# 汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 08 月 28 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 2020 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 ..... 2
1.1 重要提示 ..... 2
1.2 目录 ..... 3
§2 基金简介 ..... 5
2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 5
2.4 信息披露方式 ..... 5
2.5 其他相关资料 ..... 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 6
§4 管理人报告 ..... 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 10
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 ..... 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 12
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 ..... 13
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 ..... 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 13
6.1 资产负债表 ..... 13
6.2 利润表 ..... 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 ..... 16
6.4 报表附注 ..... 17
§7 投资组合报告 ..... 39
7.1 期末基金资产组合情况 ..... 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 39
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 ..... 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 49
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 ..... 49
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 ..... 50
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 ..... 50
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 ..... 50

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....50
7.12 投资组合报告附注.....50
§8 基金份额持有人信息.....51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....51
§9 开放式基金份额变动.....51
§10 重大事件揭示.....52
10.1 基金份额持有人大会决议.....52
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.....52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....52
10.4 基金投资策略的改变.....52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....52
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.....52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....53
10.8 其他重大事件.....58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....60
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.....60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....60
§12 备查文件目录.....60
12.1 备查文件目录.....60
12.2 存放地点.....60
12.3 查阅方式.....60

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 汇添富成长多因子量化策略股票 |
| 基金主代码 | 001050 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 02 月 16 日 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额（份） | 659,387,806.76 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于成长型行业的股票，采用基金管理人的金融工程团队开发的多因子量化策略进行选股。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率×90%+活期存款利率（税后）×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的基金产品。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 汇添富基金管理股份有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李鹏 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-28932888 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@99fund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-9918 | 95588 |
| 传真 | | 021-28932998 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100140 |
| 法定代表人 | | 李文 | 陈四清 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |

| | |
|---|---|
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 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 | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 |

# §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(2020 年 01 月 01 日 - 2020 年 06 月 30 日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 153,050,050.48 |
| 本期利润 | 203,693,400.61 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2655 |
| 本期加权平均净值利润率 | 20.46% |
| 本期基金份额净值增长率 | 22.76% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020 年 06 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 112,936,847.89 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1713 |
| 期末基金资产净值 | 974,409,394.71 |
| 期末基金份额净值 | 1.478 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020 年 06 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 47.80% |

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 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较 | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | 增长率① | 增长率标准差② | 准收益率③ | 基准收益率标准差④ | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 11.30% | 0.93% | 7.61% | 0.79% | 3.69% | 0.14% |
| 过去三个月 | 21.75% | 1.05% | 14.63% | 1.02% | 7.12% | 0.03% |
| 过去六个月 | 22.76% | 1.66% | 10.35% | 1.61% | 12.41% | 0.05% |
| 过去一年 | 35.60% | 1.35% | 16.79% | 1.31% | 18.81% | 0.04% |
| 过去三年 | 34.73% | 1.32% | -3.22% | 1.32% | 37.95% | 0.00% |
| 自基金合同生效日起至今 | 47.80% | 1.78% | 1.60% | 1.65% | 46.20% | 0.13% |

### 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

注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2015 年 02 月 16 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

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本金为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。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 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2020 上半年，汇添富基金新成立 11 只公开募集证券投资基金，包括 4 只债券型基金、5 只混合型基金、1 只基金中基金、1 只指数基金联接基金。截至 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 154 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 | | |
| 吴振翔 | 本基金的基金经理、指数与量化投资部副总监 | 2015 年 02 月 16 日 | | 14 | 国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金的基金经理，2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金的基金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理，2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015 年 3 月 24 日至今任汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理，2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的基金经理，2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数（LOF）的基金经理，2018 年 3 月 23 日至今任添富价值多因子股票的基金经理，2019 年 7 月 26 日至今任添富中证长三角 ETF 的基金经理，2019 年 9 月 24 日至今任汇添富中证长三角 ETF 联接的基金经理，2019 年 11 月 6 日任添富中证国企一带一路 ETF 的基金经理，2020 年 3 月 5 日任添富中证国企一带一路 ETF 联接基金的基金经理。 |
| 许一尊 | 本基金的基金经理 | 2015 年 11 月 24 日 | | 10 | 国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部高级分析师。2015 年 11 月 24 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票基金的基金经理，2018 年 3 月 23 日至今任添富价值多因子股票基金的基金经理。 |

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“离职日期”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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 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：本报告期末本基金不存在基金经理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

本基金管理人高度重视投资者利益保护。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据 95%置信区间下平均价差率的 T 检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司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，本公司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 34 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，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

回顾上半年，新冠疫情对经济基本面以及投资者情绪形成较大影响，市场波动剧烈。疫情影响下，多国央行启动政策工具为市场注入流动性，全球进入显著的流动性宽松态势，资本市场表现出疫情恐慌后的反弹行情。随着疫情在全球的蔓延和反复，各国在防控和复工之间进行差异化的政策权衡。国内由于疫情防控启动早、力度强，疫情得到有效控制，复工复产进度显著快于其他受影响国家，就业物价总体平稳，经济逐步恢复。国外疫情仍存在一定的挑战和反复，经济复苏进程相对缓慢。

政策方面，疫情防控逐步转向常态化，政策围绕做好“六稳”工作、落实“六保”任务，稳企业、保就业，进一步降低企业负担，加大货币信贷支持力度。市场流动性维持合理充裕，资金利率仍处于较低水平，为权益资产创造了良好的政策和金融环境。

投资者结构方面，以北上资金为代表的外资持续流入 A 股，公募主动权益基金发行火热，赚钱效应初显，带来增量资金的同时进一步提高了 A 股的机构化程度。

上半年行业分化明显，疫情冲击下，盈利相对稳定、具有“内循环”性质、享受确定性溢价的医药、消费板块以及中长期行业景气度较高、符合产业发展方向的科技板块表现出色。风格方面同样分化明显，成长、盈利、质量、分析师预期等反映核心资产风格的因子表现出色；低估值因子持续回撤，幅度达到近十年峰值；市场活跃度提升，市场面因子同样表现较好。整体看，成长、预期、动量等趋势类因子收益远好于价值、低波动等偏逆向的因子。

报告期内，本基金遵循量化基金投资原则，相对业绩比较基准保持了相对均衡的行业配置和风格配置，在质量、盈利、成长、估值、预期以及市场面选股因子上保持了较均衡的暴露，跟踪误差得到了较为有效的控制，同时进一步优化组合的精细化管理及风险控制能力，获得了相对稳定的超额收益。

