

汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 02 月 01 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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	65
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	65
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	65

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	66
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	67
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
8.4 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.....	68
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	74
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
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.....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
§ 12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点	76
12.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证沪港深 500ETF
场内简称	HGS500
基金主代码	517080
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 02 月 01 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	953,166,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 02 月 22 日

注：本基金扩位证券简称为沪港深 500ETF 基金。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年02月01日(基金合同生效日) - 2021年06月30日)
本期已实现收益	-5,922,740.23
本期利润	-44,955,595.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0408
本期加权平均净值利润率	-4.30%
本期基金份额净值增长率	-4.05%
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	-38,626,062.73
期末可供分配基金份额利润	-0.0405
期末基金资产净值	914,539,937.27
期末基金份额净值	0.9595
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	-4.05%

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 02 月 01 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	-0.24%	0.69%	-1.02%	0.73%	0.78%	-0.04%
过去三个月	3.60%	0.82%	2.62%	0.89%	0.98%	-0.07%
自基金合同生效日起至今	-4.05%	1.09%	-1.25%	1.22%	-2.80%	-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

汇添富中证沪港深500ETF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 02 月 01 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		
董瑾	本基金的基金经理	2021 年 02 月 01 日		12	国籍:中国。学历:北京大学西方经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年

					12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

					2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立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，本基金及本基金与本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，也未出现本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

上半年，国内经济持续保持稳定恢复，就业形势总体稳定，市场活力逐步提升，发展预期向好，内生动力加强。随着统筹疫情防控和经济社会发展成果持续巩固，市场需求稳定恢复，工业企业经营状况不断改善，企业利润持续稳定增长。根据国家统计局数据，1—5 月份，全国规模以上工业企业利润同比增长 83.4%，比 2019 年同期增长 48.0%，两年平均增长 21.7%。6 月份，中国制造业采购经理指数、非制造业商务活动指数和综合 PMI 产出指数分别为 50.9%、53.5%和 52.9%，均持续位于临界点以上，我国经济运行继续保持扩张态势。

市场情况来看，一季度市场受到通胀预期等的影响出现了较大程度的调整，其中消费、医药、科技等板块调整幅度相对较大。二季度以来通胀预期降温、流动性相对充裕，市场迎来反弹。大部分行业上涨，钢铁、电力设备新能源和基础化工等行业领涨。受通货膨胀预期与大宗商品持续上行的影响，钢铁、基础化工、煤炭等周期风格年初以来大幅上涨，高景气度的电力设备及新能源也涨幅居前。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

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-4.05%。同期业绩比较基准收益率为-1.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球疫情仍在持续演变，外部环境不确定性仍在；国内经济相对来说韧性

更足，在高基数影响下，下半年预计季度增速温和回落，整体大概率能够维持稳健。消费有望延续复苏，制造业投资温和回升。

政策方面，根据最新的政治局会议要求，要做好宏观政策跨周期调节，保持宏观政策连续性、稳定性、可持续性，统筹做好今明两年宏观政策衔接，保持经济运行在合理区间。积极的财政政策要提升政策效能，稳健的货币政策要保持流动性合理充裕。国内流动性大概率仍将偏向边际宽松。海外来看，由于全球经济整体处于复苏阶段，美通胀创下新高，就业市场也出现了明显改善，因此美联储已经开始为货币政策正常化做准备。市场对于美联储货币收紧的预期已经较为充分，边际影响可能较小。

下半年市场行情或将延续分化，随着经济恢复常态，产业升级和消费升级所代表的“新经济”和成长风格可能重回主线。碳中和、物联网和先进制造等相关主题的投资机会也值得持续关注。随着年初以来的市场调整，港股科技股的估值已经回到较为合理的区间，科技股仍然是港股市场最具特色的资产，具备长期的配置价值。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

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

《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

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 2021 年 06 月 30 日
资 产:		
银行存款	6.4.7.1	67,211,089.22
结算备付金		7,004,879.69
存出保证金		3,322,923.01
交易性金融资产	6.4.7.2	838,815,257.25
其中：股票投资		838,508,810.75
基金投资		-
债券投资		306,446.50
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		11,548,525.48
应收利息	6.4.7.5	8,893.81
应收股利		2,114,638.15
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		930,026,206.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		15,025,049.61
应付赎回款		-
应付管理人报酬		117,321.98
应付托管费		39,107.34
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	237,425.41
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	67,365.00
负债合计		15,486,269.34
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	953,166,000.00

未分配利润	6.4.7.10	-38,626,062.73
所有者权益合计		914,539,937.27
负债和所有者权益总计		930,026,206.61

注：1、报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9595 元，基金份额总额 953,166,000.00 份。

2、本基金合同于 2021 年 02 月 01 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：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 02 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合 同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
一、收入		-41,757,622.99
1. 利息收入		524,411.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	524,263.71
债券利息收入		147.41
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,545,080.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-11,842,543.83
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	165,336.38
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	8,132,127.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-39,032,855.51
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	295,901.63
减：二、费用		3,197,972.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	641,644.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	213,881.45
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	2,274,921.68

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.24
7. 其他费用	6.4.7.21	67,525.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-44,955,595.74
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-44,955,595.74

注：本基金合同于 2021 年 02 月 01 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：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 02 月 01 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 2021 年 02 月 01 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）	1,089,166,000.00	-	1,089,166,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-44,955,595.74	-44,955,595.74
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）	-136,000,000.00	6,329,533.01	-129,670,466.99
其中：1. 基金申购款	184,000,000.00	-6,996,097.88	177,003,902.12
2. 基金赎回款	-320,000,000.00	13,325,630.89	-306,674,369.11
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）	953,166,000.00	-38,626,062.73	914,539,937.27

注：本基金合同于 2021 年 02 月 01 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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（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]3528 号《关于准予汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数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 20 日至 2021 年 1 月 26 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_B19 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 2 月 1 日生效。本基金为交易型开放式，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 1,089,166,000.00 元，在募集期内产生的利息为人民币 298,121.09 元，均计入基金财产。与首次募集相关的资产总额共计人民币 1,089,464,121.09 元，折合 1,089,166,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证沪港深 500 指数收益率。

