

# 汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                               |    |
|-----------------------------------------------|----|
| § 1 重要提示及目录 .....                             | 2  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2  |
| 1.2 目录 .....                                  | 3  |
| § 2 基金简介 .....                                | 5  |
| 2.1 基金基本情况 .....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明 .....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 6  |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 .....                       | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 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合规守信情况的说明 .....              | 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 .....                | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 15 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....       | 15 |
| § 5 托管人报告 .....                               | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 16 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... | 16 |
| 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....        | 16 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....                     | 16 |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 16 |
| 6.2 利润表 .....                                 | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 18 |
| 6.4 报表附注 .....                                | 19 |
| § 7 投资组合报告 .....                              | 53 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 53 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 53 |
| 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 .....       | 54 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 58 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 60 |
| 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 .....      | 60 |
| 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 .....   | 60 |
| 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 .....   | 61 |
| 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 .....      | 61 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....           | 61 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....           | 61 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                       | 61 |
| § 8 基金份额持有人信息 .....                      | 62 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 62 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 62 |
| 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.....    | 62 |
| § 9 开放式基金份额变动 .....                      | 62 |
| § 10 重大事件揭示 .....                        | 63 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 63 |
| 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.....    | 63 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 63 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                      | 63 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 63 |
| 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.....       | 63 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....              | 63 |
| 10.8 其他重大事件.....                         | 68 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 68 |
| 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..... | 68 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 68 |
| § 12 备查文件目录 .....                        | 68 |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 69 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 69 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 69 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|               |                       |
|---------------|-----------------------|
| 基金名称          | 汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金 |
| 基金简称          | 汇添富稳健添益一年持有混合         |
| 基金主代码         | 010219                |
| 基金运作方式        | 契约型开放式                |
| 基金合同生效日       | 2021 年 01 月 20 日      |
| 基金管理人         | 汇添富基金管理股份有限公司         |
| 基金托管人         | 中国农业银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额（份） | 4,115,928,076.25      |
| 基金合同存续期       | 不定期                   |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                          |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。                                                                                                             |
| 投资策略   | 本基金将在有效控制风险的前提下，采用科学的资产配置策略和“自下而上”的精选个券策略，定量与定性分析相结合，力争实现基金资产的长期稳定增值。<br>本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略和融资投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率（经汇率调整）×7%+中债综合指数收益率×85%                                                                                                          |
| 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。<br>本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。                               |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                              | 基金托管人              |
|-------------|------|------------------------------------|--------------------|
| 名称          |      | 汇添富基金管理股份有限公司                      | 中国农业银行股份有限公司       |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李鹏                                 | 秦一楠                |
|             | 联系电话 | 021-28932888                       | 010-66060069       |
|             | 电子邮箱 | service@99fund.com                 | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话      |      | 400-888-9918                       | 95599              |
| 传真          |      | 021-28932998                       | 010-68121816       |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室 | 北京市东城区建国门内大街 69 号  |

|       |                        |                              |
|-------|------------------------|------------------------------|
| 办公地址  | 上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码  | 200120                 | 100031                       |
| 法定代表人 | 李文                     | 谷澍                           |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                      |
|---------------------|--------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》                              |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.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(2021 年 01 月 20 日(基金合同生效日) – 2021 年 06 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -100,842,185.59                                   |
| 本期利润          | -32,710,903.70                                    |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0080                                           |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.81%                                            |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.80%                                            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 06 月 30 日)                            |
| 期末可供分配利润      | -100,924,010.51                                   |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0245                                           |
| 期末基金资产净值      | 4,083,165,714.28                                  |
| 期末基金份额净值      | 0.9920                                            |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021 年 06 月 30 日)                            |
| 基金份额累计净值增长率   | -0.80%                                            |

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。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2021 年 01 月 20 日，至本报告期末未满半年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2021 年 06 月 30 日数据，特此说明。

## 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       | 0.28%    | 0.20%       | -0.17%     | 0.11%         | 0.45%  | 0.09% |
| 过去三个月       | 2.53%    | 0.20%       | 0.69%      | 0.12%         | 1.84%  | 0.08% |
| 自基金合同生效日起至今 | -0.80%   | 0.31%       | -0.04%     | 0.18%         | -0.76% | 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

汇添富稳健添益一年持有混合累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本《基金合同》生效之日为 2021 年 01 月 20 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为自《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

## § 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、南京、深圳等地设有分公司，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。

2021 上半年，汇添富基金新成立 21 只公开募集证券投资基金，包括 7 只股票型基金、13 只混合型基金、1 只债券型基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 189 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限（年） | 说明                                               |
|----|----------|------------------|------|-----------|--------------------------------------------------|
|    |          | 任职日期             | 离任日期 |           |                                                  |
| 刘江 | 本基金的基金经理 | 2021 年 01 月 20 日 |      | 10        | 国籍:中国。学历:清华大学工学硕士，德国亚琛工大工学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经 |



|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>历:2011 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 历任医药行业分析师。2015 年 6 月 18 日至今任汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2017 年 8 月 16 日至今任汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2018 年 7 月 5 日至今任汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 8 月 8 日至 2020 年 5 月 29 日任汇添富创新医药主题混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月 6 日至今任汇添富科技创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月 10 日至今任汇添富稳健添盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 12 月 2 日至今任汇添富高质量成长精选 2 年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|    |                  |                  |  |    |                                                                                                                                                                                                                    |
|----|------------------|------------------|--|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                  |                  |  |    | 2021 年 1 月 20 日至今任汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 9 日至今任汇添富高质量成长 30 一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 9 日至今任汇添富稳进双盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。                                                                         |
| 叶盛 | 本基金的基金经理，固收研究组主管 | 2021 年 01 月 20 日 |  | 17 | 国籍:中国。学历:上海财经大学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任职于京华投资、百安居中国、远东资信、新华财经、新世纪评级、上投摩根基金、富国基金，担任一级部门总经理及投资经理。2018 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任固收研究组主管。2020 年 5 月 22 日至今任汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月 3 日至今任汇添富民丰回报混合型证券投资 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                         |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>资基金的基金经理。2020 年 10 月 30 日至今任汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月 20 日至今任汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 30 日至今任汇添富稳健欣享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《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: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嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人进一步完善了公司内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管

控覆盖公司所有业务类型、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统内的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，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溢价率进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实，本报告期内，本基金及本基金与基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易，也未出现基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

### 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 14 次，投资组合经理因投资组合的投资策略与其他组合发生同日反向交易，相关交易事前严格根据公司内部规定进行审批，事后对其交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现可能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

权益部分：

2021 年上半年回顾起来，在一季度，总体上以春节为分水岭，市场风格突变，所谓“核心资产”的走势出现翻转。投资者高度富集的“核心资产”上涨趋势被破坏之后，资金结构松动，大面积的趋势性投资者出逃，引发市场估值体系的深度调整。至二季度，A 股各主要成长性板块呈现中小市值与核心资产双头繁荣的基本格局。“核心资产”在春节后的剧烈向下调整，在二季度迎来温和回升。市场进一步在中小市值以及科创公司中积极寻找新的超额收益点。

只是市场交易结构总体上仍旧很不稳定。趋势性资金仍旧不断尝试在极少数的板块中制造拥挤交易，政策面风声鹤唳草木皆兵，短期考虑占据主导，这些都会增加市场的波动。

但我们仍然认为市场长期向牛的基本格局还是没有变化。中国公司竞争力的普遍提升，在各种行业调研和业绩报表中反复确认。注册制加速引入优质公司，而这正是市场产生良好回报的基础。

