

# 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 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 .....	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 .....	7
§ 4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	16
§ 5 托管人报告 .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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 .....	16
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 .....	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	16
6.1 资产负债表 .....	16
6.2 利润表 .....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	21
§ 7 投资组合报告 .....	53
7.1 期末基金资产组合情况 .....	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	54
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 .....	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	62
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 .....	62
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 .....	62
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 .....	63
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 .....	63

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§ 8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
§ 9 开放式基金份额变动.....	65
§ 10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§ 12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	汇添富均衡精选六个月持有混合	
基金主代码	011681	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 09 月 17 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	182,513,413.86	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富均衡精选六个月持有混合 A	汇添富均衡精选六个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	011681	011682
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	168,345,916.38	14,167,497.48

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选优质个股，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金。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；个股精选策略主要用于挖掘股票市场中的优质上市公司，同时注重行业均衡和风格均衡。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、可转债及可交换债投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*50%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*20%+中债综合指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、高于债券型基金及货币市场基金。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将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	汇添富基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李鹏	秦一楠
	联系电话	021-28932888	010-66060069
	电子邮箱	service@99fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95599
传真		021-28932998	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200010	100031
法定代表人		李文	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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)	
	汇添富均衡精选六个月持有混合 A	汇添富均衡精选六个月持有混合 C
本期已实现收益	-1,992,129.54	-205,032.22
本期利润	-7,114,395.93	-612,034.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0413	-0.0446
本期加权平均净值利润率	-4.79%	-5.22%
本期基金份额净值增长率	-4.61%	-4.85%
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	-26,527,138.64	-2,332,704.87

期末可供分配基金份额利润	-0.1576	-0.1647
期末基金资产净值	142,704,646.46	11,902,884.09
期末基金份额净值	0.8477	0.8402
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	-15.23%	-15.98%

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

汇添富均衡精选六个月持有混合 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	4.74%	1.28%	1.54%	0.67%	3.20%	0.61%
过去三个月	-2.82%	1.23%	-2.76%	0.60%	-0.06%	0.63%
过去六个月	-4.61%	1.20%	0.29%	0.61%	-4.90%	0.59%
过去一年	-12.92%	1.60%	-6.93%	0.74%	-5.99%	0.86%
自基金合同生效日起至今	-15.23%	1.78%	-11.73%	0.81%	-3.50%	0.97%
汇添富均衡精选六个月持有混合 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	①—③	②—④

				④		
过去一个月	4.71%	1.28%	1.54%	0.67%	3.17%	0.61%
过去三个月	-2.95%	1.23%	-2.76%	0.60%	-0.19%	0.63%
过去六个月	-4.85%	1.20%	0.29%	0.61%	-5.14%	0.59%
过去一年	-13.35%	1.61%	-6.93%	0.74%	-6.42%	0.87%
自基金合同生效日起至今	-15.98%	1.78%	-11.73%	0.81%	-4.25%	0.97%

### 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

汇添富均衡精选六个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图





汇添富均衡精选六个月持有混合C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（2021年09月17日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限(年)	说明
		任职日期	离任日期		
卞正	本基金的基金经理	2023 年 06 月 14 日		7	国籍：中国。学历：清华大学工学学士，清华大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 7 月起任汇添富基金管理股份有限公司研究员、高级研究员职位。2022 年 2 月 21 日至今任汇添富民营新动力股票型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月 2 日至今任汇添富全球汽车产业升级混合型证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 6 月 14 日至今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。
刘伟林	本基金的基金经理, 研	2021 年 09 月 17 日	2023 年 06 月 14 日	15	国籍：中国。学历：北京大学经

	<p>究总监</p>			<p>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</p>
--	------------	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 3 日至今任汇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>
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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和流程，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

报告期内，A 股三大股指涨跌不一，上证指数、深证成指和创业板指上半年分别上涨 3.65%、上涨 0.10%、下跌 5.61%。上半年 31 个申万一级行业指数中，共有 14 个上半年收涨，其中，通信、传媒、计算机行业指数涨幅位居前三，分别为 50.66%、42.75%、27.57%。

报告期内，本基金于 2023 年 6 月 14 日发生基金经理变更，持仓结构及个股出现较大的调整。报告期内，本基金主要调整了板块的结构比例，精选个股。本基金以“均衡精选”之名，将贯彻“均衡精选”之意，旨在为持有人获取持久而稳定的复合回报收益。

坚持均衡。本基金将严格按照契约基准，按基准指数的行业分布、市场分布（A/H）进行配置，在行业和市场中选择阶段性超配或低配，但不做大的板块或市场偏离，并定期对组合中的资产配比再平衡，以保持资产配置符合基准目标。均衡是资产配置的基础，通过配置不同种类的低相关性资产，力求降低投资组合的风险，一定程度上控制回撤。同时，本基金力求保持客观而时刻归零的投资心态，保持对所有板块的均衡视野，保持对持有个股的足够耐心。