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 02 月 01 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 02 月 01 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高低层次输入值，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) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配采用现金分红；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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 2021 年 06 月 30 日
活期存款	67,211,089.22
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	67,211,089.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 06 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		878,998,692.76	838,508,810.75	-40,489,882.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	295,600.00	306,446.50	10,846.50
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	295,600.00	306,446.50	10,846.50
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		879,294,292.76	838,815,257.25	-40,479,035.51

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	23,305,380.00	-	-	-

（股指期货投资）	23,305,380.00			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,305,380.00	-	-	-

注：本期末 2021 年 6 月 30 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IF2109	10	14,663,400.00	15,499,200.00	835,800.00
IF2112	6	8,641,980.00	9,252,360.00	610,380.00
总额合计：		1,446,180.00		
减：可抵销期货暂收款		1,446,180.00		
股指期货投资净额：		0.00		
买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。				

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	5,730.07
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	3,088.92
应收债券利息	23.61
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	51.21
合计	8,893.81

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 2021 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	237,425.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	237,425.41

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	35,928.00
应付信息披露费	31,437.00
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	67,365.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 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	1,089,166,000.00	1,089,166,000.00
本期申购	184,000,000.00	184,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-320,000,000.00	-320,000,000.00
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	953,166,000.00	953,166,000.00

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 02 月 01 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 1,089,166,000.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 0.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,089,166,000.00 元，折合 1,089,166,000.00 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	-5,922,740.23	-39,032,855.51	-44,955,595.74
本期基金份额交易产生的变动数	946,019.69	5,383,513.32	6,329,533.01
其中：基金申购款	-118,742.86	-6,877,355.02	-6,996,097.88
基金赎回款	1,064,762.55	12,260,868.34	13,325,630.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,976,720.54	-33,649,342.19	-38,626,062.73

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	478,583.43
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	33,491.02
其他	12,189.26
合计	524,263.71

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——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,654,383.88
股票投资收益——赎回差价收入	-4,188,159.95
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-11,842,543.83

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	255,312,734.72
减：卖出股票成本总额	262,967,118.60
买卖股票差价收入	-7,654,383.88

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	306,674,369.11
减：现金支付赎回款总额	204,472,486.11
减：赎回股票成本总额	106,390,042.95
赎回差价收入	-4,188,159.95

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 2021 年 02 月 01 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	1,027,162.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	861,700.00
减：应收利息总额	125.74
买卖债券差价收入	165,336.38

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 2021 年 02 月 01 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	8,132,127.22
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,132,127.22

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-40,479,035.51
——股票投资	-40,489,882.01
——债券投资	10,846.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	1,446,180.00
——权证投资	-
——期货投资	1,446,180.00
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	-39,032,855.51

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	295,901.63
其他	-
合计	295,901.63

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	2,274,921.68

银行间市场交易费用	-
合计	2,274,921.68

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	35,928.00
信息披露费	31,437.00
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	160.00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	67,525.00

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 02 月 01 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	816,968,439.71	56.40

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 02 月 01 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	70,492.69	6.86

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末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 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	698,423.73	55.98	7,474.95	3.15

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 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	641,644.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	213,881.45

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期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 02 月 01 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
工商银行	67,211,089.22	478,583.43

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

本基金根据基金合同和招募书约定的投资策略，按照标的指数的成分股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券及基金托管人工商银行发行的股票工商银行。

于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 83,300.00 股，持有工商银行 2,513,000.00 股。

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 (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	
605287	德才股份	2021年06月28日	2021年07月06日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	

301017	漱玉平民	2021年06月23日	2021年07月05日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	
300992	泰福泵业	2021年05月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	
300982	苏文电能	2021年04月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	
301016	雷尔伟	2021年06月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	
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	
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	
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	利元	2021年	2021年	新股	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	

	亨	06 月 23 日	07 月 01 日	流 通 受 限						
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	
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	
301011	华 立 科 技	2021 年 06 月 09 日	2021 年 12 月 17 日	新 股 流 通 受 限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	
300993	玉 马 遮 阳	2021 年 05 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新 股 流 通 受 限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	
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	2021 年 12 月	新 股 流 通	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	

		26 日	02 日	受限						
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	
301021	英 诺 激 光	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新股 流通 受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代 码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	可 流 通 日	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
113050	南 银 转 债	2021 年 06 月 16 日	2021 年 07 月 01 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	2,080	208,000.00	208,000.00	
123117	健 帆 转 债	2021 年 06 月 23 日	2021 年 07 月 12 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	106	10,600.00	10,600.00	
127038	国 微 转 债	2021 年 06 月 10	2021 年 07 月 14	新 债 流 通 受	100.00	100.00	260	26,000.00	26,000.00	

		日	日	限						
113049	长 汽 转 债	2021 年 06 月 11 日	2021 年 07 月 08 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	160	16,000.00	16,000.00	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股 票 名 称	停 牌 日 期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 (股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
002024	苏 宁 易 购	2021 年 06 月 16 日	重 大 资 产 重 组	5.59	2021 年 07 月 06 日	6.15	77,400	530,414.99	432,666.00	

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

除在附注 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

本期末 2021 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	67,211,089.22	-	-	-	-	-	67,211,089.22
结算备付金	7,004,879.69	-	-	-	-	-	7,004,879.69
存出保证金	352,735.81	-	-	-	-	2,970,187.20	3,322,923.01
交易性金融资产	-	-	306,446.50	-	-	838,508,810.75	838,815,257.25
应收股利	-	-	-	-	-	2,114,638.15	2,114,638.15
应收利息	-	-	-	-	-	8,893.81	8,893.81
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	11,548,525.48	11,548,525.48
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	74,568,704.72	-	306,446.50	-	-	855,151,055.39	930,026,206.61
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	117,321.98	117,321.98
应付 托管 费	-	-	-	-	-	39,107.34	39,107.34
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	15,025,049.61	15,025,049.61
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	237,425.41	237,425.41
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	67,365.00	67,365.00
负债总计	-	-	-	-	-	15,486,269.34	15,486,269.34
利率敏感度缺口	74,568,704.72	-	306,446.50	-	-	839,664,786.05	914,539,937.27