此基金为股债混基金，股票仓位整体受限，而客户也大多以追求稳健收益为主，我们的股票投资策略部分会更倾向于寻找业务稳定成长、潜在风险较低的公司。重点在生物医药、消费、半导体、高端制造业有所布局，行业分布适度分散，所投公司基本上是成长动力充沛，长期存在较大市值上涨潜力的资产。

我们在权益投资部分，坚持从中长期基本面出发，坚定选择竞争优势极为突出的高质量成长的企业，适度均衡配置资产，相信最终能够穿越各种宏观上的不确定性，最终给基金带来积极的正贡献。

债券部分：

2021 年上半年虽然经济增速受基数因素影响冲高回落，但国内经济表现整体良好。PPI 从去年末的-0.4 回升至 8.8，CPI 由 0.2 回升至 1.1。物价的上涨理论上对债券市场应该构成压制，但整个债券市场在资金面超预期宽松的背景下却表现平稳偏强，十年期国债收益率由 3.14 降至 3.08。期间虽然收益率也曾受信用事件冲击反弹至 3.28 的水平，但由于资金面始终保持宽松，同业存单利率从高点下行 40bp 左右，导致无风险利率随后保持着持续下行的趋势。

从货币政策角度来看，央行保持稳健中性的态度明确，手段充分，以国内经济为主，没有受到外部利率与汇率因素的影响，表现出了很强的定力。资金面整体中性略松、信用表现为结构性收紧。紧信用领域受影响最大的是房地产领域，这也是三道红线政策持续发酵的后续影响。城投板块虽然也持续受到信用关注，但上半年受到缺资产的影响，整体表现受影响较小，同时部分网红区域城投平台的收益率也有明显下行。产能过剩板块由于价格持续上涨，使得钢铁、煤炭、水泥等行业的盈利处于历史高点，现金流状况表现也异常强劲，这也使得市场对其认可度开始逐步提升，收益率也有所下行。

在具体操作方面，本基金坚持精选高质量债券、提高债券收益性的运作思路下，兼顾组合的流动性管理需求，实现组合收益与波动的最佳配比。

#### 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-0.80%。同期业绩比较基准收益率为-0.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票部分：

疫情与中美博弈的诸多长期影响已经逐渐清晰，底层政经框架的“大重置”已崭露峥嵘，资本市场应也会顺次调整。

总体上我们维持对中国资本市场长期向牛的基本判断。最主要的原因，还是来自于注册制带来优质成长公司大量上市，从而改善现有资本市场结构的供给侧变化。在某些新兴领域，如生物医药、新能源、部分高端制造业等领域，中国新锐公司在全球市场中的向上崛起已成定势，产业集群效应一旦起来会产生极强的成长动能。在某些必需领域，如高端产业上游供应链、半导体、SAAS 软件、军工等领域，因为政治等外在因素而强制隔离的全球供应链，客观上为中国产业链的提升提供了千载难逢的产业试用和国产替代的良机。

但在当下的这种全球政经氛围下，企业成长的外部性，也越来越成为不得不考虑的风险因素。市场经营的成功，如果伴随更高的外部风险，那么其股票表现可能也会不尽如人意。如产业政策引导方向的变化、公司 ESG 方面的负面考虑等，这些都在加大可投资公司的外部风险溢价。

市场新旧结构调整的时候，最为纠结，但我们相信新的一致性预期形成的前夜，也正是为下一轮收益做投资布局的最好时间窗口。

债券部分：

展望下半年，受德尔塔变种的影响，疫情的反复成为重要的不确定性因素，但基于国内良好成熟的管控手段，再次出现重大风险的概率相对较小。不过受地产、基建投资相对偏弱的影响，国内经济的内生动力确实存在下行的压力，财政刺激年内恐难大幅加强，但仍然会发挥部分托底的作用，后续可重点关注地方政府专项债的发行节奏变化。

从货币政策角度来看，央行 7 月份的意外降准使得市场对于资金面的预期进一步得到稳定，虽然后续部分 MLF 可能面临到期不续的可能，但目前还看不到货币政策全面转为收紧的可能性。这一方面是国外经济与货币环境下半年仍面临重大不确定性，因此需要保持政策空间的原因；另一方面也是货币政策瞄准国内经济，在紧信用环境下仍需要相对宽松货币环境的要求使然。

从信用角度来看，板块间的分化趋势仍将持续。资金“脱虚向实”的导向，使得房地产板块持续承压，但前期财务稳健的龙头房企反而可能受益；城投企业是下半年需要重点关注的信用板块，15 号文的政策效果可能会有进一步的积累与发酵，可能会能板块估值产生扰动；产能过剩行业的仍然处于信用修复阶段，修复进度有望提速。

综合来看，国内债券市场下半年面临的整体风险不大，但信用板块可能会继续分化。

#### 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;以红利再投资方式取得的基金份额的持有到期时间与投资者原持有的基金份额最短持有期到期时间一致,因多笔认购、申购导致原持有基金份额最短持有期不一致的,分别计算;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;每一基金份额享有同等分配权。

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合规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2021 年 06 月 30 日 |
|-------------|---------|-------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                         |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 131,907,738.88          |
| 结算备付金       |         | 22,441,568.92           |
| 存出保证金       |         | 963,409.75              |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 3,803,791,833.50        |
| 其中：股票投资     |         | 712,626,075.10          |
| 基金投资        |         | —                       |
| 债券投资        |         | 3,010,764,758.40        |



|               |          |                         |
|---------------|----------|-------------------------|
| 资产支持证券投资      |          | 80,401,000.00           |
| 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  | 120,000,000.00          |
| 应收证券清算款       |          | -                       |
| 应收利息          | 6.4.7.5  | 33,213,632.33           |
| 应收股利          |          | 133,392.96              |
| 应收申购款         |          | 129,979.80              |
| 递延所得税资产       |          | -                       |
| 其他资产          | 6.4.7.6  | -                       |
| 资产总计          |          | 4,112,581,556.14        |
| 负债和所有者权益      | 附注号      | 本期末<br>2021 年 06 月 30 日 |
| <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     |          | -                       |
| 应付证券清算款       |          | 25,778,552.56           |
| 应付赎回款         |          | -                       |
| 应付管理人报酬       |          | 1,999,305.84            |
| 应付托管费         |          | 499,826.45              |
| 应付销售服务费       |          | -                       |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 918,004.89              |
| 应交税费          |          | 145,238.46              |
| 应付利息          |          | -                       |
| 应付利润          |          | -                       |
| 递延所得税负债       |          | -                       |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 74,913.66               |
| 负债合计          |          | 29,415,841.86           |
| <b>所有者权益:</b> |          |                         |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 4,115,928,076.25        |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -32,762,361.97          |
| 所有者权益合计       |          | 4,083,165,714.28        |
| 负债和所有者权益总计    |          | 4,112,581,556.14        |

注：1、报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9920 元，基金份额总额 4,115,928,076.25 份。