### 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 22.76%。同期业绩比较基准收益率为 10.35%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在疫情冲击的背景下，国内防控措施有力，经济体现了较强的韧性，复工复产稳步推进，下半年稳定向好态势仍将持续。然而国外疫情仍存在反复，中美贸易摩擦等冲突点在疫情冲击下进一步被放大，给外需带来一定的不确定性。在此背景下，经济内循环的重要性进一步提升，政策着力点将更多地转向内需挖掘与构建相对完善的供应链体系，提高国内大循环的质量，扩张性的财政政策的逐步落地实施有望带动相关产业链的修复和发展。

资金面角度，资本市场存在改革预期，理财收益率下行，同时国内居民资产在权益资产的配置比例相比发达国家仍然较低，在坚持“房住不炒”的大背景下，权益资产的相对吸引力提升；当前权益基金发行火热，赚钱效用显现；同时资本市场进一步对外开放，海外资金长期看大概率仍将持续流入。整体看 A 股未来资金面仍相对充裕。

风格上，上半年的 A 股市场呈现极强的结构性行情特征。各行业估值分化水平接近历史峰值，成长、动量等趋势类风格收益远好于价值、低波动等逆向类风格。未来随着全球疫情的好转、经济的逐步复苏，行业间的估值差异可能有所收敛，市场热点有望逐步扩散。估值相对合理、行业配置均衡的大中盘宽基指数及在此基础上的量化增强产品可能有较好的配置价值。

作为量化基金，本基金将相对业绩比较基准保持相对均衡的风格和行业配置，在质量、盈利、成长、估值、预期以及市场面等选股因子上保持相对均衡的暴露，力争实现相对较为稳定的超额收益。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，应参照协会通知执行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，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，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

## 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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次

数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行收益分配。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2020 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 54,339,026.19 | 74,940,703.47 |
| 结算备付金 | | 14,190,606.02 | 15,600,221.00 |
| 存出保证金 | | 179,160.93 | 243,636.95 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 902,331,433.17 | 1,007,067,797.80 |
| 其中：股票投资 | | 902,331,433.17 | 1,005,120,597.80 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 1,947,200.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 11,416,964.41 | 8,206,101.97 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 10,889.45 | 23,913.57 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 681,028.22 | 138,354.09 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 983,149,108.39 | 1,106,220,728.85 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2020 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 5,230,884.81 | 2,635,525.20 |
| 应付管理人报酬 | | 1,181,532.67 | 1,371,597.82 |
| 应付托管费 | | 196,922.12 | 228,599.64 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 2,024,678.57 | 3,002,477.07 |
| 应交税费 | | 12.93 | 8.48 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 105,682.58 | 310,364.90 |
| 负债合计 | | 8,739,713.68 | 7,548,573.11 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 659,387,806.76 | 912,893,299.44 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 315,021,587.95 | 185,778,856.30 |
| 所有者权益合计 | | 974,409,394.71 | 1,098,672,155.74 |
| 负债和所有者权益总计 | | 983,149,108.39 | 1,106,220,728.85 |

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.478 元，基金份额总额 659,387,806.76 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日<br>至 2020 年 06 月 30<br>日 | 上年度可比期间<br>2019 年 01 月 01 日<br>至 2019 年 06 月 30<br>日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | **219,743,127.57** | **254,448,114.78** |
| 1.利息收入 | | 370,196.72 | 441,006.81 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 327,254.20 | 440,848.29 |
| 债券利息收入 | | 42,942.52 | 158.52 |
| 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） | | 168,551,936.13 | 214,560,454.39 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 159,371,767.16 | 203,893,031.48 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | 709,462.13 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14.2 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | - | -3,422,960.00 |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 8,470,706.84 | 14,090,382.91 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 50,643,350.13 | 39,292,530.68 |
| 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 | 177,644.59 | 154,122.90 |
| **减：二、费用** | | **16,049,726.96** | **20,916,905.88** |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 7,446,429.00 | 8,253,011.81 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,241,071.51 | 1,375,501.99 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.20 | 7,248,158.13 | 11,143,575.89 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 6.18 | 0.50 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.21 | 114,062.14 | 144,815.69 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | **203,693,400.61** | **233,531,208.90** |
| 减：所得税费用 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | **203,693,400.61** | **233,531,208.90** |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 912,893,299.44 | 185,778,856.30 | 1,098,672,155.74 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 203,693,400.61 | 203,693,400.61 |
| 三、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） | -253,505,492.68 | -74,450,668.96 | -327,956,161.64 |
| 其中：1.基金申购款 | 56,610,382.21 | 16,418,835.54 | 73,029,217.75 |
| 2.基金赎回款 | -310,115,874.89 | -90,869,504.50 | -400,985,379.39 |
| 四、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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 659,387,806.76 | 315,021,587.95 | 974,409,394.71 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,110,512,318.72 | -134,977,176.15 | 975,535,142.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 233,531,208.90 | 233,531,208.90 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -69,025,282.37 | -4,968,587.00 | -73,993,869.37 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| （净值减少以“-”号填列） | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 74,973,994.34 | 4,900,301.70 | 79,874,296.04 |
| 2.基金赎回款 | -143,999,276.71 | -9,868,888.70 | -153,868,165.41 |
| 四、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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,041,487,036.35 | 93,585,445.75 | 1,135,072,482.10 |

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

汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]117 号文《关于准予汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金注册的批复》的准予注册，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2015 年 2 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 1,903,140,954.30 份基金份额。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和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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)。本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×90%+活期存款利率（税后）×10%。

### 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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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 2 号《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年 01 月 01 日至 2020 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 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

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 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暂行条例（2011 年修订）》、《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。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 54,339,026.19 |
| 定期存款 | - |
| 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 | - |
| 合计 | 54,339,026.19 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2020 年 06 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 815,455,280.70 | 902,331,433.17 | 86,876,152.47 |
| 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 | | 815,455,280.70 | 902,331,433.17 | 86,876,152.47 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 应收活期存款利息 | 5,392.72 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 5,424.19 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 72.54 |
| 合计 | 10,889.45 |

