

# 汇添富价值创造定期开放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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 .....	8
4. 1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4. 2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	11
4. 3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	12
4. 5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4. 6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4. 7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
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 .....	13
§ 5 托管人报告 .....	13
5. 1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	13
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 .....	14
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 .....	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	14
6. 1 资产负债表 .....	14
6. 2 利润表 .....	15
6. 3 净资产（基金净值）变动表 .....	16
6. 4 报表附注 .....	18
§ 7 投资组合报告 .....	48
7. 1 期末基金资产组合情况 .....	48
7. 2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	48
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 .....	49
7. 4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	53
7. 5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	55
7. 6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55

7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注 .....	55
§ 8 基金份额持有人信息 .....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
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 .....	57
§ 9 开放式基金份额变动 .....	57
§ 10 重大事件揭示 .....	57
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
§ 12 备查文件目录 .....	63
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金
基金简称	添富价值创造定开混合
基金主代码	005379
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 01 月 19 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	3,529,998,335.58
基金合同存续期	不定期

### 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，精选价值创造型股票，为基金份额持有人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；个股精选策略用于挖掘股票市场中行业背景良好、商业模式清晰、公司治理优良、竞争优势突出且估值相对合理的价值创造型上市公司。本基金的投资策略还包括：债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、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、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*40%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*40%+中债综合财富指数收益率*20%
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，属于中等收益/风险特征的基金。 本基金将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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	021-60637228
传真	021-28932998	021-60635778
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号	北京市西城区金融大街 25 号

	H 区（东座）6 楼 H686 室	
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200010	100033
法定代表人	李文	田国立

## 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)
本期已实现收益	-158,440,522.96
本期利润	-618,961,965.83
加权平均基金份额本期利润	-0.1592
本期加权平均净值利润率	-9.43%
本期基金份额净值增长率	-10.28%
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	1,251,776,297.98
期末可供分配基金份额利润	0.3546
期末基金资产净值	5,387,746,747.08
期末基金份额净值	1.5263
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	52.63%

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

阶段	份额净值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去一 个月	3.30%	1.45%	2.89%	0.85%	0.41%	0.60%
过去三 个月	-12.59%	1.18%	-2.61%	0.76%	-9.98%	0.42%
过去六 个月	-10.28%	1.22%	-0.09%	0.79%	-10.19%	0.43%
过去一 年	-21.58%	1.35%	-7.27%	0.98%	-14.31%	0.37%
过去三 年	-9.50%	1.67%	-8.49%	0.99%	-1.01%	0.68%
自基金 合同生 效日起 至今	52.63%	1.50%	-11.69%	0.98%	64.32%	0.52%

#### 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

添富价值创造定开混合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		
胡昕炜	本基金的基金经理	2018 年 01 月 19 日		12	国籍：中国。 学历：清华大学工学硕士。从业资格：证券投资基金管理资格。从业经历：2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司，历任行业分析师。2016 年 4 月 8 日至今任汇添富消费行业混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月 28 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月 20 日至 2019 年 8 月 28 日任汇

					添富盈润混 合型证券投资 基金的基金经 理。 2018年1月 19日至今任 汇添富价值 创造定期开 放混合型证 券投资基金 的基金经理。 2018年9月 21日至2020 年6月30日 任汇添富全 球消费行业 混合型证券 投资基金的 基金经理。 2018年12 月21日至今 任汇添富消 费升级混合 型证券投资 基金的基金 经理。2019 年9月17日 至今任汇添 富民安增益 定期开放混 合型证券投资 基金的基金 经理。 2019年11 月5日至今 任汇添富稳 健增长混合 型证券投资 基金的基金 经理。2020 年7月8日 至今任汇添 富中盘价值 精选混合型
--	--	--	--	--	--

					证券投资基 金的基金经理。 2021 年 5 月 11 日至 今任汇添富消费精选两 年持有期股票型证券投 资基金的基金经 理。 2021 年 8 月 17 日至今任 汇添富价值领 先混合型证券投 资基金的基金经 理。
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4. 1. 3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

