	爱克股份	479	7,170.63	0.00
485	605155	西大门	490	7,109.90	0.00
486	300950	德固特	329	6,974.80	0.00
487	605069	正和生态	790	6,912.50	0.00
488	605055	迎丰股份	1,146	6,830.16	0.00
489	300991	创益通	406	6,824.86	0.00
490	001202	炬申股份	459	6,774.84	0.00
491	605303	园林股份	610	6,771.00	0.00
492	605577	龙版传媒	588	6,697.32	0.00
493	603150	万朗磁塑	250	6,590.00	0.00
494	300943	春晖智控	382	6,478.72	0.00
495	300971	博亚精工	245	6,431.25	0.00
496	300966	共同药业	286	6,392.10	0.00
497	605138	盛泰集团	723	6,304.56	0.00
498	300892	品渥食品	272	6,228.80	0.00
499	301012	扬电科技	238	6,152.30	0.00
500	300948	冠中生态	380	5,741.80	0.00
501	300942	易瑞生物	443	5,533.07	0.00
502	301016	雷尔伟	275	5,516.50	0.00
503	300958	建工修	300	5,322.00	0.00

		复			
504	603939	益丰药房	140	5,180.00	0.00
505	301055	张小泉	355	5,051.65	0.00
506	300955	嘉亨家化	232	4,941.60	0.00
507	301025	读客文化	403	4,924.66	0.00
508	300992	泰福泵业	200	4,024.00	0.00
509	300995	奇德新材	191	3,896.40	0.00
510	301027	华蓝集团	286	3,514.94	0.00
511	688399	硕世生物	50	2,760.00	0.00
512	603919	金徽酒	100	2,348.00	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	300413	芒果超媒	69,433,237.44	20.41
2	600702	舍得酒业	61,431,797.00	18.06
3	002027	分众传媒	49,697,911.60	14.61
4	603369	今世缘	36,123,762.00	10.62
5	603198	迎驾贡酒	34,751,655.00	10.22
6	000568	泸州老窖	34,606,704.00	10.17
7	603983	丸美股份	32,540,446.00	9.57
8	600872	中炬高新	29,473,961.00	8.67
9	000860	顺鑫农业	26,046,601.00	7.66
10	600559	老白干酒	26,038,386.00	7.66
11	300068	南都电源	25,224,113.19	7.42
12	000681	视觉中国	24,310,947.00	7.15
13	603868	飞科电器	24,087,185.39	7.08
14	300666	江丰电子	23,892,650.18	7.02
15	300624	万兴科技	23,322,142.11	6.86
16	300474	景嘉微	21,814,919.00	6.41
17	000858	五粮液	21,697,424.00	6.38

18	300347	泰格医药	21,099,776.30	6.20
19	688630	芯碁微装	20,844,621.20	6.13
20	688363	华熙生物	20,791,939.51	6.11
21	300571	平治信息	20,532,051.00	6.04
22	600085	同仁堂	19,137,029.00	5.63
23	000063	中兴通讯	19,079,138.72	5.61
24	300459	汤姆猫	18,912,019.00	5.56
25	300418	昆仑万维	18,892,012.70	5.55
26	300496	中科创达	18,530,660.00	5.45
27	300364	中文在线	18,462,899.76	5.43
28	002463	沪电股份	17,479,258.34	5.14
29	000799	酒鬼酒	17,456,405.18	5.13
30	300604	长川科技	16,074,484.00	4.73
31	002351	漫步者	15,819,685.16	4.65
32	000034	神州数码	15,220,287.00	4.47
33	300893	松原股份	14,961,000.21	4.40
34	603222	济民医疗	14,849,836.05	4.37
35	600633	浙数文化	14,836,880.00	4.36
36	301165	锐捷网络	14,568,096.00	4.28
37	688385	复旦微电	14,313,756.63	4.21
38	300280	紫天科技	14,008,130.00	4.12
39	688008	澜起科技	13,705,273.10	4.03
40	603799	华友钴业	12,428,166.00	3.65
41	002236	大华股份	11,917,649.80	3.50
42	001330	博纳影业	11,884,229.00	3.49
43	003021	兆威机电	11,813,846.00	3.47
44	605117	德业股份	11,486,798.00	3.38
45	002291	遥望科技	11,453,653.00	3.37
46	600602	云赛智联	11,351,635.00	3.34
47	300763	锦浪科技	11,289,185.00	3.32
48	600809	山西汾酒	11,223,419.03	3.30
49	000938	紫光股份	11,106,233.00	3.27
50	002837	英维克	10,320,494.59	3.03
51	300820	英杰电气	10,275,151.52	3.02
52	600475	华光环能	8,836,451.75	2.60
53	002594	比亚迪	7,736,414.00	2.27
54	603529	爱玛科技	7,544,501.65	2.22
55	300037	新宙邦	7,144,031.00	2.10
56	301018	申菱环境	6,897,966.00	2.03