2、本基金合同于 2021 年 01 月 20 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2021 年 06 月 30 日数据，特此说明。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 20 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号        | 本期<br>2021 年 01 月 20 日（基金合<br>同生效日）至 2021 年 06 月<br>30 日 |
|----------------------------|------------|----------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |            | <b>-14,992,445.83</b>                                    |
| 1. 利息收入                    |            | 44,735,799.51                                            |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11   | 1,301,057.02                                             |
| 债券利息收入                     |            | 31,428,262.67                                            |
| 资产支持证券利息收入                 |            | 1,072,695.96                                             |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 10,933,783.86                                            |
| 证券出借收入                     |            | -                                                        |
| 其他利息收入                     |            | -                                                        |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | -127,859,527.23                                          |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12   | -132,302,570.51                                          |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.13   | -                                                        |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.14   | 2,618,117.81                                             |
| 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   | -                                                        |
| 股利收益                       | 6.4.7.17   | 1,824,925.47                                             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 68,131,281.89                                            |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -                                                        |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.19   | -                                                        |
| <b>减：二、费用</b>              |            | <b>17,718,457.87</b>                                     |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 10,698,896.97                                            |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 2,674,724.23                                             |
| 3. 销售服务费                   |            | -                                                        |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.20   | 4,132,144.51                                             |
| 5. 利息支出                    |            | 43,175.86                                                |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 43,175.86                                                |
| 6. 税金及附加                   |            | 67,210.59                                                |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.21   | 102,305.71                                               |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>-32,710,903.70</b>                                    |
| 减：所得税费用                    |            | -                                                        |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>-32,710,903.70</b>                                    |

注：本基金合同于 2021 年 01 月 20 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 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）                        | 4,112,764,550.00                                  | -              | 4,112,764,550.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                 | -32,710,903.70 | -32,710,903.70   |
| 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）      | 3,163,526.25                                      | -51,458.27     | 3,112,067.98     |
| 其中：1. 基金申购款                            | 3,163,526.25                                      | -51,458.27     | 3,112,067.98     |
| 2. 基金赎回款                               | -                                                 | -              | -                |
| 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）                        | 4,115,928,076.25                                  | -32,762,361.97 | 4,083,165,714.28 |

注：本基金合同于 2021 年 01 月 20 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

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：

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

汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]2092 号文《关于准予汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司于 2021 年 1 月 11 日至 2021 年 1 月 15 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华

明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2021）验字第 60466941\_B13 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 1 月 20 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 4,111,933,431.33 元，在募集期内产生的利息为人民币 831,118.67 元，以上实收基金（本息）共计人民币 4,112,764,550.00 元，折合 4,112,764,550.00 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、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、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金还可根据法律法规参与融资。本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 8%+恒生指数收益率（经汇率调整） $\times$ 7%+中债综合指数收益率 $\times$ 85%。

#### 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 2021 年 06 月 30

日的财务状况以及 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止, 或该收取金融资产现金流量的权利已转移, 且符合金融资产转移的终止确认条件的, 金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的, 该金融负债或其一部分将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的, 终止确认该金融资产; 保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的, 不终止确认该金融资产; 本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的, 分别下列情况处理: 放弃了对该金融资产控制的, 终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债; 未放弃对该金融资产控制的, 按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产, 并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资, 股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益, 卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账, 其中所包含的债券应收利息单独核算, 不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券, 根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后, 按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益, 卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益, 卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

#### (4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认;

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益, 股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转;

#### (5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不可

应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；



(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(9) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(13) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异

较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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；以红利再投资方式取得的基金份额的持有到期时间与投资者原持有的基金份额最短持有期到期时间一致，因多笔认购、申购导致原持有基金份额最短持有期不一致的，分别计算；

(2) 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基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6.6 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<br>2021 年 06 月 30 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 131,907,738.88          |
| 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             | 131,907,738.88          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2021 年 06 月 30 日 |                  |               |
|---------------|-------|-------------------------|------------------|---------------|
|               |       | 成本                      | 公允价值             | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 650,584,835.93          | 712,626,075.10   | 62,041,239.17 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | —                       | —                | —             |
| 债券            | 交易所市场 | 1,201,117,375.94        | 1,203,261,758.40 | 2,144,382.46  |
|               | 银行间市场 | 1,803,958,339.74        | 1,807,503,000.00 | 3,544,660.26  |
|               | 其他    | —                       | —                | —             |
|               | 合计    | 3,005,075,715.68        | 3,010,764,758.40 | 5,689,042.72  |
| 资产支持证券        |       | 80,000,000.00           | 80,401,000.00    | 401,000.00    |
| 基金            |       | —                       | —                | —             |
| 其他            |       | —                       | —                | —             |
| 合计            |       | 3,735,660,551.61        | 3,803,791,833.50 | 68,131,281.89 |

### 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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 06 月 30 日 |
|----|-------------------------|
|----|-------------------------|

|       | 账面余额           | 其中：买断式逆回购 |
|-------|----------------|-----------|
| 交易所市场 | 120,000,000.00 | -         |
| 银行间市场 | -              | -         |
| 合计    | 120,000,000.00 | -         |

#### 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<br>2021 年 06 月 30 日 |
|------------|-------------------------|
| 应收活期存款利息   | 20,671.06               |
| 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  | 12,334.37               |
| 应收债券利息     | 32,075,296.51           |
| 应收资产支持证券利息 | 1,104,876.71            |
| 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         | 453.68                  |
| 合计         | 33,213,632.33           |

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>2021 年 06 月 30 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 913,379.89              |
| 银行间市场应付交易费用 | 4,625.00                |
| 合计          | 918,004.89              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 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   | -                       |

|              |           |
|--------------|-----------|
| 应付审计费        | 42,139.44 |
| 应付信息披露费      | 32,774.22 |
| 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           | 74,913.66 |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |                  |
|---------------|------------------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                                        | 账面金额             |
| 基金合同生效日       | 4,112,764,550.00                               | 4,112,764,550.00 |
| 本期申购          | 3,163,526.25                                   | 3,163,526.25     |
| 本期赎回（以“-”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           | 4,115,928,076.25                               | 4,115,928,076.25 |

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

2、本基金合同于 2021 年 01 月 20 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 4,111,933,431.33 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 831,118.67 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 4,112,764,550.00 元，折合 4,112,764,550.00 份基金份额。

#### 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        |
|-----------|-----------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日   | -               | -             | -              |
| 本期利润      | -100,842,185.59 | 68,131,281.89 | -32,710,903.70 |
| 本期基金份额交易产 | -81,824.92      | 30,366.65     | -51,458.27     |

|          |                 |               |                |
|----------|-----------------|---------------|----------------|
| 生的变动数    |                 |               |                |
| 其中：基金申购款 | -81,824.92      | 30,366.65     | -51,458.27     |
| 基金赎回款    | -               | -             | -              |
| 本期已分配利润  | -               | -             | -              |
| 本期末      | -100,924,010.51 | 68,161,648.54 | -32,762,361.97 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 703,532.26                                        |
| 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 | 591,678.40                                        |
| 其他        | 5,846.36                                          |
| 合计        | 1,301,057.02                                      |

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>2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 926,263,533.76                                    |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,058,566,104.27                                  |
| 买卖股票差价收入   | -132,302,570.51                                   |

#### 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>2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 758,437,649.56                                    |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 746,589,148.76                                    |
| 减：应收利息总额               | 9,230,382.99                                      |
| 买卖债券差价收入               | 2,618,117.81                                      |



#### 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>2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,824,925.47                                      |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | —                                                 |
| 基金投资产生的股利收益   | —                                                 |
| 合计            | 1,824,925.47                                      |

#### 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>2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 68,131,281.89                                     |
| ——股票投资                 | 62,041,239.17                                     |
| ——债券投资                 | 5,689,042.72                                      |
| ——资产支持证券投资             | 401,000.00                                        |
| ——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                     | 68,131,281.89                                     |