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转债债券和可交换债券。因此，除在交易所交易的可转换债券和可交换债券外，本基金本报告期计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

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	-	366,450,508.26	-	366,450,508.26
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	-	2,114,638.15	-	2,114,638.15
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	-	368,565,146.41	-	368,565,146.41
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	-	-	-	-
资产负债表外汇率	-	368,565,146.41	-	368,565,146.41

险敞口净额				
-------	--	--	--	--

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%	18,428,257.32
	港币相对人民币贬值 5%	-18,428,257.32

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	838,508,810.75	91.69
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	306,446.50	0.03
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	838,815,257.25	91.72

注：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。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；	
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021 年 06 月 30 日
	中证沪港深 500 上涨 5%	39,849,321.32
	中证沪港深 500 下跌 5%	-39,849,321.32

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	838,508,810.75	90.16
	其中：股票	838,508,810.75	90.16
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	306,446.50	0.03
	其中：债券	306,446.50	0.03
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	74,215,968.91	7.98
8	其他资产	16,994,980.45	1.83
9	合计	930,026,206.61	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 366,450,508.26 元，占期末净值比例为 40.07%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资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	4,856,830.80	0.53
B	采矿业	9,249,195.00	1.01
C	制造业	273,579,071.93	29.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,163,315.00	0.78
E	建筑业	5,592,440.00	0.61
F	批发和零售业	2,742,103.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	11,494,425.60	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,068,808.20	1.98
J	金融业	102,135,536.36	11.17
K	房地产业	9,539,049.00	1.04
L	租赁和商务服务业	8,130,210.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	7,274,006.40	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	766,663.00	0.08
Q	卫生和社会工作	9,289,249.16	1.02
R	文化、体育和娱乐业	1,734,473.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	471,615,376.45	51.57

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	277,185.30	0.03
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	67,112.46	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,230.40	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
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	13,285.02	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	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	442,926.04	0.05

7.2.3 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	6,763,703.74	0.74
15 原材料	2,942,983.75	0.32
20 工业	9,536,664.42	1.04
25 可选消费	66,797,054.26	7.30
30 日常消费	16,840,371.42	1.84
35 医疗保健	22,450,046.78	2.45
40 金融	100,317,434.46	10.97
45 信息技术	22,643,642.65	2.48
50 电信服务	76,429,360.44	8.36
55 公用事业	12,535,207.82	1.37
60 房地产	29,194,038.52	3.19
合计	366,450,508.26	40.07

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股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	140,100	68,079,454.27	7.44
2	03690	美团-W	127,600	34,017,959.92	3.72
3	600519	贵州茅台	12,000	24,680,400.00	2.70
4	601318	中国平安	216,400	13,910,192.00	1.52
4	02318	中国平安	155,000	9,808,351.02	1.07
5	01299	友邦保险	252,600	20,282,698.87	2.22
6	600036	招商银行	246,600	13,363,254.00	1.46
6	03968	招商银行	95,500	5,264,466.15	0.58
7	00005	汇丰控股	433,200	16,166,498.96	1.77
8	300750	宁德时代	28,300	15,134,840.00	1.65

9	00939	建设银行	2,513,000	12,776,114.11	1.40
9	601939	建设银行	134,200	892,430.00	0.10
10	000858	五粮液	38,499	11,468,467.11	1.25
11	01398	工商银行	1,814,000	6,882,832.63	0.75
11	601398	工商银行	699,000	3,613,830.00	0.40
12	00388	香港交易所	26,600	10,243,304.20	1.12
13	01810	小米集团-W	419,200	9,417,814.27	1.03
14	02269	药明生物	69,500	8,229,146.39	0.90
15	002594	比亚迪	17,900	4,492,900.00	0.49
15	01211	比亚迪股份	18,000	3,477,761.57	0.38
16	601012	隆基股份	86,479	7,682,794.36	0.84
17	000333	美的集团	98,000	6,994,260.00	0.76
18	600276	恒瑞医药	89,600	6,090,112.00	0.67
19	002415	海康威视	93,700	6,043,650.00	0.66
20	601166	兴业银行	289,600	5,951,280.00	0.65
21	601888	中国中免	19,400	5,821,940.00	0.64
22	300760	迈瑞医疗	11,600	5,568,580.00	0.61
23	603259	药明康德	35,360	5,537,022.40	0.61
24	300059	东方财富	164,560	5,395,922.40	0.59
25	03988	中国银行	1,745,000	4,051,023.08	0.44
25	601988	中国银行	419,700	1,292,676.00	0.14
26	00941	中国移动	129,000	5,211,275.44	0.57
27	600030	中信证券	169,900	4,237,306.00	0.46
27	06030	中信证券	48,000	778,028.08	0.09
28	000651	格力电器	95,900	4,996,390.00	0.55
29	600900	长江电力	226,400	4,672,896.00	0.51
30	002475	立讯精密	97,100	4,466,600.00	0.49
31	600887	伊利股份	121,000	4,456,430.00	0.49
32	00669	创科实业	39,000	4,400,371.87	0.48
33	000001	平安银行	193,900	4,386,018.00	0.48
34	601328	交通银行	547,500	2,682,750.00	0.29
34	03328	交通银行	365,000	1,585,362.02	0.17
35	000725	京东方A	675,000	4,212,000.00	0.46
36	02331	李宁	52,000	4,101,821.57	0.45
37	000002	万科A	136,400	3,247,684.00	0.36
37	02202	万科企业	39,300	794,628.08	0.09
38	300015	爱尔眼科	53,442	3,793,313.16	0.41
39	02020	安踏体育	24,000	3,650,501.38	0.40
40	600309	万华化学	31,900	3,471,358.00	0.38
41	600031	三一重工	118,100	3,433,167.00	0.38
42	000568	泸州老窖	14,200	3,350,348.00	0.37
43	603288	海天味业	25,460	3,283,067.00	0.36
44	600809	山西汾酒	7,300	3,270,400.00	0.36