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600702	舍得酒业	60,509,960.00	17.79
2	300413	芒果超媒	57,665,985.36	16.95
3	688363	华熙生物	47,601,899.07	14.00
4	000568	泸州老窖	38,219,277.23	11.24
5	002027	分众传媒	34,785,265.00	10.23
6	603983	丸美股份	31,685,169.00	9.32
7	300418	昆仑万维	31,084,221.72	9.14
8	600872	中炬高新	28,596,225.80	8.41
9	000799	酒鬼酒	28,155,799.50	8.28
10	600809	山西汾酒	27,422,875.18	8.06
11	600519	贵州茅台	26,283,582.50	7.73
12	300624	万兴科技	24,815,248.88	7.30
13	000681	视觉中国	24,222,464.55	7.12
14	000858	五粮液	23,681,744.33	6.96
15	603868	飞科电器	22,756,434.79	6.69
16	300068	南都电源	22,322,183.80	6.56
17	300015	爱尔眼科	21,601,631.45	6.35
18	300459	汤姆猫	20,228,925.64	5.95
19	002463	沪电股份	20,159,964.90	5.93
20	002351	漫步者	19,975,709.73	5.87
21	300474	景嘉微	19,672,546.00	5.78
22	000063	中兴通讯	19,183,063.00	5.64
23	002304	洋河股份	19,057,307.50	5.60
24	603589	口子窖	18,869,229.50	5.55
25	301165	锐捷网络	18,548,658.07	5.45
26	001330	博纳影业	18,297,955.77	5.38
27	300666	江丰电子	17,296,117.70	5.09
28	000333	美的集团	17,233,074.00	5.07
29	000661	长春高新	16,766,371.00	4.93
30	300896	爱美客	16,682,818.40	4.90
31	603369	今世缘	16,655,029.50	4.90
32	000034	神州数码	15,876,152.90	4.67
33	603198	迎驾贡酒	15,715,666.00	4.62
34	300571	平治信息	15,604,112.00	4.59
35	300604	长川科技	15,568,763.00	4.58
36	688630	芯碁微装	14,715,476.82	4.33
37	002594	比亚迪	14,633,508.00	4.30
38	300347	泰格医药	14,319,143.00	4.21

39	600559	老白干酒	14,306,390.38	4.21
40	603222	济民医疗	13,892,300.20	4.08
41	603866	桃李面包	13,842,525.60	4.07
42	688008	澜起科技	13,674,613.23	4.02
43	002236	大华股份	13,352,457.00	3.93
44	000860	顺鑫农业	13,072,370.00	3.84
45	000938	紫光股份	12,849,489.96	3.78
46	603799	华友钴业	11,823,976.00	3.48
47	600602	云赛智联	11,635,843.00	3.42
48	605117	德业股份	10,987,461.00	3.23
49	688385	复旦微电	10,860,829.00	3.19
50	300763	锦浪科技	10,456,554.12	3.07
51	002837	英维克	9,801,867.19	2.88
52	300820	英杰电气	9,596,228.30	2.82
53	600475	华光环能	9,572,760.00	2.81
54	002291	遥望科技	8,772,424.84	2.58
55	603529	爱玛科技	8,212,802.20	2.41
56	300037	新宙邦	7,037,641.00	2.07
57	300496	中科创达	6,923,162.24	2.04