力求精选。A 股上市公司数量已然突破 5000 家，个中质地难免参差。自上而下的均衡是稳定投资心态的先决条件，而自下而上的选股才是获取长期收益的真正来源。在长期视野下，资金腾挪、板块轮动甚至经济周期都是循环往复，但优质企业成长是明确的向上曲线。本基金一直坚信优秀企业持续成长的力量。因此本基金将以企业竞争优势为核心出发点，精选优质个股，不交易市场风格和景气度，旨在获取优质个股业绩成长带来的投资收益。

目前组合在行业分布上以将行业分成金融周期、高端制造、大消费、医药、TMT 五个大行业板块，根据基准行业配置进行超低配配置，相对看好高端制造和 TMT 中优质公司的长期成长机会。市场分布上，虽然港股流动性承压，对个股估值有负面影响，但如果优质企业的成长确定，存在戴维斯双击的机会，组合会保持港股的稳定仓位，力求精选。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富均衡精选六个月持有混合 A 类份额净值增长率为-4.61%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。本报告期汇添富均衡精选六个月持有混合 C 类份额净值增长率为-4.85%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

#### 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，随着内需刺激政策的陆续释放，消费、投资和出口仍将继续回暖，经济增速有望持续稳定回升，全年 GDP 增速有望重回 5%以上，经济面的复苏将是资本市场的重要支撑。国民经济持续恢复、总体回升向好，高质量发展扎实推进，产业升级厚积薄发，粮食安全能源安全得到有效保障。

我们认为下半年经济工作重心边际变化主要是加大宏观政策调控力度，着力扩大内需、提振信心、防范风险。不断推动经济运行持续好转、内生动力持续增强、社会预期持续改善、风险隐患持续化解，推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。

行业层面，我们希望寻找能够体现时代脉络中长期主线，其在复杂的宏观背景下将体现出较强的韧性。中国制造业正在经历高端领域国产替代，中端领域全球扩张的关键阶段，一系列优秀的公司也正处于成长的关键阶段。TMT 行业正在出现创新周期，以 GPT 系列大语言

模型、MR 眼镜等先进硬件设备为代表的创新方向正在蓬勃发展，其对整个 TMT 行业带来的潜在机会仍需要重点关注。医药板块经历了多年的估值消化，很多优质个股的预期收益率正在逐步提升，精选布局能获得不错的收益。

个股选择上，本基金尤其看重企业的竞争优势的可持续性，其形成的要素来自于企业所处行业的特点、发展阶段、行业的空间、管理层的战略和公司的执行力等等，企业的竞争优势是一个复杂的多因子函数。

未来总是不确定的，但可以确定的是，基于价值判断，坚信长期的力量是投资的本源。经过长时间的跟踪调研，我们发现中国正在涌现出一批勤奋、创新、求真、锐意进取的企业家，也正在出现一批优秀的企业，在各自的赛道上披荆斩棘，实现国产替代和全球扩张。然路漫漫其修远兮，但其必将上下求索。随着本基金调仓均衡化，基金的收益曲线可能趋向平缓，但慢即是快，希望持有人给予本基金耐心和信心，也给予中国优秀的上市公司耐心和信心。本基金将均衡精选 A/H 市场优质资产，力争为持有人获取长期、稳定的投资回报。

#### 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，基金份额持有人可对 A 类基金份额、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；以红利再投资方式取得的基金份额的持有到期时间与投资者原持有的基金份额最短持有期到期时间一致，因多笔认购、申购导致原持有基金份额最短持有期不一致的，分别计算；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准

日的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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司本报告期内基金的投资运作，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，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，汇添富基金管理股份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

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	上年度末
----	-----	-----	------



		2023 年 06 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	50,198,670.75	10,522,546.18
结算备付金		3,191,916.93	376,732.42
存出保证金		101,612.11	95,218.36
交易性金融资产	6.4.7.2	100,639,469.18	154,994,140.15
其中：股票投资		98,912,298.20	154,404,534.50
基金投资		-	-
债券投资		1,727,170.98	589,605.65
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		3,796,901.77	8,464,114.06
应收股利		-	-
应收申购款		300.03	50,293.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		157,928,870.77	174,503,044.54
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,322,857.12	5,422,704.90
应付赎回款		287,956.16	35,625.84
应付管理人报酬		190,232.99	214,929.36
应付托管费		31,705.52	35,821.56
应付销售服务费		4,861.16	5,047.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.47	1.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	483,726.80	483,544.11
负债合计		3,321,340.22	6,197,673.88
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.8	182,513,413.86	189,464,872.42
未分配利润	6.4.7.9	-27,905,883.31	-21,159,501.76
净资产合计		154,607,530.55	168,305,370.66
负债和净资产总计		157,928,870.77	174,503,044.54