45	02382	舜宇光学科技	16,000	3,267,078.91	0.36
46	002714	牧原股份	53,040	3,225,892.80	0.35
47	601288	农业银行	573,900	1,738,917.00	0.19
47	01288	农业银行	642,000	1,442,327.47	0.16
48	601601	中国太保	68,500	1,984,445.00	0.22
48	02601	中国太保	58,000	1,179,972.65	0.13
49	603501	韦尔股份	9,800	3,155,600.00	0.35
50	02628	中国人寿	155,000	1,986,174.96	0.22
50	601628	中国人寿	32,800	1,111,592.00	0.12
51	02313	申洲国际	18,700	3,051,295.61	0.33
52	06160	百济神州	17,300	3,040,220.62	0.33
53	600690	海尔智家	75,000	1,943,250.00	0.21
53	06690	海尔智家	47,200	1,064,330.17	0.12
54	00016	新鸿基地产	30,500	2,936,285.51	0.32
55	600585	海螺水泥	48,100	1,974,505.00	0.22
55	00914	海螺水泥	28,000	959,887.49	0.10
56	06098	碧桂园服务	42,000	2,932,083.50	0.32
57	601919	中远海控	96,000	2,931,840.00	0.32
58	300122	智飞生物	15,700	2,931,661.00	0.32
59	00386	中国石油化工股份	536,000	1,752,759.88	0.19
59	600028	中国石化	266,400	1,161,504.00	0.13
60	600436	片仔癀	6,400	2,869,120.00	0.31
61	002142	宁波银行	72,300	2,817,531.00	0.31
62	00001	长和	55,500	2,793,916.62	0.31
63	00883	中国海洋石油	373,000	2,740,530.37	0.30
64	00002	中电控股	42,500	2,715,909.12	0.30
65	601899	紫金矿业	275,500	2,669,595.00	0.29
66	300782	卓胜微	4,960	2,666,000.00	0.29
67	00175	吉利汽车	122,000	2,482,011.43	0.27
68	06618	京东健康	26,650	2,468,069.93	0.27
69	002352	顺丰控股	36,100	2,443,970.00	0.27
70	00027	银河娱乐	47,000	2,430,547.28	0.27
71	00857	中国石油股份	440,000	1,383,915.46	0.15
71	601857	中国石油	193,500	1,023,615.00	0.11
72	002304	洋河股份	11,500	2,382,800.00	0.26
73	09633	农夫山泉	73,400	2,378,858.47	0.26
74	002230	科大讯飞	35,100	2,372,058.00	0.26
75	01113	长实集团	53,000	2,363,772.86	0.26
76	300014	亿纬锂能	22,700	2,359,211.00	0.26
77	00003	香港中华煤气	234,700	2,355,187.46	0.26
78	600000	浦发银行	234,500	2,345,000.00	0.26
79	300274	阳光电源	20,300	2,335,718.00	0.26

80	300124	汇川技术	31,350	2,328,051.00	0.25
81	000661	长春高新	6,000	2,322,000.00	0.25
82	002812	恩捷股份	9,900	2,317,590.00	0.25
83	600438	通威股份	53,300	2,306,291.00	0.25
84	01801	信达生物	30,500	2,298,017.74	0.25
85	600016	民生银行	423,800	1,868,958.00	0.20
85	01988	民生银行	138,500	428,704.26	0.05
86	02319	蒙牛乳业	57,000	2,226,770.89	0.24
87	600837	海通证券	192,500	2,213,750.00	0.24
88	601658	邮储银行	217,700	1,092,854.00	0.12
88	01658	邮储银行	250,000	1,087,944.60	0.12
89	601088	中国神华	65,800	1,284,416.00	0.14
89	01088	中国神华	70,000	886,498.03	0.10
90	300347	泰格医药	11,100	2,145,630.00	0.23
91	000100	TCL 科技	280,200	2,143,530.00	0.23
92	00291	华润啤酒	36,000	2,089,352.88	0.23
93	601816	京沪高铁	393,000	2,078,970.00	0.23
94	002241	歌尔股份	48,100	2,055,794.00	0.22
95	00011	恒生银行	15,900	2,051,984.17	0.22
96	000063	中兴通讯	61,400	2,040,322.00	0.22
97	02688	新奥能源	16,500	2,029,193.50	0.22
98	01109	华润置地	76,000	1,988,837.62	0.22
99	00981	中芯国际	99,000	1,968,784.49	0.22
100	300142	沃森生物	31,900	1,968,230.00	0.22
101	601668	中国建筑	417,200	1,939,980.00	0.21
102	600763	通策医疗	4,700	1,931,700.00	0.21
103	02388	中银香港	88,000	1,929,427.10	0.21
104	002027	分众传媒	204,600	1,925,286.00	0.21
105	002271	东方雨虹	34,750	1,922,370.00	0.21
106	603799	华友钴业	16,700	1,907,140.00	0.21
107	002460	赣锋锂业	15,700	1,901,113.00	0.21
108	603986	兆易创新	9,980	1,875,242.00	0.21
109	01093	石药集团	200,000	1,870,515.84	0.20
110	01928	金沙中国有限公司	66,800	1,817,562.27	0.20
111	01177	中国生物制药	278,000	1,762,644.99	0.19
112	600196	复星医药	24,200	1,745,546.00	0.19
113	600048	保利地产	143,000	1,721,720.00	0.19
114	000338	潍柴动力	95,200	1,701,224.00	0.19
115	600703	三安光电	53,000	1,698,650.00	0.19
116	600919	江苏银行	236,300	1,677,730.00	0.18
117	002129	中环股份	42,400	1,636,640.00	0.18
118	601229	上海银行	199,000	1,631,800.00	0.18