注：“其他”为应收结算保证金利息。

### 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 应付交易费用

单位： 人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 2,024,678.57 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 2,024,678.57 |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,256.44 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付审计费 | 44,753.80 |
| 应付信息披露费 | 59,672.34 |
| 应付指数使用费 | - |
| 应付账户维护费 | - |
| 应付汇划费 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 105,682.58 |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 912,893,299.44 | 912,893,299.44 |
| 本期申购 | 56,610,382.21 | 56,610,382.21 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -310,115,874.89 | -310,115,874.89 |
| 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 | 659,387,806.76 | 659,387,806.76 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 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 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | -23,813,110.79 | 209,591,967.09 | 185,778,856.30 |
| 本期利润 | 153,050,050.48 | 50,643,350.13 | 203,693,400.61 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -16,300,091.80 | -58,150,577.16 | -74,450,668.96 |
| 其中：基金申购款 | 4,140,443.31 | 12,278,392.23 | 16,418,835.54 |
| 基金赎回款 | -20,440,535.11 | -70,428,969.39 | -90,869,504.50 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 112,936,847.89 | 202,084,740.06 | 315,021,587.95 |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 200,714.51 |
| 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 | 124,817.18 |
| 其他 | 1,722.51 |
| 合计 | 327,254.20 |

注:“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 2,496,446,782.01 |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,337,075,014.85 |
| 买卖股票差价收入 | 159,371,767.16 |

### 6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

### 6.4.7.14 债券投资收益

### 6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 7,704,117.64 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 6,897,140.50 |
| 减：应收利息总额 | 97,515.01 |
| 买卖债券差价收入 | 709,462.13 |

### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 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——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 8,470,706.84 |
| 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 | 8,470,706.84 |

### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 50,643,350.13 |
| ——股票投资 | 50,643,350.13 |
| ——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 | 50,643,350.13 |

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 177,644.59 |
| 替代损益 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 177,644.59 |

## 6.4.7.20 交易费用

单位： 人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 7,248,158.13 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 7,248,158.13 |

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 44,753.80 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 银行费用 | 636.00 |
| 指数使用费 | - |
| 持有人大会-公证费 | - |
| 持有人大会-律师费 | - |
| 开户费 | - |
| 上市费 | - |
| 其他 | - |

| | |
|---|---|
| 合计 | 114,062.14 |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | | 上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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 | 348,409,660.46 | 7.46 | 1,539,062,303.01 | 20.96 |

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | | 上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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 | 1,390,503.20 | 13.07 | - | - |

### 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 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。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 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 | 319,658.92 | 7.44 | 128,626.64 | 6.35 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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 | 1,418,226.54 | 20.97 | 860,511.81 | 24.21 |

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<br>2020 年 01 月 01 日至<br>2020 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 01 月 01 日至<br>2019 年 06 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 7,446,429.00 | 8,253,011.81 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,453,143.85 | 3,153,091.32 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。

计算方法如下：H=E×1.50%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 01 月 01 日至<br>2020 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 01 月 01 日至<br>2019 年 06 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,241,071.51 | 1,375,501.99 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### 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：本基金本报告期末不存在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。

### 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：本基金本报告期末不存在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。

### 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：本基金除管理人之外的其他关联方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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | | 上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 工商银行 | 54,339,026.19 | 200,714.51 | 103,039,506.40 | 351,587.63 |

### 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。

### 6.4.12 期末（2020 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

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券 | 成功认购 | 可流通日 | 流通受限 | 认购价格 | 期末估值 | 数量（单 | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |

| | 名称 | 日 | | 类型 | | 单价 | 位：股） | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300840 | 酷特智能 | 2020 年 06 月 30 日 | 2020 年 07 月 08 日 | 新股流通受限 | 5.94 | 5.94 | 1,185 | 7,038.90 | 7,038.90 | |
| 300846 | 首都在线 | 2020 年 06 月 22 日 | 2020 年 07 月 01 日 | 新股流通受限 | 3.37 | 3.37 | 1,131 | 3,811.47 | 3,811.47 | |
| 688568 | 中科星图 | 2020 年 06 月 30 日 | 2020 年 07 月 08 日 | 新股流通受限 | 16.21 | 16.21 | 11,020 | 178,634.20 | 178,634.20 | |
| 688027 | 国盾量子 | 2020 年 06 月 30 日 | 2020 年 07 月 09 日 | 新股流通受限 | 36.18 | 36.18 | 2,830 | 102,389.40 | 102,389.40 | |
| 688528 | 秦川物联 | 2020 年 06 月 19 日 | 2020 年 07 月 01 日 | 新股流通受限 | 11.33 | 11.33 | 8,337 | 94,458.21 | 94,458.21 | |
| 300847 | 中船汉光 | 2020 年 06 月 29 日 | 2020 年 07 月 09 日 | 新股流通受限 | 6.94 | 6.94 | 1,421 | 9,861.74 | 9,861.74 | |
| 688377 | 迪威尔 | 2020 年 06 月 29 | 2021 年 01 月 08 日 | 新股流通受限 | 16.42 | 16.42 | 7,894 | 129,619.48 | 129,619.48 | |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 日 | | | | | | | | |
| 688518 | 联赢激光 | 2020 年 06 月 12 日 | 2020 年 12 月 22 日 | 新股流通受限 | 7.81 | 20.83 | 14,111 | 110,206.91 | 293,932.13 | |
| 300845 | 捷安高科 | 2020 年 06 月 24 日 | 2020 年 07 月 03 日 | 新股流通受限 | 17.63 | 17.63 | 470 | 8,286.10 | 8,286.10 | |
| 300843 | 胜蓝股份 | 2020 年 06 月 23 日 | 2020 年 07 月 02 日 | 新股流通受限 | 10.01 | 10.01 | 751 | 7,517.51 | 7,517.51 | |
| 688277 | 天智航 | 2020 年 06 月 24 日 | 2020 年 07 月 07 日 | 新股流通受限 | 12.04 | 12.04 | 8,810 | 106,072.40 | 106,072.40 | |

### 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 2020 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金融资产款余额。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 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金融资产款余额。