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 182,513,413.86 份。本基金下属汇添富均衡精选六个月持有混合 A 基金份额净值 0.8477 元，基金份额总额 168,345,916.38 份；本基金下属汇添富均衡精选六个月持有混合 C 基金份额净值 0.8402 元，基金份额总额 14,167,497.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

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
<b>一、营业总收入</b>		<b>-6,203,979.38</b>	<b>-11,171,866.71</b>
1. 利息收入		60,095.10	67,954.29
其中：存款利息收入	6.4.7.10	60,095.10	67,954.29
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）		-734,806.04	-18,606,479.25
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-1,255,517.78	-19,793,863.41
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	30,978.11	102,286.08
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	489,733.63	1,085,098.08
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	-5,529,268.44	7,366,658.25
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	-	-

<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,522,450.82</b>	<b>1,662,610.83</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,194,647.33	1,313,496.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	199,107.89	218,916.07
3. 销售服务费		29,162.67	29,157.03
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		0.63	0.68
8. 其他费用	6.4.7.21	99,532.30	101,040.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-7,726,430.20</b>	<b>-12,834,477.54</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-7,726,430.20</b>	<b>-12,834,477.54</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-7,726,430.20</b>	<b>-12,834,477.54</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	189,464,872.42	-21,159,501.76	168,305,370.66
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	189,464,872.42	-21,159,501.76	168,305,370.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,951,458.56	-6,746,381.55	-13,697,840.11
（一）、综合收益总额	-	-7,726,430.20	-7,726,430.20
（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）	-6,951,458.56	980,048.65	-5,971,409.91
其中：1. 基金申	1,982,880.01	-241,326.57	1,741,553.44

购款			
2. 基金赎回款	-8,934,338.57	1,221,375.22	-7,712,963.35
(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)	182,513,413.86	-27,905,883.31	154,607,530.55
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	207,677,521.65	6,005,055.06	213,682,576.71
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	207,677,521.65	6,005,055.06	213,682,576.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,338,399.22	-11,365,336.19	-18,703,735.41
(一)、综合收益总额	-	-12,834,477.54	-12,834,477.54
(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)	-7,338,399.22	1,469,141.35	-5,869,257.87
其中：1. 基金申购款	4,905,123.20	-765,801.61	4,139,321.59
2. 基金赎回款	-12,243,522.42	2,234,942.96	-10,008,579.46
(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)	200,339,122.43	-5,360,281.13	194,978,841.30

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

汇添富均衡配置个股精选六个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]54 号文《关于准予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 2021 年 9 月 17 日生效。首次设立基金募集规模为 207,227,653.20 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（2021）验字第 60466941\_B52 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、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、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）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、股票期权、国债期货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）。本基金还可根据法律法规参与融资。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：本基金投资于股票资产及存托凭证占基金资产的比例不低于 60%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选优质个股，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 800 指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+

中债综合指数收益率×30%。

#### 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

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. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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	50,198,670.75



等于：本金	50,190,302.59
加：应计利息	8,368.16
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	50,198,670.75

#### 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	99,305,658.70	-	98,912,298.20	-393,360.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,697,910.00	27,390.98	1,727,170.98	1,870.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	1,697,910.00	27,390.98	1,727,170.98	1,870.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	101,003,568.70	27,390.98	100,639,469.18	-391,490.50	

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	351,903.94
其中：交易所市场	351,903.94
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	72,315.49
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	483,726.80

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富均衡精选六个月持有混合 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	176,003,602.04	176,003,602.04
本期申购	579,066.90	579,066.90
本期赎回（以“-”号填列）	-8,236,752.56	-8,236,752.56
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	168,345,916.38	168,345,916.38
汇添富均衡精选六个月持有混合 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	13,461,270.38	13,461,270.38
本期申购	1,403,813.11	1,403,813.11
本期赎回（以“-”号填列）	-697,586.01	-697,586.01
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	14,167,497.48	14,167,497.48

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

汇添富均衡精选六个月持有混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-25,534,441.91	5,949,619.59	-19,584,822.32
本期利润	-1,992,129.54	-5,122,266.39	-7,114,395.93
本期基金份额交易产生的变动数	999,432.81	58,515.52	1,057,948.33
其中：基金申购款	-74,552.09	-498.40	-75,050.49
基金赎回款	1,073,984.90	59,013.92	1,132,998.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-26,527,138.64	885,868.72	-25,641,269.92
汇添富均衡精选六个月持有混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-2,021,662.70	446,983.26	-1,574,679.44
本期利润	-205,032.22	-407,002.05	-612,034.27
本期基金份额	-106,009.95	28,110.27	-77,899.68

额交易产生的变动数			
其中：基金申购款	-201,924.27	35,648.19	-166,276.08
基金赎回款	95,914.32	-7,537.92	88,376.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,332,704.87	68,091.48	-2,264,613.39

#### 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	47,703.16
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	11,597.28
其他	794.66
合计	60,095.10