119	601688	华泰证券	102,700	1,622,660.00	0.18
120	600050	中国联通	371,300	1,604,016.00	0.18
121	00268	金蝶国际	73,000	1,600,547.48	0.18
122	00968	信义光能	114,000	1,589,805.33	0.17
123	600660	福耀玻璃	28,400	1,586,140.00	0.17
124	00868	信义玻璃	60,000	1,580,119.92	0.17
125	688111	金山办公	4,000	1,579,200.00	0.17
126	601211	国泰君安	90,200	1,546,028.00	0.17
127	600104	上汽集团	70,300	1,544,491.00	0.17
128	600570	恒生电子	16,400	1,529,300.00	0.17
129	601766	中国中车	243,000	1,477,440.00	0.16
130	01997	九龙仓置业	39,000	1,465,168.07	0.16
131	002371	北方华创	5,200	1,442,376.00	0.16
132	601169	北京银行	295,600	1,439,572.00	0.16
133	600999	招商证券	74,800	1,422,696.00	0.16
134	00066	港铁公司	39,500	1,421,504.67	0.16
135	00960	龙湖集团	38,500	1,393,525.98	0.15
136	00853	微创医疗	24,000	1,390,904.93	0.15
137	002049	紫光国微	9,000	1,387,710.00	0.15
138	600019	宝钢股份	178,500	1,363,740.00	0.15
139	06969	思摩尔国际	38,000	1,361,199.67	0.15
140	00688	中国海外发展	91,000	1,335,688.10	0.15
141	02007	碧桂园	184,000	1,331,993.66	0.15
142	002311	海大集团	16,300	1,330,080.00	0.15
143	06186	中国飞鹤	94,000	1,310,892.12	0.14
144	01918	融创中国	59,000	1,308,320.99	0.14
145	300601	康泰生物	8,700	1,296,300.00	0.14
146	300498	温氏股份	89,400	1,284,678.00	0.14
147	002410	广联达	18,800	1,282,160.00	0.14
148	600406	国电南瑞	54,960	1,277,270.40	0.14
149	00241	阿里健康	88,000	1,260,900.75	0.14
150	00267	中信股份	181,000	1,260,576.24	0.14
151	601818	光大银行	331,300	1,252,314.00	0.14
152	000538	云南白药	10,800	1,249,776.00	0.14
153	00006	电能实业	31,500	1,248,931.28	0.14
154	300450	先导智能	20,340	1,223,247.60	0.13
155	300759	康龙化成	5,600	1,215,144.00	0.13
156	000625	长安汽车	45,520	1,196,265.60	0.13
157	002821	凯莱英	3,100	1,155,060.00	0.13
158	600745	闻泰科技	11,900	1,153,110.00	0.13
159	300454	深信服	4,400	1,141,712.00	0.12
160	600893	航发动力	21,300	1,132,947.00	0.12
161	00992	联想集团	152,000	1,129,432.11	0.12

162	09992	泡泡玛特	17,600	1,127,634.82	0.12
163	600346	恒力石化	42,300	1,109,952.00	0.12
164	300595	欧普康视	10,700	1,107,985.00	0.12
165	00017	新世界发展	33,000	1,107,956.12	0.12
166	300896	爱美客	1,400	1,104,432.00	0.12
167	688036	传音控股	5,200	1,089,400.00	0.12
168	601633	长城汽车	24,500	1,067,955.00	0.12
169	601390	中国中铁	203,500	1,066,340.00	0.12
170	600588	用友网络	32,000	1,064,320.00	0.12
171	00586	海螺创业	38,500	1,047,547.12	0.11
172	002493	荣盛石化	60,390	1,042,935.30	0.11
173	601009	南京银行	99,100	1,042,532.00	0.11
174	601377	兴业证券	106,800	1,031,688.00	0.11
175	600132	重庆啤酒	5,100	1,009,545.00	0.11
176	01821	ESR	44,800	976,662.22	0.11
177	00998	中信银行	217,000	664,465.80	0.07
177	601998	中信银行	61,200	312,120.00	0.03
178	600009	上海机场	20,000	962,600.00	0.11
179	01833	平安好医生	11,900	957,499.42	0.10
180	600089	特变电工	74,400	956,040.00	0.10
181	00012	恒基地产	31,000	949,236.86	0.10
182	300413	芒果超媒	13,800	946,680.00	0.10
183	600584	长电科技	25,100	945,768.00	0.10
184	601100	恒立液压	11,000	945,120.00	0.10
185	601225	陕西煤业	79,300	939,705.00	0.10
186	002601	龙蟠佰利	27,000	933,660.00	0.10
187	688012	中微公司	5,600	929,152.00	0.10
188	600426	华鲁恒升	29,980	927,881.00	0.10
189	603882	金域医学	5,800	926,666.00	0.10
190	300408	三环集团	21,800	924,756.00	0.10
191	00384	中国燃气	46,800	922,909.85	0.10
192	06666	恒大物业	112,500	912,687.75	0.10
193	01066	威高股份	60,000	904,637.38	0.10
194	600111	北方稀土	43,700	904,590.00	0.10
195	002001	新 和 成	31,500	903,420.00	0.10
196	03908	中金公司	32,400	563,451.29	0.06
196	601995	中金公司	5,500	338,250.00	0.04
197	300433	蓝思科技	30,400	894,064.00	0.10
198	000776	广发证券	59,000	893,260.00	0.10
199	00288	万洲国际	153,500	891,515.47	0.10
200	03888	金山软件（二百）	23,000	890,866.45	0.10
201	000895	双汇发展	27,900	887,220.00	0.10