#### 6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                                          |
|-----------|---------------------------------------------|
|           | 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |
| 交易所市场交易费用 | 4,116,494.51                                |
| 银行间市场交易费用 | 15,650.00                                   |
| 合计        | 4,132,144.51                                |

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                                          |
|-----------|---------------------------------------------|
|           | 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |
| 审计费用      | 42,139.44                                   |
| 信息披露费     | 32,774.22                                   |
| 证券出借违约金   | -                                           |
| 账户维护费     | 3,100.00                                    |
| 银行费用      | 24,292.05                                   |
| 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        | 102,305.71                                  |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

##### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称         | 与本基金的关系                 |
|---------------|-------------------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构 |

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| 中国农业银行股份有限公司（“农业银行”） | 基金托管人, 基金代销机构    |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”）   | 基金管理人的股东, 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 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |                 |
|-------|------------------------------------------------|-----------------|
|       | 成交金额                                           | 占当期股票成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 773,782,935.43                                 | 29.42           |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |                 |
|-------|------------------------------------------------|-----------------|
|       | 成交金额                                           | 占当期债券成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 1,022,599,718.74                               | 89.47           |

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |                 |
|-------|------------------------------------------------|-----------------|
|       | 成交金额                                           | 占当期回购成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 27,905,800,000.00                              | 38.24           |

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期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 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |        |          |        |
|-------|------------------------------------------------|--------|----------|--------|
|       | 当期佣金                                           | 占当期佣金总 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 |

|      |            | 量的比例 (%) |           | 金总额的比例 (%) |
|------|------------|----------|-----------|------------|
| 东方证券 | 687,467.82 | 28.85    | 11,236.82 | 1.23       |

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>2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年<br>06 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 10,698,896.97                                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,267,276.09                                         |

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年<br>06 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,674,724.23                                         |

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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末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 2021 年 01 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日 |            |
|-------|------------------------------------------------|------------|
|       | 期末余额                                           | 当期利息收入     |
| 农业银行  | 131,907,738.88                                 | 703,532.26 |

#### 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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末进行利润分配。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（2021 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       | 可流通日        | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 301018               | 申菱环境 | 2021年06月28日 | 2022年01月07日 | 新股流通受限 | 8.29  | 8.29   | 782          | 6,482.78  | 6,482.78  |    |
| 301018               | 申菱环境 | 2021年06月28日 | 2021年07月07日 | 新股流通受限 | 8.29  | 8.29   | 7,029        | 58,270.41 | 58,270.41 |    |
| 300991               | 创益通  | 2021年05月12日 | 2021年11月22日 | 新股流通受限 | 13.06 | 26.51  | 254          | 3,317.24  | 6,733.54  |    |
| 301015               | 百洋医药 | 2021年06月22日 | 2021年12月30日 | 新股流通受限 | 7.64  | 38.83  | 462          | 3,529.68  | 17,939.46 |    |
| 300955               | 嘉亨家化 | 2021年03月16日 | 2021年09月24日 | 新股流通受限 | 16.53 | 46.07  | 232          | 3,834.96  | 10,688.24 |    |
| 605287               | 德才股  | 2021年06月28日 | 2021年07月06日 | 新股流    | 31.56 | 31.56  | 349          | 11,014.44 | 11,014.44 |    |

|        | 份                | 日                         | 日                         | 通<br>受<br>限                |       |       |       |           |           |  |
|--------|------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|
| 300996 | 普<br>联<br>软<br>件 | 2021<br>年 05<br>月 26<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 03<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 20.81 | 42.23 | 241   | 5,015.21  | 10,177.43 |  |
| 300958 | 建<br>工<br>修<br>复 | 2021<br>年 03<br>月 18<br>日 | 2021<br>年 09<br>月 29<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 8.53  | 27.22 | 300   | 2,559.00  | 8,166.00  |  |
| 301017 | 漱<br>玉<br>平<br>民 | 2021<br>年 06<br>月 23<br>日 | 2022<br>年 01<br>月 05<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 8.86  | 8.86  | 555   | 4,917.30  | 4,917.30  |  |
| 301017 | 漱<br>玉<br>平<br>民 | 2021<br>年 06<br>月 23<br>日 | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 8.86  | 8.86  | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70 |  |
| 300992 | 泰<br>福<br>泵<br>业 | 2021<br>年 05<br>月 17<br>日 | 2021<br>年 11<br>月 25<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 9.36  | 20.32 | 200   | 1,872.00  | 4,064.00  |  |
| 300982 | 苏<br>文<br>电<br>能 | 2021<br>年 04<br>月 19<br>日 | 2021<br>年 10<br>月 27<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 15.83 | 45.29 | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 |  |
| 301016 | 雷<br>尔<br>伟      | 2021<br>年 06<br>月 23<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 30<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受      | 13.75 | 32.98 | 275   | 3,781.25  | 9,069.50  |  |

|        |      |             |             |        |       |       |       |           |           |  |
|--------|------|-------------|-------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|
|        |      |             |             | 限      |       |       |       |           |           |  |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021年06月09日 | 2021年12月20日 | 新股流通受限 | 7.83  | 17.61 | 218   | 1,706.94  | 3,838.98  |  |
| 688359 | 三孚新科 | 2021年05月14日 | 2021年11月22日 | 新股流通受限 | 11.03 | 26.35 | 2,213 | 24,409.39 | 58,312.55 |  |
| 300614 | 百川畅银 | 2021年05月18日 | 2021年11月25日 | 新股流通受限 | 9.19  | 40.38 | 329   | 3,023.51  | 13,285.02 |  |
| 301013 | 利和兴  | 2021年06月21日 | 2021年12月29日 | 新股流通受限 | 8.72  | 27.11 | 471   | 4,107.12  | 12,768.81 |  |
| 688067 | 爱威科技 | 2021年06月07日 | 2021年12月16日 | 新股流通受限 | 14.71 | 24.83 | 1,259 | 18,519.89 | 31,260.97 |  |
| 688319 | 欧林生物 | 2021年05月31日 | 2021年12月08日 | 新股流通受限 | 9.88  | 27.34 | 3,412 | 33,710.56 | 93,284.08 |  |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年05月17日 | 2021年11月26日 | 新股流通受限 | 14.72 | 23.32 | 191   | 2,811.52  | 4,454.12  |  |
| 688499 | 利    | 2021        | 2021        | 新      | 38.85 | 38.85 | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65 |  |



|        |      |             |             |        |       |        |       |           |           |  |
|--------|------|-------------|-------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|--|
|        | 元亨   | 年06月23日     | 年07月01日     | 股流通受限  |       |        |       |           |           |  |
| 300973 | 立高食品 | 2021年04月08日 | 2021年10月15日 | 新股流通受限 | 28.28 | 115.71 | 249   | 7,041.72  | 28,811.79 |  |
| 688113 | 联测科技 | 2021年04月26日 | 2021年11月08日 | 新股流通受限 | 19.14 | 49.29  | 1,415 | 27,083.10 | 69,745.35 |  |
| 301007 | 德迈仕  | 2021年06月04日 | 2021年12月16日 | 新股流通受限 | 5.29  | 14.44  | 303   | 1,602.87  | 4,375.32  |  |
| 301012 | 扬电科技 | 2021年06月15日 | 2021年12月22日 | 新股流通受限 | 8.05  | 24.26  | 170   | 1,368.50  | 4,124.20  |  |
| 688087 | 英科再生 | 2021年06月30日 | 2021年07月09日 | 新股流通受限 | 21.96 | 21.96  | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 |  |
| 605162 | 新中港  | 2021年06月29日 | 2021年07月07日 | 新股流通受限 | 6.07  | 6.07   | 1,377 | 8,358.39  | 8,358.39  |  |
| 688260 | 昀冢科  | 2021年03月25日 | 2021年10月08日 | 新股流    | 9.63  | 16.41  | 2,990 | 28,793.70 | 49,065.90 |  |