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	524,875,115.42
减：卖出股票成本总额	524,683,639.67
减：交易费用	1,446,993.53
买卖股票差价收入	-1,255,517.78

#### 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	12,088.11
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	18,890.00

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	30,978.11

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	587,082.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	561,985.00
减：应计利息总额	6,196.71
减：交易费用	11.24
买卖债券差价收入	18,890.00

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	489,733.63
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	489,733.63

#### 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	-5,529,268.44
——股票投资	-5,506,046.84
——债券投资	-23,221.60
——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	-5,529,268.44

#### 6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	7,071.67
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	1,637.77
合计	99,532.30

#### 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
中国农业银行股份有限公司 (“农业银行”)	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

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	34,179,182.95	3.43	10,282,281.03	2.12

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	998,410.00	50.44	-	-

##### 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	24,653.64	3.21	-	-
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	9,576.06	2.54	-	-

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	1,194,647.33	1,313,496.63
其中：支付销售机构的客户维护费	590,147.21	645,335.38

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照双方协商一致的方式，于次月初五个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。



### 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	199,107.89	218,916.07

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，按照双方协商一致的方式，于次月初五个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 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		
	汇添富均衡精选 六个月持有混合 A	汇添富均衡精选六个月 持有混合 C	合计
中国农业银行股份有限公司	-	21,743.59	21,743.59
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,094.70	1,094.70
合计	-	22,838.29	22,838.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富均衡精选 六个月持有混合 A	汇添富均衡精选六个月 持有混合 C	合计
中国农业银行股份有限公司	-	24,406.56	24,406.56
汇添富基金管理股份有限公司	-	836.60	836.60
合计	-	25,243.16	25,243.16

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.5%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.5% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方法于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给基金相关销售机构，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

基金销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

#### 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
农业银行	50,198,670.75	47,703.16	10,942,672.95	57,947.58

#### 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	57	1,592.01	1,882.71	
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	2023 年 03 月	6 个月	新股	11.88	21.02	203	2,411.64	4,267.06	

	港	月 30	月	流						
		日		通						
				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	80	1,230.40	1,189.60	
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	28	1,245.44	1,105.44	
300804	广康生化	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	111	4,711.95	3,659.67	
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	78	4,407.00	4,128.54	
301170	锡南科技	2023年06月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	103	3,502.00	3,597.79	
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	1,101	28,427.82	28,427.82	
301202	朗威股份	2023年06月28日	6个月	新股流通	25.82	25.82	123	3,175.86	3,175.86	

				受限						
301203	国泰环保	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	113	5,212.69	3,887.20	
301225	恒勃股份	2023年06月08日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	138	4,921.08	4,589.88	
301232	飞沃科技	2023年06月08日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	66	4,785.00	3,855.72	
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	811	29,925.90	29,925.90	
301261	恒工精密	2023年06月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	91	3,357.90	3,357.90	
301262	海看股份	2023年06月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	185	5,590.70	4,717.50	
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	31.51	25.10	143	4,506.36	3,589.30	

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	2,131	42,598.69	42,598.69	
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	237	4,737.63	4,737.63	
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	153	4,528.80	10,927.26	
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	1,367	6,835.00	12,248.32	
301305	朗坤环境	2023年05月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	226	5,706.50	4,449.94	
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	188	6,079.92	5,989.68	
301310	鑫宏业	2023年05月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.43	122	8,208.16	7,982.46	
301315	威士	2023年06	6个	新股	32.29	51.12	112	3,616.48	5,725.44	

	顿	月 13 日	月	流通受限						
301337	亚华电子	2023 年 05 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	122	3,977.20	3,705.14	
301345	涛涛车业	2023 年 03 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	53	3,892.85	2,471.92	
301355	南王科技	2023 年 06 月 02 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	250	4,387.50	4,187.50	
301360	荣旗科技	2023 年 04 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	64	4,600.32	5,926.40	
301376	致欧科技	2023 年 06 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	172	4,241.52	3,871.72	
301382	蜂助手	2023 年 05 月 09 日	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	154	3,665.20	5,057.36	
301383	天键股份	2023 年 05 月 31 日	6 个月	新股流通	46.16	35.72	145	6,693.20	5,179.40	

				受限						
301397	溯联股份	2023年06月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	101	5,380.27	4,060.20	
301399	英特科技	2023年05月16日	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	121	5,322.79	6,239.97	
301428	世纪恒通	2023年05月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	149	3,926.15	4,559.40	
301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	200	3,998.00	3,380.00	
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	1,009	40,138.02	40,138.02	
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	113	4,495.14	4,495.14	
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	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



型										
					-	-	-	-	-	
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 41 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。）。

#### 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于每份基金份额的最短持有期限之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。