### 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 2020 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本报告期末本基金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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资、买入返售金融资产及部分应收申购款等。本基金的生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020 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 | 54,339,026.19 | - | - | - | - | - | 54,339,026.19 |
| 结算备付金 | 14,190,606.02 | - | - | - | - | - | 14,190,606.02 |
| 存出保证金 | 179,160.93 | - | - | - | - | - | 179,160.93 |
| 交易性金 | - | - | - | - | - | 902,331,43 | 902,331, |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 融资产 | | | | | | 3.17 | 433.17 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 10,889.45 | 10,889.45 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 681,028.22 | 681,028.22 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 11,416,964.41 | 11,416,964.41 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 68,708,793.14 | - | - | - | - | 914,440,315.25 | 983,149,108.39 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 5,230,884.81 | 5,230,884.81 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,181,532.67 | 1,181,532.67 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 196,922.12 | 196,922.12 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 2,024,678.57 | 2,024,678.57 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 12.93 | 12.93 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 105,682.58 | 105,682.58 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 8,739,713.68 | 8,739,713.68 |
| 利率敏感度缺口 | 68,708,793.14 | - | - | - | - | 905,700,601.57 | 974,409,394.71 |
| 上年度末 2019 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 | 74,940,703.47 | - | - | - | - | - | 74,940,703.47 |
| 结算备付金 | 15,600,221.00 | - | - | - | - | - | 15,600,221.00 |
| 存出保证金 | 243,636.95 | - | - | - | - | - | 243,636.95 |
| 交易性金融资产 | - | - | 1,947,200.00 | - | - | 1,005,120,597.80 | 1,007,067,797.80 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 23,913.57 | 23,913.57 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 138,354.09 | 138,354.09 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 8,206,101.97 | 8,206,101.97 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 90,784,561.42 | - | 1,947,200.00 | - | - | 1,013,488,967.43 | 1,106,220,728.85 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 2,635,525.20 | 2,635,525.20 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,371,597.82 | 1,371,597.82 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 228,599.64 | 228,599.64 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 3,002,477.07 | 3,002,477.07 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 8.48 | 8.48 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 310,364.90 | 310,364. |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | | 90 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 7,548,573.11 | 7,548,573.11 |
| 利率敏感度缺口 | 90,784,561.42 | - | 1,947,200.00 | - | - | 1,005,940,394.32 | 1,098,672,155.74 |

注:上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。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

注：本基金持有的可转换债和可交换债的市场风险在附注 6.4.13.4.3.2 中进行披露；除此之外，本基金本报告期及上年度末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且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其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

### 6.4.13.4.2 外汇风险

注：本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

### 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 2020 年 06 月 30 日 | | 上年度末 2019 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 | 902,331,433.17 | 92.60 | 1,005,120,597.80 | 91.49 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产－债券投资 | - | - | 1,947,200.00 | 0.18 |
| 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 | 902,331,433.17 | 92.60 | 1,007,067,797.80 | 91.66 |

注：本基金股票资产不低于基金资产的 80%，其中投资于成长型行业的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表所示。

### 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 2020 年 06 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
| | 中证 500 指数上涨 5% | 44,069,989.06 | 47,085,788.19 |
| | 中证 500 指数下跌 5% | -44,069,989.06 | -47,085,788.19 |