|        | 技                | 日                         | 日                         | 通<br>受<br>限                |       |       |     |          |           |  |
|--------|------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-------|-------|-----|----------|-----------|--|
| 301011 | 华<br>立<br>科<br>技 | 2021<br>年 06<br>月 09<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 17<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00  |  |
| 300967 | 晓<br>鸣<br>股<br>份 | 2021<br>年 04<br>月 02<br>日 | 2021<br>年 10<br>月 13<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 4.54  | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78  |  |
| 300972 | 万<br>辰<br>生<br>物 | 2021<br>年 04<br>月 08<br>日 | 2021<br>年 10<br>月 19<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 7.19  | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50  |  |
| 300981 | 中<br>红<br>医<br>疗 | 2021<br>年 04<br>月 19<br>日 | 2021<br>年 10<br>月 27<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 48.59 | 90.39 | 185 | 8,989.15 | 16,722.15 |  |
| 300966 | 共<br>同<br>药<br>业 | 2021<br>年 03<br>月 31<br>日 | 2021<br>年 10<br>月 11<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 8.24  | 31.54 | 286 | 2,356.64 | 9,020.44  |  |
| 300993 | 玉<br>马<br>遮<br>阳 | 2021<br>年 05<br>月 17<br>日 | 2021<br>年 11<br>月 24<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 12.10 | 19.29 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90  |  |
| 300952 | 恒<br>辉<br>安<br>防 | 2021<br>年 03<br>月 03<br>日 | 2021<br>年 09<br>月 13<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受      | 11.72 | 27.08 | 340 | 3,984.80 | 9,207.20  |  |

|        |      |             |             |        |       |       |       |           |           |  |
|--------|------|-------------|-------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|
|        |      |             |             | 限      |       |       |       |           |           |  |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年06月28日 | 2022年01月06日 | 新股流通受限 | 9.46  | 9.46  | 290   | 2,743.40  | 2,743.40  |  |
| 300997 | 欢乐家  | 2021年05月26日 | 2021年12月02日 | 新股流通受限 | 4.94  | 13.05 | 928   | 4,584.32  | 12,110.40 |  |
| 300971 | 博亚精工 | 2021年04月07日 | 2021年10月15日 | 新股流通受限 | 18.24 | 28.29 | 245   | 4,468.80  | 6,931.05  |  |
| 300968 | 格林精密 | 2021年04月06日 | 2021年10月15日 | 新股流通受限 | 6.87  | 12.07 | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 |  |
| 688226 | 威腾电气 | 2021年06月28日 | 2021年07月07日 | 新股流通受限 | 6.42  | 6.42  | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 |  |
| 300986 | 志特新材 | 2021年04月21日 | 2021年11月01日 | 新股流通受限 | 14.79 | 30.57 | 264   | 3,904.56  | 8,070.48  |  |
| 300962 | 中金辐照 | 2021年03月29日 | 2021年10月11日 | 新股流通受限 | 3.40  | 16.37 | 576   | 1,958.40  | 9,429.12  |  |
| 301021 | 英    | 2021        | 2021        | 新      | 9.46  | 9.46  | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 |  |

|                      | 诺<br>激<br>光      | 年 06<br>月 28<br>日         | 年 07<br>月 06<br>日         | 股<br>流<br>通<br>受<br>限      |                  |                            |                              |                            |                            |        |
|----------------------|------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|------------------|----------------------------|------------------------------|----------------------------|----------------------------|--------|
| 300957               | 贝<br>泰<br>妮      | 2021<br>年 03<br>月 18<br>日 | 2021<br>年 09<br>月 27<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 47.33            | 251.96                     | 853                          | 40,372.49                  | 214,921.88                 |        |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |                  |                           |                           |                            |                  |                            |                              |                            |                            |        |
| 证券代<br>码             | 证<br>券<br>名<br>称 | 成<br>功<br>认<br>购<br>日     | 可<br>流<br>通<br>日          | 流<br>通<br>受<br>限<br>类<br>型 | 认<br>购<br>价<br>格 | 期<br>末<br>估<br>值<br>单<br>价 | 数<br>量<br>（<br>单<br>位：<br>张） | 期<br>末<br>成<br>本<br>总<br>额 | 期<br>末<br>估<br>值<br>总<br>额 | 备<br>注 |
|                      |                  |                           |                           |                            | -                | -                          | -                            | -                          | -                          |        |

#### 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 2021 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 2021 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 2021 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运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除在附注 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本<br>期<br>末<br>20<br>21<br>年<br>06<br>月<br>30<br>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<br>产                                             |                |                |                  |                  |       |                |                  |
| 银<br>行<br>存<br>款                                   | 131,907,738.88 | -              | -                | -                | -     | -              | 131,907,738.88   |
| 结<br>算<br>备<br>付<br>金                              | 22,441,568.92  | -              | -                | -                | -     | -              | 22,441,568.92    |
| 存<br>出<br>保<br>证<br>金                              | 963,409.75     | -              | -                | -                | -     | -              | 963,409.75       |
| 交<br>易<br>性                                        | 70,082,000.00  | 170,442,000.00 | 1,778,788,758.40 | 1,071,853,000.00 | -     | 712,626,075.10 | 3,803,791,833.50 |

|          |                |                |                  |                  |   |                |                  |
|----------|----------------|----------------|------------------|------------------|---|----------------|------------------|
| 金融资产     |                |                |                  |                  |   |                |                  |
| 应收股利     | -              | -              | -                | -                | - | 133,392.96     | 133,392.96       |
| 应收利息     | -              | -              | -                | -                | - | 33,213,632.33  | 33,213,632.33    |
| 应收申购款    | -              | -              | -                | -                | - | 129,979.80     | 129,979.80       |
| 衍生金融资产   | -              | -              | -                | -                | - | -              | -                |
| 应收证券清算款  | -              | -              | -                | -                | - | -              | -                |
| 买入返售金融资产 | 120,000,000.00 | -              | -                | -                | - | -              | 120,000,000.00   |
| 其他资产     | -              | -              | -                | -                | - | -              | -                |
| 资产       | 345,394,717.55 | 170,442,000.00 | 1,778,788,758.40 | 1,071,853,000.00 | - | 746,103,080.19 | 4,112,581,556.14 |

|           |   |   |   |   |   |               |               |
|-----------|---|---|---|---|---|---------------|---------------|
| 总计        |   |   |   |   |   |               |               |
| 负债        |   |   |   |   |   |               |               |
| 应付赎回款     | - | - | - | - | - | -             | -             |
| 应付管理人报酬   | - | - | - | - | - | 1,999,305.84  | 1,999,305.84  |
| 应付托管费     | - | - | - | - | - | 499,826.45    | 499,826.45    |
| 应付证券清算款   | - | - | - | - | - | 25,778,552.56 | 25,778,552.56 |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | -             | -             |
| 应付销售服务费   | - | - | - | - | - | -             | -             |



|         |                |                |                  |                  |   |                |                  |
|---------|----------------|----------------|------------------|------------------|---|----------------|------------------|
| 应付交易费用  | -              | -              | -                | -                | - | 918,004.89     | 918,004.89       |
| 应交税费    | -              | -              | -                | -                | - | 145,238.46     | 145,238.46       |
| 应付利息    | -              | -              | -                | -                | - | -              | -                |
| 应付利润    | -              | -              | -                | -                | - | -              | -                |
| 其他负债    | -              | -              | -                | -                | - | 74,913.66      | 74,913.66        |
| 负债总计    | -              | -              | -                | -                | - | 29,415,841.86  | 29,415,841.86    |
| 利率敏感度缺口 | 345,394,717.55 | 170,442,000.00 | 1,778,788,758.40 | 1,071,853,000.00 | - | 716,687,238.33 | 4,083,165,714.28 |