##### 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	50,198,670.75	-	-	-	-	-	50,198,670.75
结算备付金	3,191,916.93	-	-	-	-	-	3,191,916.93
存出保证金	101,612.11	-	-	-	-	-	101,612.11
交易性金融资产	1,221,574.68	-	505,596.30	-	-	98,912,298.20	100,639,469.18
衍生	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	3,796,901.77	3,796,901.77
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	300.03	300.03
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	54,713,774.47	-	505,596.30	-	-	102,709,500.00	157,928,870.77
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	-	-	-	-	-	2,322,857.12	2,322,857.12
应付赎回	-	-	-	-	-	287,956.16	287,956.16

款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	190,232.99	190,232.99
应付托管费	-	-	-	-	-	31,705.52	31,705.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,861.16	4,861.16
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.47	0.47
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	483,726.80	483,726.80
负债总计	-	-	-	-	-	3,321,340.22	3,321,340.22
利率敏感度缺口	54,713,774.47	-	505,596.30	-	-	99,388,159.78	154,607,530.55
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	10,522,546.18	-	-	-	-	-	10,522,546.18
结算	376,732.42	-	-	-	-	-	376,732.42

备付金							
存出保证金	95,218.36	-	-	-	-	-	95,218.36
交易性金融资产	287,548.80	-	302,056.85	-	-	154,404,534.50	154,994,140.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	8,464,114.06	8,464,114.06
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	50,293.37	50,293.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,282,045.76	-	302,056.85	-	-	162,918,941.93	174,503,044.54
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	-	-	-	-	-	5,422,704.90	5,422,704.90
应付赎回款	-	-	-	-	-	35,625.84	35,625.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	214,929.36	214,929.36
应付托管费	-	-	-	-	-	35,821.56	35,821.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,047.06	5,047.06
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1.05	1.05
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	483,544.11	483,544.11
负债总计	-	-	-	-	-	6,197,673.88	6,197,673.88
利率敏感度缺口	11,282,045.76	-	302,056.85	-	-	156,721,268.05	168,305,370.66

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

行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	538.37	401.92
	基准利率增加 25 个基点	-537.70	-400.85

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证	-	-	-	-



金				
交易性金融资产	-	19,635,048.48	-	19,635,048.48
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	19,635,048.48	-	19,635,048.48
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口 净额	-	19,635,048.48	-	19,635,048.48
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元折合 人民币	港币折合人民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币计 价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付 金	-	-	-	-
存出保证 金	-	-	-	-
交易性金 融资产	-	62,637,025.87	-	62,637,025.87
衍生金融 资产	-	-	-	-
买入返售 金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算 款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购 款	-	-	-	-
递延所得 税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	62,637,025.87	-	62,637,025.87
以外币计 价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金 融负债	-	-	-	-
衍生金融 负债	-	-	-	-
卖出回购 金融资产 款	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	62,637,025.87	-	62,637,025.87

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	981,752.42	3,131,851.29
港币相对人民币贬值 5%	-981,752.42	-3,131,851.29	

#### 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	98,912,298.20	63.98	154,404,534.50	91.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,727,170.98	1.12	589,605.65	0.35
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	100,639,469.18	65.09	154,994,140.15	92.09

#### 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 800 指数上涨 5%	9,220,545.82	11,174,230.77
	中证 800 指数下跌 5%	-9,220,545.82	-11,174,230.77

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	98,583,561.25
第二层次	1,896,276.26
第三层次	159,631.67
合计	100,639,469.18

##### 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	98,912,298.20	62.63
	其中：股票	98,912,298.20	62.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,727,170.98	1.09
	其中：债券	1,727,170.98	1.09
	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	53,390,587.68	33.81
8	其他各项资产	3,898,813.91	2.47
9	合计	157,928,870.77	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 19,635,048.48 元，占期末净值比例为 12.7%。

## 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	61,445,030.00	39.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,312,039.47	1.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,352,251.94	1.52
G	交通运输、仓储和邮政业	787,891.93	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,381,464.36	1.54
J	金融业	3,865,924.00	2.50
K	房地产业	1,581,755.00	1.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,859,122.00	1.85
N	水利、环境和公共设施管理业	86,657.76	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,927.26	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,594,186.00	1.03
S	综合	-	-
	合计	79,277,249.72	51.28

### 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）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	7,593,920.54	4.91
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	12,041,127.94	7.79
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	19,635,048.48	12.70

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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	00700	腾讯控股	28,000	8,560,399.90	5.54
2	300750	宁德时代	20,420	4,671,891.80	3.02
3	603198	迎驾贡酒	68,500	4,370,300.00	2.83
4	600309	万华化学	43,000	3,777,120.00	2.44
5	01024	快手-W	70,500	3,480,728.04	2.25
6	603338	浙江鼎力	58,100	3,254,181.00	2.10
7	601137	博威合金	208,700	3,247,372.00	2.10
8	002709	天赐材料	76,300	3,142,797.00	2.03
9	688002	睿创微纳	69,178	3,099,174.40	2.00
10	600276	恒瑞医	62,496	2,993,558.40	1.94