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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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 | 902,331,433.17 | 91.78 |
| | 其中：股票 | 902,331,433.17 | 91.78 |
| 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 | 68,529,632.21 | 6.97 |
| 8 | 其他资产 | 12,288,043.01 | 1.25 |
| 9 | 合计 | 983,149,108.39 | 100.00 |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,634,660.00 | 0.27 |
| B | 采矿业 | 15,149,144.00 | 1.55 |
| C | 制造业 | 570,153,509.56 | 58.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 23,785,301.32 | 2.44 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| E | 建筑业 | 12,175,208.00 | 1.25 |
| F | 批发和零售业 | 35,818,676.92 | 3.68 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,272,569.00 | 1.46 |
| H | 住宿和餐饮业 | 2,031,300.00 | 0.21 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 94,863,182.57 | 9.74 |
| J | 金融业 | 55,823,850.00 | 5.73 |
| K | 房地产业 | 26,934,397.00 | 2.76 |
| L | 租赁和商务服务业 | 18,689,670.00 | 1.92 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,434,620.80 | 0.35 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 6,612,958.00 | 0.68 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 19,952,386.00 | 2.05 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 902,331,433.17 | 92.60 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300482 | 万孚生物 | 156,400 | 16,265,600.00 | 1.67 |
| 2 | 002511 | 中顺洁柔 | 653,100 | 14,564,130.00 | 1.49 |
| 3 | 600298 | 安琪酵母 | 291,600 | 14,428,368.00 | 1.48 |
| 4 | 300316 | 晶盛机电 | 571,300 | 14,133,962.00 | 1.45 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 5 | 300558 | 贝达药业 | 98,300 | 13,760,034.00 | 1.41 |
| 6 | 603939 | 益丰药房 | 145,460 | 13,236,860.00 | 1.36 |
| 7 | 300327 | 中颖电子 | 405,852 | 13,149,604.80 | 1.35 |
| 8 | 600486 | 扬农化工 | 157,400 | 12,985,500.00 | 1.33 |
| 9 | 002555 | 三七互娱 | 277,000 | 12,963,600.00 | 1.33 |
| 10 | 000975 | 银泰黄金 | 799,300 | 12,533,024.00 | 1.29 |
| 11 | 601688 | 华泰证券 | 638,900 | 12,011,320.00 | 1.23 |
| 12 | 300662 | 科锐国际 | 263,500 | 11,725,750.00 | 1.20 |
| 13 | 603444 | 吉比特 | 20,300 | 11,144,903.00 | 1.14 |
| 14 | 300529 | 健帆生物 | 160,060 | 11,124,170.00 | 1.14 |
| 15 | 300383 | 光环新网 | 423,300 | 11,035,431.00 | 1.13 |
| 16 | 000513 | 丽珠集团 | 223,900 | 10,749,439.00 | 1.10 |
| 17 | 600426 | 华鲁恒升 | 578,700 | 10,231,416.00 | 1.05 |
| 18 | 600845 | 宝信软件 | 172,305 | 10,179,779.40 | 1.04 |
| 19 | 603816 | 顾家家居 | 219,500 | 9,879,695.00 | 1.01 |
| 20 | 601965 | 中国汽研 | 1,129,300 | 9,847,496.00 | 1.01 |
| 21 | 603866 | 桃李面包 | 189,400 | 9,638,566.00 | 0.99 |
| 22 | 000858 | 五 粮 液 | 56,000 | 9,582,720.00 | 0.98 |
| 23 | 600325 | 华发股份 | 1,314,300 | 9,278,958.00 | 0.95 |
| 24 | 600885 | 宏发股份 | 222,600 | 8,930,712.00 | 0.92 |
| 25 | 601336 | 新华保险 | 200,200 | 8,864,856.00 | 0.91 |
| 26 | 002557 | 洽洽食品 | 161,600 | 8,757,104.00 | 0.90 |
| 27 | 002912 | 中新赛克 | 53,100 | 8,686,629.00 | 0.89 |
| 28 | 600782 | 新钢股份 | 2,120,300 | 8,650,824.00 | 0.89 |
| 29 | 002001 | 新 和 成 | 295,200 | 8,590,320.00 | 0.88 |
| 30 | 600125 | 铁龙物流 | 1,531,900 | 8,548,002.00 | 0.88 |
| 31 | 300133 | 华策影视 | 1,176,600 | 8,530,350.00 | 0.88 |
| 32 | 601233 | 桐昆股份 | 642,900 | 8,203,404.00 | 0.84 |
| 33 | 603612 | 索通发展 | 707,400 | 8,078,508.00 | 0.83 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 34 | 002242 | 九阳股份 | 205,100 | 7,644,077.00 | 0.78 |
| 35 | 300088 | 长信科技 | 649,800 | 7,277,760.00 | 0.75 |
| 36 | 002624 | 完美世界 | 123,000 | 7,089,720.00 | 0.73 |
| 37 | 600195 | 中牧股份 | 419,100 | 6,801,993.00 | 0.70 |
| 38 | 300630 | 普利制药 | 91,900 | 6,796,005.00 | 0.70 |
| 39 | 002901 | 大博医疗 | 56,076 | 6,689,306.04 | 0.69 |
| 40 | 601139 | 深圳燃气 | 1,014,100 | 6,591,650.00 | 0.68 |
| 41 | 600566 | 济川药业 | 256,200 | 6,522,852.00 | 0.67 |
| 42 | 603883 | 老百姓 | 63,800 | 6,382,552.00 | 0.66 |
| 43 | 000739 | 普洛药业 | 272,500 | 6,346,525.00 | 0.65 |
| 44 | 002212 | 南洋股份 | 236,600 | 6,288,828.00 | 0.65 |
| 45 | 603708 | 家家悦 | 126,302 | 6,221,636.52 | 0.64 |
| 46 | 600926 | 杭州银行 | 676,000 | 6,029,920.00 | 0.62 |
| 47 | 002078 | 太阳纸业 | 632,100 | 6,017,592.00 | 0.62 |
| 48 | 300369 | 绿盟科技 | 256,600 | 5,976,214.00 | 0.61 |
| 49 | 300059 | 东方财富 | 290,740 | 5,872,948.00 | 0.60 |
| 50 | 002706 | 良信电器 | 343,800 | 5,734,584.00 | 0.59 |
| 51 | 002139 | 拓邦股份 | 991,500 | 5,582,145.00 | 0.57 |
| 52 | 300737 | 科顺股份 | 282,200 | 5,567,806.00 | 0.57 |
| 53 | 300607 | 拓斯达 | 135,720 | 5,522,446.80 | 0.57 |
| 54 | 002643 | 万润股份 | 321,300 | 5,516,721.00 | 0.57 |
| 55 | 300308 | 中际旭创 | 86,400 | 5,443,200.00 | 0.56 |
| 56 | 000600 | 建投能源 | 1,060,800 | 5,399,472.00 | 0.55 |
| 57 | 300114 | 中航电测 | 469,700 | 5,359,277.00 | 0.55 |
| 58 | 002626 | 金达威 | 205,800 | 5,342,568.00 | 0.55 |
| 59 | 300394 | 天孚通信 | 88,000 | 5,240,400.00 | 0.54 |
| 60 | 002531 | 天顺风能 | 871,920 | 5,214,081.60 | 0.54 |
| 61 | 300559 | 佳发教育 | 244,900 | 5,196,778.00 | 0.53 |
| 62 | 600285 | 羚锐制药 | 555,100 | 5,190,185.00 | 0.53 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 63 | 000060 | 中金岭南 | 1,387,700 | 5,162,244.00 | 0.53 |
| 64 | 300628 | 亿联网络 | 75,500 | 5,153,630.00 | 0.53 |
| 65 | 603606 | 东方电缆 | 353,300 | 5,136,982.00 | 0.53 |
| 66 | 601939 | 建设银行 | 805,900 | 5,085,229.00 | 0.52 |
| 67 | 002244 | 滨江集团 | 1,171,800 | 5,003,586.00 | 0.51 |
| 68 | 603556 | 海兴电力 | 344,903 | 4,980,399.32 | 0.51 |
| 69 | 000661 | 长春高新 | 11,400 | 4,962,420.00 | 0.51 |
| 70 | 600846 | 同济科技 | 583,300 | 4,958,050.00 | 0.51 |
| 71 | 300476 | 胜宏科技 | 205,800 | 4,949,490.00 | 0.51 |
| 72 | 000823 | 超声电子 | 354,700 | 4,933,877.00 | 0.51 |
| 73 | 002538 | 司尔特 | 1,022,700 | 4,919,187.00 | 0.50 |
| 74 | 601966 | 玲珑轮胎 | 241,000 | 4,868,200.00 | 0.50 |
| 75 | 000915 | 山大华特 | 148,600 | 4,866,650.00 | 0.50 |
| 76 | 002664 | 长鹰信质 | 366,800 | 4,849,096.00 | 0.50 |
| 77 | 601799 | 星宇股份 | 38,002 | 4,826,254.00 | 0.50 |
| 78 | 002013 | 中航机电 | 607,600 | 4,800,040.00 | 0.49 |
| 79 | 603648 | 畅联股份 | 542,000 | 4,769,600.00 | 0.49 |
| 80 | 600757 | 长江传媒 | 936,100 | 4,764,749.00 | 0.49 |
| 81 | 000657 | 中钨高新 | 792,900 | 4,725,684.00 | 0.48 |
| 82 | 002443 | 金洲管道 | 693,900 | 4,725,459.00 | 0.48 |
| 83 | 002106 | 莱宝高科 | 354,000 | 4,651,560.00 | 0.48 |
| 84 | 300502 | 新易盛 | 73,460 | 4,636,795.20 | 0.48 |
| 85 | 002475 | 立讯精密 | 89,787 | 4,610,562.45 | 0.47 |
| 86 | 300679 | 电连技术 | 143,800 | 4,598,724.00 | 0.47 |
| 87 | 603218 | 日月股份 | 248,640 | 4,550,112.00 | 0.47 |
| 88 | 600308 | 华泰股份 | 981,600 | 4,515,360.00 | 0.46 |
| 89 | 600276 | 恒瑞医药 | 48,720 | 4,496,856.00 | 0.46 |
| 90 | 601128 | 常熟银行 | 590,600 | 4,435,406.00 | 0.46 |
| 91 | 300699 | 光威复材 | 70,400 | 4,416,192.00 | 0.45 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 92 | 603882 | 金域医学 | 49,300 | 4,412,350.00 | 0.45 |
| 93 | 600657 | 信达地产 | 1,062,700 | 4,378,324.00 | 0.45 |
| 94 | 603233 | 大参林 | 53,520 | 4,346,894.40 | 0.45 |
| 95 | 002777 | 久远银海 | 142,940 | 4,346,805.40 | 0.45 |
| 96 | 002080 | 中材科技 | 280,100 | 4,341,550.00 | 0.45 |
| 97 | 300496 | 中科创达 | 54,600 | 4,242,420.00 | 0.44 |