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

|    |                                                       |
|----|-------------------------------------------------------|
| 假设 | 1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；                       |
|    | 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； |

|    |                                                                                                                                          |                             |
|----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
|    | 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；                                                                                                   |                             |
|    | 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； |                             |
|    | 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。                                                                                                        |                             |
|    |                                                                                                                                          |                             |
| 分析 | 相关风险变量的变动                                                                                                                                | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                                                                                                                                          | 本期末 2021 年 06 月 30 日        |
|    | 基准利率减少 25 个基点                                                                                                                            | 8,122,195.09                |
|    | 基准利率增加 25 个基点                                                                                                                            | -8,072,333.67               |

#### 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 2021 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  | -                    | 262,175,893.51 | -         | 262,175,893.51 |
| 衍生金融资产   | -                    | -              | -         | -              |
| 买入返售金融资产 | -                    | -              | -         | -              |
| 应收证券清算款  | -                    | -              | -         | -              |

|               |   |                |   |                |
|---------------|---|----------------|---|----------------|
| 应收利息          | - | -              | - | -              |
| 应收股利          | - | 133,392.96     | - | 133,392.96     |
| 应收申购款         | - | -              | - | -              |
| 其他资产          | - | -              | - | -              |
| 资产总计          | - | 262,309,286.47 | - | 262,309,286.47 |
| 以外币计价的负债      |   |                |   |                |
| 短期借款          | - | -              | - | -              |
| 交易性金融负债       | - | -              | - | -              |
| 卖出回购金融资产款     | - | -              | - | -              |
| 应付证券清算款       | - | -              | - | -              |
| 应付赎回款         | - | -              | - | -              |
| 应付管理人报酬       | - | -              | - | -              |
| 应付托管费         | - | -              | - | -              |
| 应付销售服务费       | - | -              | - | -              |
| 应付交易费用        | - | -              | - | -              |
| 应交税费          | - | -              | - | -              |
| 应付利息          | - | -              | - | -              |
| 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 | - | 262,309,286.47 | - | 262,309,286.47 |

#### 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 2021 年 06 月 30 日 |
|  |              |                      |
|  | 港币相对人民币升值 5% | 13,115,464.32        |
|  | 港币相对人民币贬值 5% | -13,115,464.32       |

#### 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。本基金所面临的最大的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 2021 年 06 月 30 日 |              |
|---------------|----------------------|--------------|
|               | 公允价值                 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 712,626,075.10       | 17.45        |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                    | —            |
| 交易性金融资产—债券投资  | 3,010,764,758.40     | 73.74        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                    | —            |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                    | —            |
| 其他            | 80,401,000.00        | 1.97         |
| 合计            | 3,803,791,833.50     | 93.16        |

注：股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-30%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。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，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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。

##### 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；<br>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<br>风险变量保持不变。 |                             |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
|    | 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） |
| 分析 |                                                                                                                                       |                             |

|  | 本期末 2021 年 06 月 30 日 |                |
|--|----------------------|----------------|
|  | 沪深 300 指数下跌 5%       | -41,286,204.52 |
|  | 沪深 300 指数上涨 5%       | 41,286,204.52  |

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              | 712,626,075.10   | 17.33        |
|    | 其中：股票             | 712,626,075.10   | 17.33        |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 3,091,165,758.40 | 75.16        |
|    | 其中：债券             | 3,010,764,758.40 | 73.21        |
|    | 资产支持证券            | 80,401,000.00    | 1.96         |
| 4  | 贵金属投资             | —                | —            |
| 5  | 金融衍生品投资           | —                | —            |
| 6  | 买入返售金融资产          | 120,000,000.00   | 2.92         |
|    | 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      | 154,349,307.80   | 3.75         |
| 8  | 其他资产              | 34,440,414.84    | 0.84         |
| 9  | 合计                | 4,112,581,556.14 | 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 262,175,893.51 元，占期末净值比例为 6.42%。

### 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 | 11,290.28      | 0.00         |
| B  | 采矿业      | —              | —            |
| C  | 制造业      | 245,962,218.88 | 6.02         |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39      | 0.00  |
| E | 建筑业              | 25,371.37      | 0.00  |
| F | 批发和零售业           | 300,288.78     | 0.01  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 805,630.00     | 0.02  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 31,363,775.93  | 0.77  |
| J | 金融业              | 101,525,687.90 | 2.49  |
| 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       | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 21,451.02      | 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          | 69,989,687.04  | 1.71  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 431,760.00     | 0.01  |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 450,450,181.59 | 11.03 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|----------------|--------------|
| 10 能源   | -              | -            |
| 15 原材料  | -              | -            |
| 20 工业   | -              | -            |
| 25 可选消费 | 50,617,381.79  | 1.24         |
| 30 日常消费 | 21,009,603.96  | 0.51         |
| 35 医疗保健 | 120,104,715.41 | 2.94         |
| 40 金融   | 9,896,726.24   | 0.24         |
| 45 信息技术 | -              | -            |
| 50 电信服务 | 60,547,466.11  | 1.48         |
| 55 公用事业 | -              | -            |
| 60 房地产  | -              | -            |
| 合计      | 262,175,893.51 | 6.42         |