		药			
11	300347	泰格医药	44,300	2,859,122.00	1.85
12	03690	美团-W	23,350	2,632,902.90	1.70
13	688157	松井新材料	49,638	2,610,958.80	1.69
14	688630	芯碁微装	30,795	2,587,395.90	1.67
15	600030	中信证券	117,800	2,330,084.00	1.51
16	600900	长江电力	103,200	2,276,592.00	1.47
17	605068	明新旭腾	92,700	2,267,442.00	1.47
18	01316	耐世特	599,000	2,258,768.02	1.46
19	603939	益丰药房	61,000	2,257,000.00	1.46
20	000063	中兴通讯	48,500	2,208,690.00	1.43
21	000568	泸州老窖	10,400	2,179,528.00	1.41
22	003031	中瓷电子	13,100	1,743,872.00	1.13
23	002402	和而泰	94,700	1,608,006.00	1.04
24	002179	中航光电	35,390	1,604,936.50	1.04
25	300413	芒果超媒	46,600	1,594,186.00	1.03
26	688301	奕瑞科技股份	5,635	1,591,493.05	1.03
27	002985	北摩高科	36,000	1,588,320.00	1.03
28	001914	招商积余	105,100	1,581,755.00	1.02
29	000860	顺鑫农业	46,900	1,580,061.00	1.02
30	601318	中国平安	33,100	1,535,840.00	0.99
31	600690	海尔智家	65,300	1,533,244.00	0.99
32	002384	东山精密	58,200	1,507,380.00	0.97



33	688385	复旦微电	29,723	1,489,122.30	0.96
34	688383	新益昌科技	10,571	1,471,694.62	0.95
35	002230	科大讯飞	20,400	1,386,384.00	0.90
36	01070	TCL电子	316,000	1,185,776.92	0.77
37	002541	鸿路钢构	31,700	913,277.00	0.59
38	688789	杭州宏华数码科技	9,089	802,831.37	0.52
39	03998	波司登	256,000	778,888.70	0.50
40	600233	圆通速递	52,900	770,224.00	0.50
41	605337	李子园	42,000	767,760.00	0.50
42	688363	华熙生物	8,526	760,178.16	0.49
43	603868	飞科电器	11,800	744,462.00	0.48
44	09868	小鹏汽车-W	16,000	737,584.00	0.48
45	688369	致远互联	13,145	726,918.50	0.47
46	300820	英杰电气	5,650	465,447.00	0.30
47	301310	鑫宏业	1,213	83,130.54	0.05
48	301399	英特科技	1,202	70,559.47	0.05
49	301360	荣旗科技	636	65,574.56	0.04
50	301315	威士顿	1,111	65,495.61	0.04
51	301307	美利信	1,876	63,060.96	0.04
52	301382	蜂助手	1,534	58,380.56	0.04
53	001287	中电港	2,025	54,882.22	0.04
54	301383	天键股份	1,448	53,911.60	0.03
55	301428	世纪恒通	1,487	52,192.20	0.03
56	301262	海看股份	1,844	50,754.75	0.03
57	301225	恒勃股	1,373	48,914.03	0.03

		份			
58	301292	海科新源	2,368	47,336.32	0.03
59	301305	朗坤环境	2,256	46,694.24	0.03
60	301488	豪恩汽电	1,122	44,633.16	0.03
61	301355	南王科技	2,499	44,219.70	0.03
62	301397	溯联股份	1,002	42,262.60	0.03
63	301337	亚华电子	1,216	41,338.74	0.03
64	301376	致欧科技	1,712	40,369.72	0.03
65	301203	国泰环保	1,121	39,963.52	0.03
66	301232	飞沃科技	657	39,723.51	0.03
67	301170	锡南科技	1,029	38,044.99	0.02
68	300804	广康生化	1,108	37,866.74	0.02
69	301281	科源制药	1,420	37,276.56	0.02
70	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
71	301439	泓淋电力	1,992	35,349.28	0.02
72	301261	恒工精密	902	33,283.80	0.02
73	301202	朗威股份	1,224	31,603.68	0.02
74	301345	涛涛车业	530	25,229.59	0.02
75	603209	兴通股份	833	17,667.93	0.01
76	301301	川宁生物	1,367	12,248.32	0.01
77	301293	三博脑科	153	10,927.26	0.01
78	301157	华塑科技	78	4,128.54	0.00