#### 4. 2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4. 3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4. 3. 1 公平交易制度的执行情况

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中的公平交易模块，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

2023 年上半年，A 股市场波动较大。一季度，中国经济迎来较好开局，上证指数稳步走高。二季度，尤其是 5 月份以后，伴随着经济数据的边际走弱，上证指数有一定调整。整体来看，上半年上证指数整体上涨了 3.65%。上半年各行业分化较大，通信、传媒、计算机、机械设备等行业涨幅靠前，建筑材料、美容护理、房地产、商贸零售等行业跌幅较大。上半年恒生指数整体下跌了 4.37%，其中能源业、电讯业、综合业表现靠前，必需性消费、地产建筑业、医疗保健业等跌幅较大。

本基金在 2023 年上半年的投资中继续聚焦于 A 股和港股市场中的“价值创造”型公司。整体上，我们仍然着眼于中长期，保持了较为稳定的持仓结构。尽管市场较为悲观，但我们仍然看好中国经济增长的空间，看好一批有核心竞争力公司的高质量发展。上半年，我们的组合构建更加均衡，适当降低了消费的持仓，增加了医药、科技和能源行业的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-10.28%。同期业绩比较基准收益率为-0.09%。

#### 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 2023 年下半年，中国经济有望较二季度迎来更好增长。我们看到，政府在促进经济发展、促进各经济主体信心回升等方面有一系列措施推出或即将推出，这将夯实中国经济的底部，助力经济企稳向上。因此，我们对权益市场适度乐观。

下半年，我们将继续在消费、医药、科技、能源等行业进行重点投资。我们坚信中国人的增长潜力，将尽可能淡化短期波动，着眼于中长期，继续陪伴质地优秀、管理层卓越的优质公司，力争分享经济发展和企业成长带来的收益。

#### 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。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 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

本托管人复核审查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。

## § 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：汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	694,553,948.83	442,278,087.71
结算备付金		21,561,394.93	13,456,786.28
存出保证金		792,437.17	948,892.89
交易性金融资产	6.4.7.2	4,713,020,240.23	6,862,535,846.10
其中：股票投资		4,713,020,240.23	6,862,535,846.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		9,818,517.83	-
应收股利		15,216,632.19	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,454,963,171.18	7,319,219,612.98
<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		56,935,647.84	523.14
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,722,831.17	9,167,957.97
应付托管费		1,120,471.86	1,527,992.97
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	6.4.7.7	2,437,473.23	2,205,241.53
负债合计		67,216,424.10	12,901,715.61
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	3,529,998,335.58	4,294,829,567.98
未分配利润	6.4.7.9	1,857,748,411.50	3,011,488,329.39
净资产合计		5,387,746,747.08	7,306,317,897.37
负债和净资产总计		5,454,963,171.18	7,319,219,612.98

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5263 元，基金份额总额

3,529,998,335.58 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富价值创造定期开放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	上年度可比期间 2022年01月01日 至2022年06月30
----	-----	----------------------------------	---------------------------------------