202	300661	圣邦股份	3,450	871,918.50	0.10
203	002841	视源股份	7,000	870,030.00	0.10
204	600926	杭州银行	58,900	868,775.00	0.09
205	00788	中国铁塔	974,000	867,177.13	0.09
206	600600	青岛啤酒	7,400	855,810.00	0.09
207	002050	三花智控	35,500	851,290.00	0.09
208	000166	申万宏源	180,200	843,336.00	0.09
209	600741	华域汽车	31,900	838,013.00	0.09
210	600958	东方证券	83,300	832,167.00	0.09
211	02328	中国财险	146,000	826,089.02	0.09
212	300003	乐普医疗	25,400	815,848.00	0.09
213	00083	信和置业	80,000	814,772.74	0.09
214	002179	中航光电	10,300	813,906.00	0.09
215	00004	九龙仓集团	33,000	812,775.74	0.09
216	603806	福斯特	7,720	811,603.60	0.09
217	00881	中升控股	15,000	806,285.52	0.09
218	002007	华兰生物	21,900	803,292.00	0.09
219	00909	明源云	25,000	801,917.10	0.09
220	000963	华东医药	17,200	791,372.00	0.09
221	00772	阅文集团	11,000	790,351.19	0.09
222	000786	北新建材	20,100	788,925.00	0.09
223	06862	海底捞	23,000	782,737.66	0.09
224	000157	中联重科	84,500	780,780.00	0.09
225	01193	华润燃气	20,000	775,498.56	0.08
226	601233	桐昆股份	32,100	773,289.00	0.08
227	002607	中公教育	36,700	766,663.00	0.08
228	601901	方正证券	81,600	763,776.00	0.08
229	600015	华夏银行	122,400	757,656.00	0.08
230	688169	石头科技	600	756,600.00	0.08
231	00101	恒隆地产	48,000	753,265.38	0.08
232	601336	新华保险	16,400	752,924.00	0.08
233	600176	中国巨石	48,436	751,242.36	0.08
234	02018	瑞声科技	15,500	749,329.64	0.08
235	002236	大华股份	35,400	746,940.00	0.08
236	601989	中国重工	181,100	746,132.00	0.08
237	600143	金发科技	35,700	744,702.00	0.08
238	601155	新城控股	17,900	744,640.00	0.08
239	01876	百威亚太	36,100	735,933.16	0.08
240	03692	翰森制药	26,000	735,558.72	0.08
241	601138	工业富联	59,200	734,672.00	0.08
242	300529	健帆生物	8,500	734,060.00	0.08
243	000768	中航西飞	27,800	730,584.00	0.08
244	603993	洛阳钼业	139,800	721,368.00	0.08

245	600352	浙江龙盛	52,300	718,602.00	0.08
246	601877	正泰电器	21,400	714,332.00	0.08
247	600010	宝钢股份	457,000	708,350.00	0.08
248	601788	光大证券	39,000	697,710.00	0.08
249	00728	中国电信	288,000	697,349.61	0.08
250	001979	招商蛇口	63,400	694,230.00	0.08
251	600760	中航沈飞	11,420	688,626.00	0.08
252	601600	中国铝业	129,800	687,940.00	0.08
253	601186	中国铁建	92,500	687,275.00	0.08
254	600547	山东黄金	35,600	684,232.00	0.07
255	002008	大族激光	16,900	682,591.00	0.07
256	300999	金龙鱼	8,000	679,680.00	0.07
257	01691	J S 环球生活	37,000	672,695.08	0.07
258	01044	恒安国际	15,500	670,656.48	0.07
259	002185	华天科技	43,500	669,465.00	0.07
260	002202	金风科技	55,000	668,800.00	0.07
261	000876	新 希 望	45,300	664,551.00	0.07
262	01378	中国宏桥	75,500	660,887.86	0.07
263	601916	浙商银行	166,200	659,814.00	0.07
264	603899	晨光文具	7,800	659,568.00	0.07
265	603369	今世缘	12,100	655,336.00	0.07
266	01038	长江基建集团	17,000	654,930.17	0.07
267	601799	星宇股份	2,900	654,588.00	0.07
268	00270	粤海投资	70,000	650,020.90	0.07
269	002555	三七互娱	27,000	648,540.00	0.07
270	01209	华润万象生活	14,600	645,685.76	0.07
271	00322	康师傅控股	50,000	644,862.00	0.07
272	000938	紫光股份	28,800	630,144.00	0.07
273	003816	中国广核	236,000	630,120.00	0.07
274	03323	中国建材	82,000	622,262.71	0.07
275	603160	汇顶科技	4,800	622,224.00	0.07
276	600109	国金证券	48,900	620,541.00	0.07
277	00285	比亚迪电子	14,500	615,323.16	0.07
278	601066	中信建投	19,500	612,885.00	0.07
279	002736	国信证券	57,000	612,750.00	0.07
280	00522	ASM PACIFIC	7,000	612,743.71	0.07
281	000069	华侨城 A	81,900	609,336.00	0.07
282	01114	BRILLIANCE CHI	100,000	607,418.40	0.07
283	600989	宝丰能源	44,000	601,920.00	0.07
284	688008	澜起科技	9,600	598,848.00	0.07
285	000425	徐工机械	93,900	598,143.00	0.07
286	300136	信维通信	19,200	592,896.00	0.06
287	603659	璞泰来	4,340	592,844.00	0.06