| 98 | 300424 | 航新科技 | 315,800 | 4,225,404.00 | 0.43 |
| 99 | 000951 | 中国重汽 | 135,100 | 4,223,226.00 | 0.43 |
| 100 | 600466 | 蓝光发展 | 773,100 | 4,167,009.00 | 0.43 |
| 101 | 000036 | 华联控股 | 933,300 | 4,106,520.00 | 0.42 |
| 102 | 600901 | 江苏租赁 | 777,900 | 4,052,859.00 | 0.42 |
| 103 | 603328 | 依顿电子 | 378,500 | 3,947,755.00 | 0.41 |
| 104 | 300638 | 广和通 | 63,000 | 3,786,300.00 | 0.39 |
| 105 | 600529 | 山东药玻 | 65,000 | 3,770,000.00 | 0.39 |
| 106 | 002869 | 金溢科技 | 55,900 | 3,693,872.00 | 0.38 |
| 107 | 300229 | 拓尔思 | 319,950 | 3,673,026.00 | 0.38 |
| 108 | 300474 | 景嘉微 | 54,300 | 3,654,390.00 | 0.38 |
| 109 | 000543 | 皖能电力 | 907,900 | 3,649,758.00 | 0.37 |
| 110 | 601000 | 唐山港 | 1,602,000 | 3,572,460.00 | 0.37 |
| 111 | 600908 | 无锡银行 | 727,300 | 3,571,043.00 | 0.37 |
| 112 | 600909 | 华安证券 | 522,600 | 3,569,358.00 | 0.37 |
| 113 | 300613 | 富瀚微 | 31,420 | 3,559,886.00 | 0.37 |
| 114 | 002821 | 凯莱英 | 14,400 | 3,499,200.00 | 0.36 |
| 115 | 000544 | 中原环保 | 534,300 | 3,478,293.00 | 0.36 |
| 116 | 603568 | 伟明环保 | 148,044 | 3,434,620.80 | 0.35 |
| 117 | 600850 | 华东电脑 | 130,100 | 3,188,751.00 | 0.33 |
| 118 | 601811 | 新华文轩 | 310,600 | 3,158,802.00 | 0.32 |
| 119 | 600582 | 天地科技 | 1,068,600 | 3,130,998.00 | 0.32 |
| 120 | 601933 | 永辉超市 | 319,600 | 2,997,848.00 | 0.31 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 121 | 600027 | 华电国际 | 873,900 | 2,988,738.00 | 0.31 |
| 122 | 601717 | 郑煤机 | 500,200 | 2,946,178.00 | 0.30 |
| 123 | 603359 | 东珠生态 | 175,200 | 2,931,096.00 | 0.30 |
| 124 | 600875 | 东方电气 | 322,500 | 2,854,125.00 | 0.29 |
| 125 | 600563 | 法拉电子 | 44,700 | 2,762,460.00 | 0.28 |
| 126 | 603605 | 珀莱雅 | 15,200 | 2,736,304.00 | 0.28 |
| 127 | 000547 | 航天发展 | 194,500 | 2,658,815.00 | 0.27 |
| 128 | 000012 | 南　玻Ａ | 529,500 | 2,658,090.00 | 0.27 |
| 129 | 002714 | 牧原股份 | 32,130 | 2,634,660.00 | 0.27 |
| 130 | 601020 | 华钰矿业 | 335,400 | 2,616,120.00 | 0.27 |
| 131 | 300014 | 亿纬锂能 | 53,894 | 2,578,827.90 | 0.26 |
| 132 | 603707 | 健友股份 | 38,400 | 2,479,488.00 | 0.25 |
| 133 | 600933 | 爱柯迪 | 177,700 | 2,473,584.00 | 0.25 |
| 134 | 603686 | 龙马环卫 | 96,500 | 2,351,705.00 | 0.24 |
| 135 | 601163 | 三角轮胎 | 171,200 | 2,266,688.00 | 0.23 |
| 136 | 002648 | 卫星石化 | 137,800 | 2,242,006.00 | 0.23 |
| 137 | 300115 | 长盈精密 | 97,600 | 2,230,160.00 | 0.23 |
| 138 | 603678 | 火炬电子 | 79,200 | 2,219,184.00 | 0.23 |
| 139 | 300347 | 泰格医药 | 21,600 | 2,200,608.00 | 0.23 |
| 140 | 300124 | 汇川技术 | 57,800 | 2,195,822.00 | 0.23 |
| 141 | 002818 | 富森美 | 178,400 | 2,194,320.00 | 0.23 |
| 142 | 603338 | 浙江鼎力 | 28,700 | 2,174,599.00 | 0.22 |
| 143 | 603063 | 禾望电气 | 303,100 | 2,158,072.00 | 0.22 |
| 144 | 600017 | 日照港 | 864,300 | 2,152,107.00 | 0.22 |
| 145 | 002091 | 江苏国泰 | 348,700 | 2,109,635.00 | 0.22 |
| 146 | 002833 | 弘亚数控 | 83,200 | 2,040,896.00 | 0.21 |
| 147 | 600754 | 锦江酒店 | 73,200 | 2,031,300.00 | 0.21 |
| 148 | 600436 | 片仔癀 | 11,700 | 1,991,925.00 | 0.20 |
| 149 | 002138 | 顺络电子 | 78,800 | 1,966,060.00 | 0.20 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 150 | 002028 | 思源电气 | 94,300 | 1,929,378.00 | 0.20 |
| 151 | 600742 | 一汽富维 | 232,830 | 1,913,862.60 | 0.20 |
| 152 | 300552 | 万集科技 | 43,700 | 1,860,746.00 | 0.19 |
| 153 | 600970 | 中材国际 | 351,400 | 1,855,392.00 | 0.19 |
| 154 | 300285 | 国瓷材料 | 54,500 | 1,826,295.00 | 0.19 |
| 155 | 601012 | 隆基股份 | 44,200 | 1,800,266.00 | 0.18 |
| 156 | 600273 | 嘉化能源 | 203,200 | 1,775,968.00 | 0.18 |
| 157 | 002484 | 江海股份 | 186,800 | 1,731,636.00 | 0.18 |
| 158 | 002233 | 塔牌集团 | 143,300 | 1,723,899.00 | 0.18 |
| 159 | 601016 | 节能风电 | 785,200 | 1,664,624.00 | 0.17 |
| 160 | 002478 | 常宝股份 | 332,400 | 1,605,492.00 | 0.16 |
| 161 | 000090 | 天健集团 | 224,500 | 1,551,295.00 | 0.16 |
| 162 | 600373 | 中文传媒 | 125,600 | 1,479,568.00 | 0.15 |
| 163 | 300709 | 精研科技 | 14,500 | 1,394,175.00 | 0.14 |
| 164 | 000156 | 华数传媒 | 124,900 | 1,352,667.00 | 0.14 |
| 165 | 002463 | 沪电股份 | 53,800 | 1,343,924.00 | 0.14 |
| 166 | 600422 | 昆药集团 | 135,300 | 1,320,528.00 | 0.14 |
| 167 | 601838 | 成都银行 | 164,100 | 1,306,236.00 | 0.13 |
| 168 | 600552 | 凯盛科技 | 192,800 | 1,253,200.00 | 0.13 |
| 169 | 002925 | 盈趣科技 | 21,200 | 1,228,328.00 | 0.13 |
| 170 | 002518 | 科士达 | 84,800 | 1,051,520.00 | 0.11 |
| 171 | 600030 | 中信证券 | 42,500 | 1,024,675.00 | 0.11 |
| 172 | 601137 | 博威合金 | 65,300 | 1,021,292.00 | 0.10 |
| 173 | 002916 | 深南电路 | 6,000 | 1,005,120.00 | 0.10 |
| 174 | 000786 | 北新建材 | 46,200 | 985,446.00 | 0.10 |
| 175 | 600765 | 中航重机 | 91,300 | 933,086.00 | 0.10 |
| 176 | 601636 | 旗滨集团 | 156,700 | 927,664.00 | 0.10 |
| 177 | 600496 | 精工钢构 | 262,500 | 879,375.00 | 0.09 |
| 178 | 600633 | 浙数文化 | 89,300 | 873,354.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 179 | 002130 | 沃尔核材 | 188,600 | 861,902.00 | 0.09 |
| 180 | 603808 | 歌力思 | 60,400 | 777,952.00 | 0.08 |
| 181 | 600750 | 江中药业 | 61,100 | 772,304.00 | 0.08 |
| 182 | 603345 | 安井食品 | 6,186 | 729,948.00 | 0.07 |
| 183 | 601019 | 山东出版 | 106,600 | 666,250.00 | 0.07 |
| 184 | 002322 | 理工环科 | 54,900 | 654,408.00 | 0.07 |
| 185 | 002568 | 百润股份 | 12,700 | 575,564.00 | 0.06 |
| 186 | 002727 | 一心堂 | 14,100 | 523,251.00 | 0.05 |
| 187 | 688009 | 中国通号 | 53,900 | 345,499.00 | 0.04 |
| 188 | 688518 | 联赢激光 | 14,111 | 293,932.13 | 0.03 |
| 189 | 688181 | 八亿时空 | 4,306 | 267,919.32 | 0.03 |
| 190 | 688568 | 中科星图 | 11,020 | 178,634.20 | 0.02 |
| 191 | 688377 | 迪威尔 | 7,894 | 129,619.48 | 0.01 |
| 192 | 688277 | 天智航 | 8,810 | 106,072.40 | 0.01 |
| 193 | 688027 | 国盾量子 | 2,830 | 102,389.40 | 0.01 |
| 194 | 688528 | 秦川物联 | 8,337 | 94,458.21 | 0.01 |
| 195 | 300824 | 北鼎股份 | 1,954 | 26,789.34 | 0.00 |
| 196 | 300842 | 帝科股份 | 455 | 18,527.60 | 0.00 |
| 197 | 600956 | 新天绿能 | 2,533 | 12,766.32 | 0.00 |
| 198 | 300839 | 博汇股份 | 502 | 11,751.82 | 0.00 |
| 199 | 300847 | 中船汉光 | 1,421 | 9,861.74 | 0.00 |
| 200 | 300845 | 捷安高科 | 470 | 8,286.10 | 0.00 |
| 201 | 300843 | 胜蓝股份 | 751 | 7,517.51 | 0.00 |
| 202 | 300840 | 酷特智能 | 1,185 | 7,038.90 | 0.00 |
| 203 | 300846 | 首都在线 | 1,131 | 3,811.47 | 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 | 300274 | 阳光电源 | 23,051,236.44 | 2.10 |
| 2 | 603678 | 火炬电子 | 21,260,755.24 | 1.94 |
| 3 | 300383 | 光环新网 | 19,244,114.73 | 1.75 |
| 4 | 002555 | 三七互娱 | 17,855,037.94 | 1.63 |
| 5 | 600027 | 华电国际 | 17,766,423.74 | 1.62 |
| 6 | 002064 | 华峰氨纶 | 17,725,704.68 | 1.61 |
| 7 | 300327 | 中颖电子 | 17,574,062.03 | 1.60 |
| 8 | 000513 | 丽珠集团 | 17,527,890.94 | 1.60 |
| 9 | 601688 | 华泰证券 | 16,375,812.23 | 1.49 |
| 10 | 002353 | 杰瑞股份 | 15,621,194.97 | 1.42 |
| 11 | 600584 | 长电科技 | 15,610,811.39 | 1.42 |
| 12 | 300012 | 华测检测 | 15,308,629.77 | 1.39 |
| 13 | 601128 | 常熟银行 | 15,227,564.31 | 1.39 |
| 14 | 600426 | 华鲁恒升 | 15,081,893.72 | 1.37 |
| 15 | 600763 | 通策医疗 | 15,032,437.40 | 1.37 |
| 16 | 600486 | 扬农化工 | 14,923,652.77 | 1.36 |
| 17 | 603816 | 顾家家居 | 14,779,730.20 | 1.35 |
| 18 | 300014 | 亿纬锂能 | 14,730,289.14 | 1.34 |
| 19 | 600745 | 闻泰科技 | 14,573,711.89 | 1.33 |
| 20 | 002439 | 启明星辰 | 14,456,167.29 | 1.32 |