		日	日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-561,542,879.76</b>	<b>-1,100,410,872.42</b>
1. 利息收入		805,798.75	1,519,358.96
其中：存款利息收入	6.4.7.10	805,798.75	1,519,358.96
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）		-101,829,156.35	-491,162,658.20
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-148,598,339.38	-539,210,035.83
基金投资收益	6.4.7.12	—	—
债券投资收益	6.4.7.13	—	1,927,174.99
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	46,769,183.03	46,120,202.64
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	-460,521,442.87	-610,781,342.34
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	1,920.71	13,769.16
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>57,419,086.07</b>	<b>73,685,294.93</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	49,028,584.70	62,974,005.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,171,430.86	10,495,667.55
3. 销售服务费		—	—
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		—	11.04
8. 其他费用	6.4.7.21	219,070.51	215,611.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-618,961,965.83</b>	<b>-1,174,096,167.35</b>
<b>减：所得税费用</b>		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-618,961,965.83</b>	<b>-1,174,096,167.35</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		—	—
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-618,961,965.83</b>	<b>-1,174,096,167.35</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富价值创造定期开放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）	4,294,829,567.98	3,011,488,329.39	7,306,317,897.37
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	4,294,829,567.98	3,011,488,329.39	7,306,317,897.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-764,831,232.40	-1,153,739,917.89	-1,918,571,150.29
(一)、综合收益总额	-	-618,961,965.83	-618,961,965.83
(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)	-764,831,232.40	-534,777,952.06	-1,299,609,184.46
其中：1. 基金申购款	7,793,075.53	5,490,685.16	13,283,760.69
2. 基金赎回款	-772,624,307.93	-540,268,637.22	-1,312,892,945.15
(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）	3,529,998,335.58	1,857,748,411.50	5,387,746,747.08
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）	5,189,286,450.40	5,895,464,125.99	11,084,750,576.39
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	5,189,286,450.40	5,895,464,125.99	11,084,750,576.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-894,456,882.42	-1,831,896,510.16	-2,726,353,392.58
(一)、综合收益总额	-	-1,174,096,167.35	-1,174,096,167.35
(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)	-894,456,882.42	-657,800,342.81	-1,552,257,225.23
其中：1. 基金申购款	33,589,980.36	24,233,402.70	57,823,383.06
2. 基金赎回款	-928,046,862.78	-682,033,745.51	-1,610,080,608.29
(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）	4,294,829,567.98	4,063,567,615.83	8,358,397,183.81

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：

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富价值创造定期开放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[2017]213号文《关于准予汇添富睿益混合型证券投资基金注册的批复》以及中国证监会证监许可[2017]2051号文《关于准予汇添富睿益混合型证券投资基金变更注册的批复》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2018年1月19日生效。首次设立基金募集规模为2,500,996,018.02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（2018）验字第60466941\_B02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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、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）。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：封闭期内，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占股票资产的比例不超过50%），本基金投资于价值创造型股票及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于80%；每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，本基金投资不受上述比例限制。开放期内，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，本基金持有的现金或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%；封闭期内，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受上述限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，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，精选价值创造型股票，为基金份额持有人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：沪深300指数收益率×40%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×40%+中债综合财富指数收益率×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管理业务的指导意见》、《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，股息的股息、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	694,553,948.83

等于：本金	694,499,569.27
加：应计利息	54,379.56
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	694,553,948.83

#### 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	5,160,795,154.99	-	4,713,020,240.23	447,774,914.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券				
交易所市场	-	-	-	-
银行间市场	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,160,795,154.99	-	4,713,020,240.23	447,774,914.76

#### 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	2,233,334.88
其中：交易所市场	2,233,334.88
银行间市场	—
应付利息	—
应付审计费	144,630.98
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	2,437,473.23

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,294,829,567.98	4,294,829,567.98
本期申购	7,793,075.53	7,793,075.53
本期赎回（以“-”）	-772,624,307.93	-772,624,307.93

号填列)		
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	3,529,998,335.58	3,529,998,335.58

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,698,064,106.70	1,313,424,222.69	3,011,488,329.39
本期利润	-158,440,522.96	-460,521,442.87	-618,961,965.83
本期基金份额交易产生的变动数	-287,847,285.76	-246,930,666.30	-534,777,952.06
其中：基金申购款	2,939,225.43	2,551,459.73	5,490,685.16
基金赎回款	-290,786,511.19	-249,482,126.03	-540,268,637.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,251,776,297.98	605,972,113.52	1,857,748,411.50

#### 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	669,882.24
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	127,843.61
其他	8,072.90
合计	805,798.75

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	4,591,213,242.92
减：卖出股票成本总额	4,727,685,501.45

减：交易费用	12,126,080.85
买卖股票差价收入	-148,598,339.38

#### 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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 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	46,769,183.03
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	46,769,183.03

#### 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	-460,521,442.87

——股票投资	-460,521,442.87
——债券投资	-
——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	-460,521,442.87

#### 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	1,920.71
替代损益	-
其他	-
合计	1,920.71

#### 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	44,630.98
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	3,744.15
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	92,588.01
合计	219,070.51