288	601669	中国电建	151,900	587,853.00	0.06
289	600150	中国船舶	35,200	581,152.00	0.06
290	600298	安琪酵母	10,600	576,428.00	0.06
291	002384	东山精密	27,600	575,184.00	0.06
292	000596	古井贡酒	2,400	574,800.00	0.06
293	300677	英科医疗	4,600	574,080.00	0.06
294	300558	贝达药业	5,300	573,672.00	0.06
295	00151	中国旺旺	125,000	572,055.00	0.06
296	000977	浪潮信息	20,200	568,226.00	0.06
297	601238	广汽集团	43,700	565,915.00	0.06
298	002624	完美世界	23,500	561,885.00	0.06
299	00135	昆仑能源	94,000	560,023.12	0.06
300	000783	长江证券	76,400	559,248.00	0.06
301	603019	中科曙光	20,200	557,722.00	0.06
302	300146	汤臣倍健	16,800	552,720.00	0.06
303	00425	敏实集团	18,000	552,667.54	0.06
304	601838	成都银行	43,400	548,576.00	0.06
305	600079	人福医药	19,400	548,438.00	0.06
306	603517	绝味食品	6,500	547,885.00	0.06
307	688185	康希诺	700	544,439.00	0.06
308	300253	卫宁健康	33,400	543,418.00	0.06
309	600183	生益科技	23,100	540,771.00	0.06
310	603833	欧派家居	3,800	539,448.00	0.06
311	300144	宋城演艺	31,900	535,920.00	0.06
312	601108	财通证券	50,600	530,794.00	0.06
313	600886	国投电力	55,200	530,472.00	0.06
314	000703	恒逸石化	44,300	529,385.00	0.06
315	601985	中国核电	104,600	529,276.00	0.06
316	002405	四维图新	35,900	527,730.00	0.06
317	00019	太古股份公司 A	12,000	525,708.14	0.06
318	600029	南方航空	87,200	524,944.00	0.06
319	002791	坚朗五金	2,700	523,935.00	0.06
320	601360	三六零	42,800	522,588.00	0.06
321	300676	华大基因	4,400	521,840.00	0.06
322	603589	口子窖	7,700	521,213.00	0.06
323	01579	颐海国际	12,000	520,715.66	0.06
324	300033	同花顺	4,600	518,788.00	0.06
325	603816	顾家家居	6,700	517,776.00	0.06
326	600219	南山铝业	143,700	517,320.00	0.06
327	601555	东吴证券	61,500	512,910.00	0.06
328	002414	高德红外	18,560	511,884.80	0.06
329	000066	中国长城	34,900	509,540.00	0.06

330	002600	领益智造	55,400	509,126.00	0.06
331	002252	上海莱士	67,500	505,575.00	0.06
332	01516	融创服务	21,000	504,115.67	0.06
333	600522	中天科技	49,700	497,000.00	0.05
334	002044	美年健康	54,000	491,940.00	0.05
335	601077	渝农商行	122,800	489,972.00	0.05
336	000728	国元证券	61,000	486,170.00	0.05
337	601607	上海医药	22,900	483,877.00	0.05
338	00656	复星国际	52,000	483,738.03	0.05
339	002938	鹏鼎控股	13,400	480,792.00	0.05
340	600845	宝信软件	9,420	479,478.00	0.05
341	300628	亿联网络	5,700	477,660.00	0.05
342	002602	世纪华通	74,300	477,006.00	0.05
343	603444	吉比特	900	477,000.00	0.05
344	00813	世茂集团	30,000	475,284.10	0.05
345	01972	太古地产	24,400	470,008.71	0.05
346	601111	中国国航	59,800	465,244.00	0.05
347	002508	老板电器	10,000	465,000.00	0.05
348	600362	江西铜业	20,700	463,266.00	0.05
349	600332	白云山	13,600	460,360.00	0.05
350	600383	金地集团	44,900	459,776.00	0.05
351	000860	顺鑫农业	10,900	459,762.00	0.05
352	600161	天坛生物	13,400	458,950.00	0.05
353	00762	中国联通	130,000	458,642.50	0.05
354	601800	中国交建	70,500	456,840.00	0.05
355	002916	深南电路	4,100	455,633.00	0.05
356	601966	玲珑轮胎	10,400	454,896.00	0.05
357	002422	科伦药业	22,800	454,860.00	0.05
358	600115	中国东航	89,200	453,136.00	0.05
359	002385	大北农	66,200	450,160.00	0.05
360	00884	旭辉控股集团	88,000	443,731.62	0.05
361	600872	中炬高新	10,500	441,210.00	0.05
362	600061	国投资本	51,704	438,966.96	0.05
363	601021	春秋航空	7,700	438,130.00	0.05
364	601727	上海电气	102,300	433,752.00	0.05
365	002024	苏宁易购	77,400	432,666.00	0.05
366	00345	VITASOY INT'L	18,000	432,099.14	0.05
367	601117	中国化学	49,200	430,992.00	0.05
368	603939	益丰药房	7,560	424,040.40	0.05
369	06110	滔搏	40,000	423,362.30	0.05
370	601618	中国中冶	142,000	423,160.00	0.05
371	601162	天风证券	86,600	420,876.00	0.05
372	000708	中信特钢	20,000	416,800.00	0.05

373	300308	中际旭创	10,800	416,016.00	0.05
374	600705	中航资本	106,400	411,768.00	0.05
375	601878	浙商证券	31,300	409,404.00	0.04
376	600699	均胜电子	15,900	405,768.00	0.04
377	002064	华峰化学	28,400	403,280.00	0.04
378	00817	中国金茂	186,000	402,393.89	0.04
379	600606	绿地控股	73,300	399,485.00	0.04
380	002180	纳思达	12,400	399,280.00	0.04
381	002013	中航机电	38,400	386,688.00	0.04
382	601990	南京证券	36,700	386,084.00	0.04
383	002456	欧菲光	43,400	385,392.00	0.04
384	002127	南极电商	39,200	382,984.00	0.04
385	002157	正邦科技	31,900	381,205.00	0.04
386	002463	沪电股份	24,300	375,921.00	0.04
387	000656	金科股份	64,400	372,876.00	0.04
388	00836	华润电力	42,000	370,442.02	0.04
389	600011	华能国际	87,500	369,250.00	0.04
390	01313	华润水泥控股	60,000	368,445.02	0.04
391	600521	华海药业	17,400	363,312.00	0.04
392	03333	中国恒大	43,000	362,087.93	0.04
393	600177	雅戈尔	54,500	359,155.00	0.04
394	600536	中国软件	6,300	358,659.00	0.04
395	603392	万泰生物	1,380	357,668.40	0.04
396	601933	永辉超市	75,400	356,642.00	0.04
397	00880	澳博控股	50,000	352,801.92	0.04
398	000050	深天马 A	24,600	348,828.00	0.04
399	601216	君正集团	68,300	347,647.00	0.04
400	002299	圣农发展	14,500	346,260.00	0.04
401	603195	公牛集团	1,700	343,400.00	0.04
402	06993	蓝月亮集团	37,500	342,608.94	0.04
403	600848	上海临港	19,060	341,174.00	0.04
404	600066	宇通客车	27,300	340,977.00	0.04
405	03380	龙光集团	35,000	338,406.94	0.04
406	601696	中银证券	16,300	335,617.00	0.04
407	600118	中国卫星	11,400	333,564.00	0.04
408	01128	永利澳门	32,800	333,510.98	0.04
409	600038	中直股份	6,300	332,262.00	0.04
410	02689	玖龙纸业	40,000	331,500.67	0.04
411	01030	新城发展	54,000	330,701.88	0.04
412	01929	周大福	22,400	330,648.62	0.04
413	600489	中金黄金	38,200	329,284.00	0.04
414	600018	上港集团	68,900	328,653.00	0.04
415	600369	西南证券	67,100	326,777.00	0.04