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 | 002048 | 宁波华翔 | 27,562,918.65 | 2.51 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 2 | 300012 | 华测检测 | 25,693,790.03 | 2.34 |
| 3 | 603444 | 吉比特 | 25,059,608.71 | 2.28 |
| 4 | 000807 | 云铝股份 | 23,437,243.08 | 2.13 |
| 5 | 603678 | 火炬电子 | 22,672,880.42 | 2.06 |
| 6 | 002821 | 凯莱英 | 22,617,730.04 | 2.06 |
| 7 | 300274 | 阳光电源 | 22,229,413.09 | 2.02 |
| 8 | 300433 | 蓝思科技 | 21,529,752.72 | 1.96 |
| 9 | 600704 | 物产中大 | 21,510,657.97 | 1.96 |
| 10 | 600845 | 宝信软件 | 21,220,967.63 | 1.93 |
| 11 | 300253 | 卫宁健康 | 20,840,215.79 | 1.90 |
| 12 | 002463 | 沪电股份 | 20,583,673.73 | 1.87 |
| 13 | 300014 | 亿纬锂能 | 19,604,592.65 | 1.78 |
| 14 | 002916 | 深南电路 | 19,464,110.71 | 1.77 |
| 15 | 603986 | 兆易创新 | 18,976,875.45 | 1.73 |
| 16 | 600373 | 中文传媒 | 18,708,458.89 | 1.70 |
| 17 | 002920 | 德赛西威 | 18,439,171.72 | 1.68 |
| 18 | 600027 | 华电国际 | 17,272,349.94 | 1.57 |
| 19 | 603160 | 汇顶科技 | 16,835,504.66 | 1.53 |
| 20 | 002353 | 杰瑞股份 | 16,582,330.64 | 1.51 |