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,229,698,867.49
卖出股票收入（成交）总额	1,231,213,095.99

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
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）	622,648.63	0.21
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-

10	其他	-	-
11	合计	622,648.63	0.21

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	113652	伟 22 转债	5,830	622,648.63	0.21

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	202,480.04
2	应收清算款	1,673,780.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	95,405.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,971,666.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113652	伟 22 转债	622,648.63	0.21

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
汇添富新兴消费	10,605	18,021.59	69,274.08	0.04	191,049,698.67	99.96

股票 A						
汇添富新兴消费股票 C	178	14,081.73	0.00	0.00	2,506,548.45	100.00
汇添富新兴消费股票 D	20	395,530.13	7,761,182.38	98.11	149,420.23	1.89
合计	10,803	18,655.57	7,830,456.46	3.89	193,705,667.35	96.11

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富新兴消费股票 A	19,803.56	0.01
	汇添富新兴消费股票 C	6,453.78	0.26
	汇添富新兴消费股票 D	299.94	0.00
	合计	26,557.28	0.01

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	汇添富新兴消费股票 A	0

投资和研究生部门负责人持有本开放式基金	汇添富新兴消费股票 C	0
	汇添富新兴消费股票 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富新兴消费股票 A	0
	汇添富新兴消费股票 C	0
	汇添富新兴消费股票 D	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富新兴消费股票 A	汇添富新兴消费股票 C	汇添富新兴消费股票 D
基金合同生效日（2015 年 12 月 02 日）基金份额总额	2,891,766,352.32	-	-
本报告期期初基金份额总额	203,128,435.16	3,630,982.81	254,367.25
本报告期基金总申购份额	38,036,731.08	1,026,814.03	8,252,995.49
减：本报告期基金总赎回份额	50,046,193.49	2,151,248.39	596,760.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	191,118,972.75	2,506,548.45	7,910,602.61

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	2	347,535,546.22	14.17	250,678.28	14.04	
银河证券	2	244,203,323.80	9.95	176,144.65	9.87	
华泰证券	1	219,929,887.76	8.97	158,633.80	8.89	

安信证券	2	172,347,670.98	7.03	124,314.70	6.96	
中信建投证券	1	170,545,873.14	6.95	123,017.66	6.89	
中泰证券	2	152,401,555.86	6.21	109,925.86	6.16	
东方财富	2	149,149,766.56	6.08	107,581.66	6.03	
东方证券	3	113,103,539.66	4.61	81,581.23	4.57	
东北证券	2	93,880,315.66	3.83	67,715.53	3.79	
兴业证券	2	93,194,062.83	3.80	67,219.30	3.77	
西南证券	2	91,700,218.42	3.74	66,141.49	3.71	
国泰君安	2	85,442,573.92	3.48	61,629.20	3.45	
德邦证券	1	78,806,959.06	3.21	56,843.10	3.18	
招商证券	2	75,834,138.05	3.09	54,700.47	3.06	
上海证券	1	73,588,319.09	3.00	68,534.43	3.84	
长江证券	1	72,389,926.45	2.95	52,214.62	2.93	
方正证券	2	65,430,438.00	2.67	47,194.85	2.64	
平安证券	1	40,630,190.99	1.66	29,306.22	1.64	
信达证券	1	35,331,495.85	1.44	25,484.12	1.43	
西部证券	1	32,019,978.20	1.31	23,095.71	1.29	
瑞银证券	1	20,763,284.50	0.85	14,976.79	0.84	
高盛中国	1	20,118,636.00	0.82	14,511.35	0.81	
长城证券	1	4,764,783.00	0.19	3,436.62	0.19	
渤海证券	1	-	-	-	-	
诚通	1	-	-	-	-	

证券						
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

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

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 (%)
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信	-	-	-	-	-	-	-	-

建投 证券								
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛 中国	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一 创业	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

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

10.8 其他重大事件

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富新兴消费股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富新兴消费股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富新兴消费股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

- 5、报告期内汇添富新兴消费股票型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日