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  | 600036 | 招商银行  | 1,872,800 | 101,487,032.00 | 2.49 |
| 2  | 300015 | 爱尔眼科  | 986,048   | 69,989,687.04  | 1.71 |
| 3  | 02269  | 药明生物  | 533,500   | 63,169,058.96  | 1.55 |
| 4  | 600196 | 复星医药  | 853,800   | 61,584,594.00  | 1.51 |
| 5  | 00700  | 腾讯控股  | 124,600   | 60,547,466.11  | 1.48 |
| 6  | 02331  | 李宁    | 632,000   | 49,852,908.29  | 1.22 |
| 7  | 688139 | 海尔生物  | 445,281   | 46,799,033.10  | 1.15 |
| 8  | 03347  | 泰格医药  | 230,700   | 34,936,875.79  | 0.86 |
| 9  | 688083 | 中望软件  | 56,747    | 31,341,368.10  | 0.77 |
| 10 | 300171 | 东富龙   | 655,800   | 26,658,270.00  | 0.65 |
| 11 | 300122 | 智飞生物  | 112,736   | 21,051,193.28  | 0.52 |
| 12 | 00291  | 华润啤酒  | 362,000   | 21,009,603.96  | 0.51 |
| 13 | 600031 | 三一重工  | 698,000   | 20,290,860.00  | 0.50 |
| 14 | 300973 | 立高食品  | 128,185   | 19,858,891.79  | 0.49 |
| 15 | 01066  | 威高股份  | 1,176,000 | 17,730,892.57  | 0.43 |
| 16 | 600519 | 贵州茅台  | 7,100     | 14,602,570.00  | 0.36 |
| 17 | 002568 | 百润股份  | 140,840   | 13,350,223.60  | 0.33 |
| 18 | 00388  | 香港交易所 | 25,700    | 9,896,726.24   | 0.24 |
| 19 | 300003 | 乐普医疗  | 277,700   | 8,919,724.00   | 0.22 |
| 20 | 603392 | 万泰生物  | 22,440    | 5,815,999.20   | 0.14 |
| 21 | 03759  | 康龙化成  | 18,700    | 3,220,898.47   | 0.08 |
| 22 | 300957 | 贝泰妮   | 8,523     | 2,298,784.18   | 0.06 |
| 23 | 600882 | 妙可蓝   | 29,301    | 2,045,209.80   | 0.05 |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
|    |        | 多    |         |              |      |
| 24 | 00460  | 四环医药 | 379,000 | 1,046,989.62 | 0.03 |
| 25 | 002352 | 顺丰控股 | 11,900  | 805,630.00   | 0.02 |
| 26 | 02333  | 长城汽车 | 28,500  | 595,228.43   | 0.01 |
| 27 | 300144 | 宋城演艺 | 25,700  | 431,760.00   | 0.01 |
| 28 | 688690 | 纳微科技 | 3,477   | 408,547.50   | 0.01 |
| 29 | 688276 | 百克生物 | 3,486   | 364,565.88   | 0.01 |
| 30 | 688161 | 威高骨科 | 3,069   | 325,467.45   | 0.01 |
| 31 | 301015 | 百洋医药 | 4,614   | 251,115.78   | 0.01 |
| 32 | 688601 | 力芯微  | 1,174   | 216,133.40   | 0.01 |
| 33 | 00669  | 创科实业 | 1,500   | 169,245.07   | 0.00 |
| 34 | 301013 | 利和兴  | 4,704   | 168,966.51   | 0.00 |
| 35 | 605499 | 东鹏饮料 | 632     | 158,505.60   | 0.00 |
| 36 | 301016 | 雷尔伟  | 2,747   | 115,711.58   | 0.00 |
| 37 | 300993 | 玉马遮阳 | 4,097   | 99,899.55    | 0.00 |
| 38 | 688319 | 欧林生物 | 3,412   | 93,284.08    | 0.00 |
| 39 | 688499 | 利元亨  | 2,149   | 83,488.65    | 0.00 |
| 40 | 688113 | 联测科技 | 1,415   | 69,745.35    | 0.00 |
| 41 | 301018 | 申菱环境 | 7,811   | 64,753.19    | 0.00 |
| 42 | 688359 | 三孚新科 | 2,213   | 58,312.55    | 0.00 |
| 43 | 301012 | 扬电科技 | 1,691   | 56,994.16    | 0.00 |
| 44 | 688087 | 英科再生 | 2,469   | 54,219.24    | 0.00 |
| 45 | 301010 | 晶雪节能 | 2,172   | 50,480.96    | 0.00 |
| 46 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550   | 49,173.00    | 0.00 |



|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 47 | 688260 | 昀冢科技 | 2,990 | 49,065.90 | 0.00 |
| 48 | 688367 | 工大高科 | 1,717 | 37,035.69 | 0.00 |
| 49 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 50 | 688067 | 爱威科技 | 1,259 | 31,260.97 | 0.00 |
| 51 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 52 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 53 | 300981 | 中红医疗 | 185   | 16,722.15 | 0.00 |
| 54 | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 55 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 56 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 57 | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 58 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 59 | 300997 | 欢乐家  | 928   | 12,110.40 | 0.00 |
| 60 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 61 | 300955 | 嘉亨家化 | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 62 | 300996 | 普联软件 | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 63 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 64 | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 65 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 66 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 67 | 300958 | 建工修复 | 300   | 8,166.00  | 0.00 |
| 68 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 69 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 70 | 300991 | 创益通  | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 71 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 72 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 73 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 74 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 75 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 76 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 77 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 78 | 300059 | 东方财富 | 120 | 3,934.80 | 0.00 |
| 79 | 002353 | 杰瑞股份 | 9   | 402.30   | 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末基金资产净值 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       | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|----------------|----------------|
| 1  | 00700  | 腾讯控股  | 136,448,990.25 | 3.34           |
| 2  | 600036 | 招商银行  | 100,306,791.00 | 2.46           |
| 3  | 600519 | 贵州茅台  | 96,706,626.90  | 2.37           |
| 4  | 600309 | 万华化学  | 94,815,298.64  | 2.32           |
| 5  | 02269  | 药明生物  | 84,354,894.94  | 2.07           |
| 6  | 603259 | 药明康德  | 83,856,645.86  | 2.05           |
| 7  | 002353 | 杰瑞股份  | 83,093,996.44  | 2.04           |
| 8  | 600031 | 三一重工  | 82,431,178.67  | 2.02           |
| 9  | 600196 | 复星医药  | 80,453,097.52  | 1.97           |
| 10 | 300015 | 爱尔眼科  | 60,656,554.54  | 1.49           |
| 11 | 600809 | 山西汾酒  | 59,991,742.00  | 1.47           |
| 12 | 300122 | 智飞生物  | 57,048,328.83  | 1.40           |
| 13 | 00388  | 香港交易所 | 48,152,751.66  | 1.18           |
| 14 | 603882 | 金域医学  | 46,259,477.18  | 1.13           |
| 15 | 300274 | 阳光电源  | 45,671,912.96  | 1.12           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 16 | 300003 | 乐普医疗 | 40,149,216.47 | 0.98 |
| 17 | 00291  | 华润啤酒 | 38,843,545.05 | 0.95 |
| 18 | 688139 | 海尔生物 | 38,546,266.91 | 0.94 |
| 19 | 002352 | 顺丰控股 | 38,414,944.27 | 0.94 |
| 20 | 02331  | 李宁   | 34,924,896.32 | 0.86 |

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末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台  | 80,661,749.10 | 1.98           |
| 2  | 600309 | 万华化学  | 78,740,712.86 | 1.93           |
| 3  | 603259 | 药明康德  | 70,824,995.43 | 1.73           |
| 4  | 00700  | 腾讯控股  | 65,716,887.04 | 1.61           |
| 5  | 002353 | 杰瑞股份  | 62,910,219.19 | 1.54           |
| 6  | 600031 | 三一重工  | 50,278,754.00 | 1.23           |
| 7  | 600809 | 山西汾酒  | 49,672,770.15 | 1.22           |
| 8  | 300122 | 智飞生物  | 40,733,648.79 | 1.00           |
| 9  | 600196 | 复星医药  | 40,515,983.00 | 0.99           |
| 10 | 00388  | 香港交易所 | 37,422,864.20 | 0.92           |
| 11 | 603882 | 金域医学  | 34,552,746.58 | 0.85           |
| 12 | 300003 | 乐普医疗  | 32,571,260.62 | 0.80           |
| 13 | 002352 | 顺丰控股  | 29,901,379.00 | 0.73           |
| 14 | 00669  | 创科实业  | 28,987,663.87 | 0.71           |
| 15 | 300274 | 阳光电源  | 28,540,052.00 | 0.70           |
| 16 | 02333  | 长城汽车  | 22,739,012.90 | 0.56           |
| 17 | 02269  | 药明生物  | 20,480,514.86 | 0.50           |
| 18 | 03759  | 康龙化成  | 18,485,676.22 | 0.45           |
| 19 | 300059 | 东方财富  | 18,156,352.00 | 0.44           |
| 20 | 00291  | 华润啤酒  | 17,617,541.56 | 0.43           |