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 | 2,183,642,500.09 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,496,446,782.01 |

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 179,160.93 |
| 2 | 应收证券清算款 | 11,416,964.41 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 10,889.45 |
| 5 | 应收申购款 | 681,028.22 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,288,043.01 |

### 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（%） |
| 32,322 | 20,400.59 | 91,187,770.83 | 13.83 | 568,200,035.93 | 86.17 |

### 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 | 217,146.99 | 0.03 |

### 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2015 年 02 月 16 日）基金份额总额 | 1,903,140,954.30 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 912,893,299.44 |
| 本报告期基金总申购份额 | 56,610,382.21 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 310,115,874.89 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 659,387,806.76 |

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，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

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

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。

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（%） | |
| 兴业证券 | 2 | 707,344,326.19 | 15.14 | 647,113.22 | 15.06 | |
| 中信建投证券 | 1 | 650,605,489.19 | 13.93 | 605,906.65 | 14.10 | |
| 华泰证券 | 2 | 559,863,547.76 | 11.99 | 510,887.23 | 11.89 | |
| 安信证券 | 2 | 515,152,757.12 | 11.03 | 471,594.53 | 10.98 | |
| 东方证券 | 3 | 348,409,660.46 | 7.46 | 319,658.92 | 7.44 | |
| 中泰证券 | 2 | 283,216,425.28 | 6.06 | 260,652.44 | 6.07 | |
| 中金财富 | 1 | 274,308,806.26 | 5.87 | 255,475.73 | 5.95 | |
| 招商证券 | 2 | 257,791,360.78 | 5.52 | 235,549.76 | 5.48 | |
| 中银国际 | 1 | 227,029,746.88 | 4.86 | 211,434.20 | 4.92 | |
| 方正证券 | 1 | 186,936,361.64 | 4.00 | 170,355.51 | 3.97 | |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 西南证券 | 1 | 157,954,735.30 | 3.38 | 143,944.63 | 3.35 | |
| 国金证券 | 2 | 155,465,181.19 | 3.33 | 141,675.18 | 3.30 | |
| 光大证券 | 1 | 119,806,774.06 | 2.57 | 111,579.06 | 2.60 | |
| 东吴证券 | 2 | 89,090,506.35 | 1.91 | 81,815.06 | 1.90 | |
| 北京高华 | 1 | 62,463,977.32 | 1.34 | 58,171.59 | 1.35 | |
| 东兴证券 | 1 | 41,378,533.04 | 0.89 | 38,533.86 | 0.90 | |
| 中金公司 | 2 | 13,466,301.46 | 0.29 | 12,272.08 | 0.29 | |
| 长江证券 | 1 | 13,255,851.93 | 0.28 | 12,343.85 | 0.29 | |
| 银河证券 | 3 | 7,256,079.92 | 0.16 | 6,757.35 | 0.16 | |
| 财富证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 广州证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 国都证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 国泰 | 2 | - | - | - | - | |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 君安 | | | | | | |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | |
| 华融证券 | 2 | - | - | - | - | |
| 华鑫证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 申万宏源证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | |

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（%） |
| 兴业证券 | 1,069,604.52 | 10.05 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 3,029,440.50 | 28.48 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1,390,503.20 | 13.07 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 116.70 | 0.00 | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1,167,398.33 | 10.97 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 3,980,846.90 | 37.42 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财富证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 上海 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券 | | | | | | | | |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

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：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 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关于旗下部分基金参加交通银行开展的 | 上证报,公司网站 | 2020 年 01 月 02 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 费率优惠活动的公告 | | |
| 2 | 汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年第 4 季度报告 | 上交所,上证报,公司网站,深交所 | 2020 年 01 月 21 日 |
| 3 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金暂停申购、赎回 等业务的公告 | 中证报,上交所,证券时报,上证报,公司网站,深交所,证券日报 | 2020 年 01 月 31 日 |
| 4 | 汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年年度报告 | 中证报,上交所,证券时报,上证报,公司网站,深交所,证券日报 | 2020 年 03 月 30 日 |
| 5 | 汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告 | 中证报,上交所,公司网站,深交所 | 2020 年 04 月 01 日 |
| 6 | 汇添富基金管理股份有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议并更新招募说明书 | 中证报,上交所,证券时报,上证报,公司网站,深交所,证券日报 | 2020 年 04 月 14 日 |
| 7 | 汇添富基金旗下 145 只基金 2020 年 1 季度报告 | 中证报,上交所,证券时报,上证报,公司网站,深交所,证券日报 | 2020 年 04 月 21 日 |
| 8 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金中基金（FOF）资产管理计划通过直销渠道申赎本公司旗下公募基金免除相关费用的公告 | 中证报,公司网站 | 2020 年 04 月 29 日 |
| 9 | 汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告 | 上证报,公司网站 | 2020 年 05 月 16 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 10 | 汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告 | 证券时报,公司网站 | 2020 年 06 月 04 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成长多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金在指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

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼　汇添富基金管理股份有限公司

## 12.3 查阅方式

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

**汇添富基金管理股份有限公司**

**2020 年 08 月 28 日**