79	001282	三联锻造	57	1,882.71	0.00
80	001360	南矿集团	80	1,189.60	0.00
81	001367	海森药业	28	1,105.44	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	25,075,058.75	14.90
2	300068	南都电源	17,748,656.90	10.55
3	01024	快手-W	16,640,064.86	9.89
4	002027	分众传媒	12,963,730.00	7.70
5	300820	英杰电气	11,761,635.74	6.99
6	300347	泰格医药	11,601,275.10	6.89
7	300474	景嘉微	9,716,342.00	5.77
8	603983	丸美股份	9,647,094.00	5.73
9	002463	沪电股份	9,457,035.80	5.62
10	002709	天赐材料	8,924,933.60	5.30
11	688363	华熙生物	8,849,978.26	5.26
12	688385	复旦微电	8,701,850.18	5.17
13	000860	顺鑫农业	8,681,284.44	5.16
14	002236	大华股份	8,620,767.00	5.12
15	300459	汤姆猫	8,384,675.00	4.98
16	300571	平治信息	8,338,989.00	4.95
17	688630	芯碁微装	8,144,769.77	4.84
18	000681	视觉中国	8,025,170.00	4.77
19	300624	万兴科技	7,433,103.80	4.42
20	000034	神州数码	7,376,030.00	4.38
21	600702	舍得酒业	7,372,773.00	4.38
22	600872	中炬高新	7,255,965.00	4.31
23	000063	中兴通讯	7,235,838.00	4.30
24	300418	昆仑万维	7,229,460.00	4.30
25	002351	漫步者	7,220,878.00	4.29
26	600475	华光环能	7,115,705.00	4.23
27	605117	德业股份	6,987,872.00	4.15
28	003031	中瓷电子	6,814,050.00	4.05
29	603799	华友钴业	6,785,216.40	4.03

30	603369	今世缘	5,876,789.00	3.49
31	603222	济民医疗	5,702,922.40	3.39
32	688348	昱能科技	5,587,489.18	3.32
33	03690	美团-W	5,519,120.50	3.28
34	300763	锦浪科技	5,296,743.00	3.15
35	605399	晨光新材	5,112,012.70	3.04
36	000568	泸州老窖	5,048,881.00	3.00
37	300604	长川科技	5,014,219.54	2.98
38	603198	迎驾贡酒	4,838,515.00	2.87
39	600602	云赛智联	4,833,837.00	2.87
40	603868	飞科电器	4,543,895.00	2.70
41	000858	五粮液	4,539,829.68	2.70
42	301165	锐捷网络	4,438,914.00	2.64
43	300045	华力创通	4,239,665.00	2.52
44	688153	唯捷创芯	4,209,595.71	2.50
45	00700	腾讯控股	3,873,713.72	2.30
46	300037	新宙邦	3,853,170.00	2.29
47	600309	万华化学	3,797,915.00	2.26
48	301260	格力博	3,756,278.90	2.23

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	300413	芒果超媒	26,975,670.25	16.03
2	01024	快手-W	25,255,198.32	15.01
3	688363	华熙生物	21,425,802.58	12.73
4	300068	南都电源	15,273,804.00	9.08
5	00388	香港交易所	14,294,221.28	8.49
6	600702	舍得酒业	14,009,477.00	8.32
7	000568	泸州老窖	13,006,515.00	7.73
8	002027	分众传媒	12,762,779.00	7.58
9	03690	美团-W	12,136,257.86	7.21
10	000858	五粮液	11,845,209.00	7.04
11	300418	昆仑万维	11,714,436.00	6.96
12	300820	英杰电气	11,530,626.00	6.85
13	002463	沪电股份	11,057,943.00	6.57
14	002236	大华股份	10,076,464.02	5.99
15	02331	李宁	9,379,877.34	5.57
16	603983	丸美股份	9,304,736.00	5.53

17	300624	万兴科技	9,094,222.02	5.40
18	300459	汤姆猫	8,856,571.00	5.26
19	002351	漫步者	8,808,228.00	5.23
20	300474	景嘉微	8,656,811.00	5.14
21	000681	视觉中国	8,253,696.00	4.90
22	600475	华光环能	7,717,725.60	4.59
23	000034	神州数码	7,518,936.00	4.47
24	600872	中炬高新	6,941,215.24	4.12
25	002709	天赐材料	6,917,911.00	4.11
26	000860	顺鑫农业	6,844,395.00	4.07
27	605117	德业股份	6,746,036.00	4.01
28	003031	中瓷电子	6,668,323.00	3.96
29	603589	口子窖	6,545,906.00	3.89
30	603799	华友钴业	6,508,162.90	3.87
31	300571	平治信息	6,317,707.00	3.75
32	002594	比亚迪	6,006,847.00	3.57
33	688630	芯碁微装	5,993,649.96	3.56
34	301165	锐捷网络	5,834,190.20	3.47
35	000063	中兴通讯	5,699,009.00	3.39
36	600845	宝信软件	5,225,590.25	3.10
37	603222	济民医疗	5,225,134.80	3.10
38	603369	今世缘	5,217,762.00	3.10
39	300604	长川科技	5,131,796.00	3.05
40	00700	腾讯控股	5,089,826.36	3.02
41	688385	复旦微电	5,075,375.84	3.02
42	600602	云赛智联	5,046,429.00	3.00
43	00175	吉利汽车	5,008,042.73	2.98
44	688031	星环科技	4,971,300.92	2.95
45	001330	博纳影业	4,943,835.28	2.94
46	688348	昱能科技	4,863,247.77	2.89
47	300347	泰格医药	4,837,505.00	2.87
48	688153	唯捷创芯	4,744,339.45	2.82
49	605399	晨光新材	4,348,959.40	2.58
50	300763	锦浪科技	4,246,348.00	2.52
51	300045	华力创通	4,186,918.00	2.49
52	000661	长春高新	4,014,218.00	2.39
53	300037	新宙邦	3,901,513.00	2.32
54	603868	飞科电器	3,743,030.00	2.22
55	300750	宁德时代	3,679,007.00	2.19
56	300496	中科创达	3,636,415.00	2.16
57	300015	爱尔眼科	3,520,043.33	2.09
58	000333	美的集团	3,378,663.00	2.01