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,709,150,940.20 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 926,263,533.76   |

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 100,533,758.40   | 2.46         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 109,637,000.00   | 2.69         |
|    | 其中：政策性金融债 | 109,637,000.00   | 2.69         |
| 4  | 企业债券      | 1,102,728,000.00 | 27.01        |
| 5  | 企业短期融资券   | 561,929,000.00   | 13.76        |
| 6  | 中期票据      | 329,523,000.00   | 8.07         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | 806,414,000.00   | 19.75        |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 3,010,764,758.40 | 73.74        |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 112104020 | 21 中国银行 CD020 | 4,000,000 | 388,480,000.00 | 9.51         |
| 2  | 112104015 | 21 中国银行 CD015 | 2,000,000 | 194,240,000.00 | 4.76         |
| 3  | 200302    | 20 进出 02      | 1,100,000 | 109,637,000.00 | 2.69         |
| 4  | 112108051 | 21 中信银行 CD051 | 1,000,000 | 97,100,000.00  | 2.38         |
| 5  | 019649    | 21 国债 01      | 706,070   | 70,656,424.90  | 1.73         |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称     | 数量（份）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 137702 | 招慧 12A   | 400,000 | 40,208,000.00 | 0.98         |
| 2  | 137789 | 汇宇 1A3   | 300,000 | 30,135,000.00 | 0.74         |
| 3  | 137735 | 海诺 3 优 1 | 100,000 | 10,058,000.00 | 0.25         |

## 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，中国银行股份有限公司、中国进出口银行、中信银行股份有限公司、招商证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、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   | 963,409.75    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | 133,392.96    |
| 4  | 应收利息    | 33,213,632.33 |
| 5  | 应收申购款   | 129,979.80    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 34,440,414.84 |

### 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（%） |
| 54,036   | 76,170.11 | 15,538,235.43 | 0.38      | 4,100,389,840.82 | 99.62     |

### 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 | 89.58     | 0.00        |

### 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（2021 年 01 月 20 日）基金份额总额 | 4,112,764,550.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额           | 3,163,526.25     |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额         | —                |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额          | —                |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 4,115,928,076.25 |

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，本基金管理人未发生重大人事变动。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2021 年 01 月 20 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。

### 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（%） |    |
| 东方证券 | 2      | 773,782,935.43 | 29.42           | 687,467.82 | 28.85         |    |
| 长江证券 | 2      | 674,381,850.39 | 25.64           | 642,965.51 | 26.98         |    |
| 华西证券 | 2      | 512,156,754.70 | 19.47           | 458,329.59 | 19.23         |    |

|        |   |                |      |            |      |  |
|--------|---|----------------|------|------------|------|--|
| 中泰证券   | 1 | 163,782,213.52 | 6.23 | 152,528.62 | 6.40 |  |
| 民生证券   | 2 | 117,237,283.79 | 4.46 | 99,987.99  | 4.20 |  |
| 华创证券   | 1 | 78,740,125.14  | 2.99 | 71,755.76  | 3.01 |  |
| 华泰证券   | 2 | 75,632,655.76  | 2.88 | 60,506.53  | 2.54 |  |
| 中信证券   | 1 | 64,114,318.08  | 2.44 | 59,708.91  | 2.51 |  |
| 中金公司   | 2 | 42,781,789.70  | 1.63 | 37,255.29  | 1.56 |  |
| 国泰君安   | 1 | 40,342,656.47  | 1.53 | 36,764.52  | 1.54 |  |
| 海通证券   | 2 | 23,051,513.06  | 0.88 | 21,468.38  | 0.90 |  |
| 兴业证券   | 2 | 20,133,202.18  | 0.77 | 18,750.17  | 0.79 |  |
| 招商证券   | 2 | 20,042,589.00  | 0.76 | 18,665.87  | 0.78 |  |
| 国金证券   | 1 | 12,050,743.00  | 0.46 | 10,981.72  | 0.46 |  |
| 东方财富   | 2 | 11,589,219.02  | 0.44 | 5,798.63   | 0.24 |  |
| 方正证券   | 2 | 233,207.27     | 0.01 | 217.20     | 0.01 |  |
| 渤海证券   | 2 | -              | -    | -          | -    |  |
| 财通证券   | 1 | -              | -    | -          | -    |  |
| 长城证券   | 1 | -              | -    | -          | -    |  |
| 东海证券   | 2 | -              | -    | -          | -    |  |
| 国联证券   | 1 | -              | -    | -          | -    |  |
| 恒泰证券   | 2 | -              | -    | -          | -    |  |
| 华宝证券   | 1 | -              | -    | -          | -    |  |
| 中信建投证券 | 2 | -              | -    | -          | -    |  |



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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易             |                 | 债券回购交易            |                   | 权证交易 |                 | 基金交易 |                 |
|------|------------------|-----------------|-------------------|-------------------|------|-----------------|------|-----------------|
|      | 成交金额             | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例(%) |
| 东方证券 | 1,022,599,718.74 | 89.47           | 27,905,800,000.00 | 38.24             | -    | -               | -    | -               |
| 长江证券 | -                | -               | 2,140,000,000.00  | 2.93              | -    | -               | -    | -               |
| 华西证券 | 120,408,868.01   | 10.53           | 21,448,300,000.00 | 29.39             | -    | -               | -    | -               |
| 中泰证券 | -                | -               | 11,734,000,000.00 | 16.08             | -    | -               | -    | -               |
| 民生证券 | -                | -               | -                 | -                 | -    | -               | -    | -               |
| 华创证券 | -                | -               | -                 | -                 | -    | -               | -    | -               |
| 华泰证券 | -                | -               | 100,000,000.00    | 0.14              | -    | -               | -    | -               |

|      |   |   |                  |      |   |   |   |   |
|------|---|---|------------------|------|---|---|---|---|
| 中信证券 | - | - | 4,243,000,000.00 | 5.81 | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | 591,700,000.00   | 0.81 | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | -                | -    | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | 472,600,000.00   | 0.65 | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | 400,000,000.00   | 0.55 | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | -                | -    | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | -                | -    | - | - | - | - |
| 东方财富 | - | - | 3,345,200,000.00 | 4.58 | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | 590,000,000.00   | 0.81 | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | -                | -    | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | -                | -    | - | - | - | - |

|        |   |   |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 长城证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

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，同一基金管理人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  | 关于汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金线上直销系统认购费率执行标准的公告         | 中证报, 公司网站           | 2021 年 01 月 11 日 |
| 2  | 汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告                    | 中证报, 公司网站           | 2021 年 01 月 21 日 |
| 3  | 汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告     | 中证报, 公司网站           | 2021 年 04 月 20 日 |
| 4  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告                 | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2021 年 04 月 22 日 |
| 5  | 汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告                        | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2021 年 06 月 24 日 |
| 6  | 汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书 (2021 年 6 月 25 日更新) | 公司网站                | 2021 年 06 月 25 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稳健添益一年持有期混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富稳健添益一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富稳健添益一年持有期混合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](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

2021 年 08 月 31 日