## 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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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	1,163,296,898.72	15.26	1,894,185,951.55	18.17

#### 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	867,363.88	15.41	368,754.16	16.51
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	1,421,905.39	18.44	904,561.78	20.12

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	49,028,584.70	62,974,005.24
其中：支付销售机构的客户维护费	18,522,109.85	24,380,391.06

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，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，

自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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	8,171,430.86	10,495,667.55

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，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，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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
建设银行	694,553,948.83	669,882.24	345,509,779.31	1,324,850.08

#### 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	6 个月	新股流通	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	

		15 日		受 限						
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 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11. 88	21. 02	1, 386	16, 465. 68	29, 133. 72	
001328	登康口 腔	2023 年 03 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	20. 68	25. 49	145	2, 998. 60	3, 696. 05	
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	
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	

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	
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	
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	
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	
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	
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	
301373	凌玮	2023年	6个	新股	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	

	科 技	01 月 20 日	月	流 通 受 限						
301439	泓 淋 电 力	2023 年 03 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19. 99	16. 90	949	18, 970. 51	16, 038. 10	
601061	中 信 金 属	2023 年 03 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	6. 58	7. 58	4, 016	26, 425. 28	30, 441. 28	
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	875	9, 065. 00	10, 360. 00	
601133	柏 诚 系 统 股 份 公 司	2023 年 03 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11. 66	12. 26	664	7, 742. 24	8, 140. 64	
603125	江 苏 常 青 树 科 技	2023 年 03 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	25. 98	24. 53	160	4, 156. 80	3, 924. 80	
603135	中 重 科 技	2023 年 03 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	17. 80	17. 89	628	11, 178. 40	11, 234. 92	

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	
688307	中润光学	2023年02月08日	6个月	新股流通受限	23.88	31.73	2,455	58,625.40	77,897.15	
688484	南芯科技	2023年03月28日	6个月	新股流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	
688485	九州一轨环科	2023年01月11日	6个月	新股流通受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	
688515	裕太微电子	2023年02月01日	6个月	新股流通受限	92.00	162.75	4,183	384,836.00	680,783.25	
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	
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。）。

#### 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。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。

基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部、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约定开放日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管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》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	694,553,948.83	-	-	-	-	-	694,553,948.83
结算备付金	21,561,394.93	-	-	-	-	-	21,561,394.93
存出保证金	792,437.17	-	-	-	-	-	792,437.17
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,713,020,240.23	4,713,020,240.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	9,818,517.83	9,818,517.83
应收股利	-	-	-	-	-	15,216,632.19	15,216,632.19
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	716,907,780.93	-	-	-	-	4,738,055,390.25	5,454,963,171.18
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	-	-	-	-	-	56,935,647.84	56,935,647.84
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报	-	-	-	-	-	6,722,831.17	6,722,831.17

酬							
应付 托管 费	-	-	-	-	-	1,120,471.86	1,120,471.86
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	-	-	-	-	-	2,437,473.23	2,437,473.23
负债 总计	-	-	-	-	-	67,216,424.10	67,216,424.10
利率 敏感 度缺 口	716,907,780.93	-	-	-	-	4,670,838,966.15	5,387,746,747.08
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	442,278,087.71	-	-	-	-	-	442,278,087.71
结算 备付 金	13,456,786.28	-	-	-	-	-	13,456,786.28
存出 保证 金	948,892.89	-	-	-	-	-	948,892.89
交易	-	-	-	-	-	6,862,535,846.10	6,862,535,846.10

性金融资产							
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	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	456,683,766.88	-	-	-	-	6,862,535,846.10	7,319,219,612.98
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	-	-	-	-	-	523.14	523.14

清算款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,167,957.97	9,167,957.97
应付托管费	-	-	-	-	-	1,527,992.97	1,527,992.97
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	-	-	-	-	-	2,205,241.53	2,205,241.53
负债总计	-	-	-	-	-	12,901,715.61	12,901,715.61
利率敏感度缺口	456,683,766.88	-	-	-	-	6,849,634,130.49	7,306,317,897.37