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	474,697,450.21
卖出股票收入（成交）总额	524,875,115.42

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	1,727,170.98	1.12
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	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,727,170.98	1.12

### 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	12,000	1,221,574.68	0.79
2	019688	22 国债 23	5,000	505,596.30	0.33

### 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

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

### 7.12.2

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	101,612.11
2	应收清算款	3,796,901.77
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	300.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,898,813.91

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 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（%）
汇添富均衡精选六个月持有混合 A	3,710	45,376.26	257,111.39	0.15	168,088,804.99	99.85
汇添富均衡精选六个月持有混合 C	679	20,865.24	0.00	0.00	14,167,497.48	100.00
合计	4,389	41,584.28	257,111.39	0.14	182,256,302.47	99.86

### 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	汇添富均衡精选六个月持有混合 A	12,907.92	0.01
	汇添富均衡精选六个月持有混合 C	28,543.77	0.20
	合计	41,451.69	0.02

### 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	汇添富均衡精选六个月持 有混合 A	0
	汇添富均衡精选六个月持 有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	汇添富均衡精选六个月持 有混合 A	0
	汇添富均衡精选六个月持 有混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富均衡精选六个月持有混 合 A	汇添富均衡精选六个月持有混 合 C
基金合同生效日（2021 年 09 月 17 日）基金份 额总额	193,612,635.06	13,615,018.14
本报告期期初基金份额 总额	176,003,602.04	13,461,270.38
本报告期基金总申购份 额	579,066.90	1,403,813.11
减：本报告期基金总赎 回份额	8,236,752.56	697,586.01
本报告期基金拆分变动 份额	-	-
本报告期期末基金份额 总额	168,345,916.38	14,167,497.48

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。

本报告期内，本基金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

注：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 (%)	
华西证券	2	242,579,268.22	24.32	177,611.67	23.15	
华创证券	1	116,669,865.37	11.70	84,909.29	11.07	
华泰证券	2	102,463,325.21	10.27	75,015.79	9.78	
东海证券	2	87,692,979.68	8.79	81,202.91	10.58	
中信建投证券	2	86,289,329.67	8.65	63,806.04	8.32	
长江	2	75,477,860.17	7.57	55,845.92	7.28	

证券						
华宝证券	1	58,169,342.93	5.83	52,833.57	6.89	
财通证券	1	51,953,665.81	5.21	48,170.50	6.28	
长城证券	1	50,179,596.00	5.03	36,197.41	4.72	
东方证券	3	34,179,182.95	3.43	24,653.64	3.21	
民生证券	2	25,860,904.10	2.59	18,653.52	2.43	
中信证券	1	18,489,026.06	1.85	13,336.92	1.74	
中泰证券	1	18,368,627.12	1.84	13,249.79	1.73	
中金公司	2	15,735,101.67	1.58	14,183.67	1.85	
国泰君安	1	5,782,043.51	0.58	1,979.43	0.26	
东方财富	2	4,206,760.00	0.42	3,076.71	0.40	
兴业证券	2	3,432,326.12	0.34	2,476.06	0.32	
渤海证券	2	-	-	-	-	
方正证券	2	-	-	-	-	
广发证券	2	-	-	-	-	
国金证券	1	-	-	-	-	
国联证券	1	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
恒泰证券	2	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
华西证券	299,985.00	15.15	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	399,800.00	20.20	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	998,410.00	50.44	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业	281,262.95	14.21	-	-	-	-	-	-

证券								
渤海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：广发证券（深交所单元）。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
2	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2023 年 03 月 13 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
6	汇添富均衡配置个股精选六个月持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 15 日
7	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更新招募说明书（2023 年 6 月 16 日更新）	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 16 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均衡配置个股精选六个月持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《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基金合同》；
- 3、《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、报告期内汇添富均衡配置个股精选六个月持有期混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

## 12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 08 月 31 日