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

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	-	1,972,971,739.42	-	1,972,971,739.42
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	-	15,216,632.19	-	15,216,632.19
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	1,988,188,371.61	-	1,988,188,371.61
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	-	1,988,188,371.61	-	1,988,188,371.61
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	2,365,865,792.15	-	2,365,865,792.15
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	-	2,365,865,792.15	-	2,365,865,792.15
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	-	2,365,865,792.15	-	2,365,865,792.15

#### 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%	99,409,418.58	118,293,289.61
	港币相对人民 币贬值 5%	-99,409,418.58	-118,293,289.61

#### 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	4,713,020,24 0.23	87.48	6,862,535,84 6.10	93.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,713,020,24 0.23	87.48	6,862,535,84 6.10	93.93

##### 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民

	的变动	币元)	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数 上涨 5%	303,112,255.83	442,954,087.34
	沪深 300 指数 下跌 5%	-303,112,255.83	-442,954,087.34

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	4,711,741,610.18
第二层次	32,023.04
第三层次	1,246,607.01
合计	4,713,020,240.23

###### 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	4,713,020,240.23	86.40
	其中：股票	4,713,020,240.23	86.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	716,115,343.76	13.13
8	其他各项资产	25,827,587.19	0.47
9	合计	5,454,963,171.18	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 1,972,971,739.42 元，占期末净值比例为 36.62%。

#### 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	2,459,839,346.73	45.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	34,642.78	0.00
F	批发和零售业	59,575.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	21,170,000.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,333,200.00	0.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	165,516,700.66	3.07
N	水利、环境和公共设施管理业	134,272.82	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	64,925,315.35	1.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,740,048,500.81	50.86

## 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	134,240,288.00	2.49
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	623,690,888.62	11.58
30 日常消费	466,927,551.20	8.67
35 医疗保健	17,310,174.50	0.32
40 金融	54,433,699.20	1.01
45 信息技术	-	-
50 电信服务	489,165,708.80	9.08
55 公用事业	-	-
60 房地产	187,203,429.10	3.47
合计	1,972,971,739.42	36.62

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	1,600,000	489,165,708.80	9.08
2	600519	贵州茅台	280,023	473,518,893.00	8.79
3	000568	泸州老窖	1,700,005	356,270,047.85	6.61
4	000858	五粮液	2,100,042	343,503,869.94	6.38
5	03690	美团-W	2,400,000	270,619,569.60	5.02
6	00291	华润啤酒	5,500,000	261,657,924.00	4.86
7	02331	李宁	5,700,000	221,510,304.90	4.11
8	00168	青岛啤酒股份	2,900,000	190,370,430.40	3.53
9	600809	山西汾酒	1,000,154	185,098,500.78	3.44
10	00883	中国海洋石油	13,000,000	134,240,288.00	2.49
11	603259	药明康德	2,000,034	124,622,118.54	2.31
12	000596	古井贡酒	500,092	123,712,758.96	2.30
13	300750	宁德时代	500,017	114,398,889.43	2.12
14	300395	菲利华	2,200,000	108,240,000.00	2.01
15	600765	中航重机	3,800,040	100,739,060.40	1.87
16	603198	迎驾贡酒	1,500,000	95,700,000.00	1.78
17	01368	特步国际	11,000,000	80,931,404.40	1.50
18	01209	华润万象生活	2,000,000	71,730,044.00	1.33
19	300015	爱尔眼科	3,500,017	64,925,315.35	1.21
20	00688	中国海外发展	4,000,000	62,989,673.60	1.17
21	603517	绝味食品	1,600,077	59,442,860.55	1.10

22	00388	香港交易所	200,000	54,433,699.20	1.01
23	06049	保利物业	1,500,000	52,483,711.50	0.97
24	300308	中际旭创	300,000	44,235,000.00	0.82
25	600702	舍得酒业	350,000	43,382,500.00	0.81
26	603605	珀莱雅	350,040	39,344,496.00	0.73
27	600276	恒瑞医药	800,000	38,320,000.00	0.71
28	688212	澳华内镜	550,071	37,349,820.90	0.69
29	300502	新易盛	500,040	33,987,718.80	0.63
30	01999	敏华控股	7,000,000	33,753,687.80	0.63
31	300347	泰格医药	500,000	32,270,000.00	0.60
32	000651	格力电器	800,031	29,209,131.81	0.54
33	000938	紫光股份	899,907	28,662,037.95	0.53
34	688111	金山办公	60,000	28,333,200.00	0.53
35	300633	开立医疗	500,000	27,250,000.00	0.51
36	000977	浪潮信息	499,912	24,245,732.00	0.45
37	300567	精测电子	250,000	23,787,500.00	0.44
38	600487	亨通光电	1,499,963	21,989,457.58	0.41
39	600754	锦江酒店	500,000	21,170,000.00	0.39
40	601138	工业富联	800,000	20,160,000.00	0.37
41	300896	爱美客	40,000	17,798,000.00	0.33
42	02269	药明生物	500,000	17,310,174.50	0.32
43	01929	周大福	1,300,000	16,875,921.92	0.31
44	688235	百济神州	150,000	16,366,500.00	0.30
45	01876	百威亚	800,000	14,899,196.80	0.28

		太			
46	600079	人福医药	500,000	13,470,000.00	0.25
47	300286	安科瑞	300,000	11,358,000.00	0.21
48	002156	通富微电	400,000	9,040,000.00	0.17
49	003021	兆威机电	100,000	8,773,000.00	0.16
50	300416	苏试试验	400,027	8,624,582.12	0.16
51	688515	裕太微电子	40,083	6,843,377.25	0.13
52	688498	源杰科技	10,000	2,850,000.00	0.05
53	301345	涛涛车业	2,652	126,242.30	0.00
54	301373	凌玮科技	2,764	89,376.38	0.00
55	301281	科源制药	3,368	88,415.20	0.00
56	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
57	301203	国泰环保	2,243	79,964.22	0.00
58	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.00
59	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
60	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.00
61	688485	九州一轨环科	3,580	54,308.60	0.00
62	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
63	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
64	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
65	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
66	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
67	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
68	603137	恒尚节	1,382	26,502.14	0.00

		能			
69	301317	鑫磊股 份	694	18,161.98	0.00
70	301439	泓淋电 力	949	16,038.10	0.00
71	603135	中重科 技	673	12,152.92	0.00
72	688535	华海诚 科新材 料	201	10,693.23	0.00
73	601065	江西省 盐业集 团	875	10,360.00	0.00
74	601133	柏诚系 统股份 公司	664	8,140.64	0.00
75	301157	华塑科 技	150	7,939.50	0.00
76	603125	江苏常 青树科 技	196	4,949.00	0.00
77	001328	登康口 腔	145	3,696.05	0.00
78	001360	南矿集 团	177	2,631.99	0.00
79	001367	海森药 业	55	2,171.40	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	00700	腾讯控股	229,825,099.77	3.15
2	03690	美团-W	166,315,778.87	2.28
3	000568	泸州老窖	145,549,920.50	1.99
4	600941	中国移动	118,264,163.58	1.62
5	603517	绝味食品	90,201,075.91	1.23
6	688111	金山办公	90,107,522.74	1.23
7	688212	澳华内镜	75,225,588.14	1.03
8	00883	中国海洋	67,838,418.33	0.93

		石油		
9	600702	舍得酒业	67,140,772.00	0.92
10	00388	香港交易所	60,752,036.09	0.83
11	600600	青岛啤酒	32,743,868.00	0.45
11	00168	青岛啤酒股份	27,424,403.05	0.38
12	600809	山西汾酒	58,050,892.61	0.79
13	601138	工业富联	55,993,477.00	0.77
14	300347	泰格医药	54,230,434.00	0.74
15	601318	中国平安	51,596,121.24	0.71
16	603605	珀莱雅	51,325,794.50	0.70
17	000651	格力电器	50,736,803.52	0.69
18	000063	中兴通讯	49,143,702.80	0.67
19	600276	恒瑞医药	46,981,935.20	0.64
20	600519	贵州茅台	42,383,794.00	0.58

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	300750	宁德时代	341,232,340.26	4.67
2	00700	腾讯控股	296,158,381.44	4.05
3	000568	泸州老窖	256,519,295.91	3.51
4	600519	贵州茅台	253,369,403.98	3.47
5	600809	山西汾酒	218,902,686.28	3.00
6	600559	老白干酒	197,690,162.89	2.71
7	02331	李宁	188,890,265.26	2.59
8	000596	古井贡酒	133,841,344.84	1.83
9	600941	中国移动	126,354,078.29	1.73
10	603259	药明康德	105,609,190.20	1.45
11	002049	紫光国微	105,148,128.10	1.44
12	000858	五粮液	94,700,646.68	1.30
13	600641	万业企业	89,448,568.44	1.22
14	688111	金山办公	79,874,785.82	1.09
15	03690	美团-W	79,337,979.48	1.09
16	002594	比亚迪	78,360,325.00	1.07
17	300416	苏试试验	71,756,194.69	0.98
18	002352	顺丰控股	66,374,152.00	0.91

19	00883	中国海洋石油	58,266,293.39	0.80
20	002714	牧原股份	56,853,638.83	0.78

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	3,038,691,338.45
卖出股票收入（成交）总额	4,591,213,242.92

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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	792,437.17
2	应收清算款	9,818,517.83
3	应收股利	15,216,632.19
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,827,587.19

### 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

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（%）
128,013	27,575.31	2,092,323.35	0.06	3,527,906,012.23	99.94

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	5,137,408.98	0.15

### 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 01 月 19 日） 基金份额总额	2,500,996,018.02
本报告期期初基金份额总额	4,294,829,567.98
本报告期基金总申购份额	7,793,075.53
减：本报告期基金总赎回份额	772,624,307.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,529,998,335.58

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

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

报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

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

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

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形。

## 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 建投 证券	4	1,378,400,661.29	18.08	1,017,003.58	18.07	
东方 证券	2	1,163,296,898.72	15.26	867,363.88	15.41	
申万 宏源 证券	3	1,011,645,187.00	13.27	757,793.85	13.46	
太平 洋证 券	1	722,929,324.21	9.48	545,365.87	9.69	
国金 证券	2	716,090,276.13	9.39	518,810.09	9.22	
东吴 证券	3	555,340,616.51	7.28	401,967.84	7.14	
浙商 证券	1	480,518,143.31	6.30	360,303.89	6.40	
西部 证券	2	423,742,555.82	5.56	306,452.61	5.44	
海通 证券	4	360,049,931.64	4.72	259,710.67	4.61	
方正 证券	2	269,758,364.51	3.54	196,411.49	3.49	

中泰证券	2	231,835,032.52	3.04	169,279.04	3.01	
上海证券	2	212,894,367.20	2.79	155,905.47	2.77	
中信证券	3	54,171,173.14	0.71	40,325.18	0.72	
华兴证券	2	23,296,840.94	0.31	16,802.49	0.30	
野村东方国际	2	20,679,151.06	0.27	14,916.00	0.27	
安信证券	2	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
川财证券	2	-	-	-	-	
东北证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
开源证券	2	-	-	-	-	
天风证券	2	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
粤开证券	1	-	-	-	-	
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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权	成交金额	占当期基

		额的比例 (%)		交总额的 比例 (%)		额的比例 (%)		额的比例 (%)
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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 3 家证券公司的 5 个交易单元：开源证券（上交所单元，深交所单

元)、长江证券(上交所单元,深交所单元)、广发证券(深交所单元);不再租用1家证券公司的1个交易单元:太平洋证券(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部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2023年01月18日
2	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
3	关于汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金第五次开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2023年03月09日
4	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
5	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
6	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价值创造定期开放混合型证券投资基金募集的文件;

- 2、《汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富价值创造定期开放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、报告期内汇添富价值创造定期开放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