416	00008	电讯盈科	96,000	325,110.30	0.04
417	002558	巨人网络	24,100	320,530.00	0.04
418	00966	中国太平	29,600	318,214.02	0.03
419	002373	千方科技	19,000	317,300.00	0.03
420	002120	韵达股份	23,300	315,249.00	0.03
421	02282	美高梅中国	32,000	313,128.35	0.03
422	300383	光环新网	21,700	312,263.00	0.03
423	002926	华西证券	32,200	310,086.00	0.03
424	688126	沪硅产业	10,500	306,390.00	0.03
425	601198	东兴证券	27,800	303,854.00	0.03
426	00144	招商局港口	32,000	301,945.19	0.03
427	601872	招商轮船	64,380	297,435.60	0.03
428	601319	中国人保	50,100	297,093.00	0.03
429	002065	东华软件	37,400	296,582.00	0.03
430	688009	中国通号	52,000	295,880.00	0.03
431	603338	浙江鼎力	5,000	293,450.00	0.03
432	002294	信立泰	8,900	292,810.00	0.03
433	002673	西部证券	35,400	292,050.00	0.03
434	03383	雅居乐集团	34,000	284,604.64	0.03
435	601865	福莱特	7,100	280,663.00	0.03
436	603658	安图生物	3,690	279,591.30	0.03
437	600895	张江高科	15,200	277,704.00	0.03
438	601881	中国银河	25,600	275,968.00	0.03
439	600188	兖州煤业	17,600	270,336.00	0.03
440	600233	圆通速递	25,400	254,254.00	0.03
441	603233	大参林	4,960	253,505.60	0.03
442	00392	北京控股	11,000	252,161.84	0.03
443	603866	桃李面包	8,080	252,096.00	0.03
444	300251	光线传媒	23,300	251,873.00	0.03
445	600372	中航电子	15,100	249,905.00	0.03
446	03808	中国重汽	18,000	249,224.60	0.03
447	603707	健友股份	5,900	246,325.00	0.03
448	600498	烽火通信	13,200	245,916.00	0.03
449	02588	中银航空租赁	4,500	245,255.58	0.03
450	002146	荣盛发展	43,100	243,084.00	0.03
451	01813	合景泰富集团	27,000	233,648.06	0.03
452	600801	华新水泥	13,100	230,167.00	0.03
453	600027	华电国际	66,300	228,072.00	0.02
454	002153	石基信息	9,580	225,225.80	0.02
455	000961	中南建设	37,400	221,408.00	0.02
456	002032	苏泊尔	3,400	216,886.00	0.02
457	601577	长沙银行	24,100	215,454.00	0.02
458	601231	环旭电子	12,600	211,806.00	0.02

459	000987	越秀金控	16,500	208,890.00	0.02
460	600340	华夏幸福	39,300	205,932.00	0.02
461	002939	长城证券	18,300	203,679.00	0.02
462	600025	华能水电	35,100	203,229.00	0.02
463	000800	一汽解放	18,500	200,170.00	0.02
464	06808	高鑫零售	40,500	194,781.61	0.02
465	601236	红塔证券	14,300	193,908.00	0.02
466	002773	康弘药业	7,700	178,101.00	0.02
467	601456	国联证券	10,900	167,860.00	0.02
468	601808	中海油服	11,500	165,140.00	0.02
469	600918	中泰证券	14,700	159,054.00	0.02
470	00293	国泰航空	28,000	152,836.45	0.02
471	601698	中国卫通	9,300	150,567.00	0.02
472	603087	甘李药业	1,300	138,554.00	0.02
473	300888	稳健医疗	1,100	135,982.00	0.01
474	300866	安克创新	800	133,976.00	0.01
475	688180	君实生物	1,600	129,936.00	0.01
476	600299	安迪苏	8,400	100,464.00	0.01
477	300832	新产业	1,600	98,560.00	0.01
478	002901	大博医疗	900	65,601.00	0.01
479	300869	康泰医学	900	63,738.00	0.01

7.3.2 期末积极投资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	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
2	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
3	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
4	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
5	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
6	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
7	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
8	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
9	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
10	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
11	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
12	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
13	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
14	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00

15	605162	新 中 港	1,377	8,358.39	0.00
16	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
17	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
18	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
19	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
20	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
21	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
22	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
23	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
24	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
25	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	121,655,380.97	13.30
2	03690	美团-W	49,671,578.22	5.43
3	601318	中国平安	21,661,126.58	2.37
3	02318	中国平安	16,881,547.51	1.85
4	600519	贵州茅台	36,462,733.82	3.99
5	01299	友邦保险	29,499,734.88	3.23
6	600036	招商银行	17,035,514.61	1.86
6	03968	招商银行	7,138,288.74	0.78
7	00005	汇丰控股	21,542,626.14	2.36
8	00939	建设银行	17,818,823.38	1.95
8	601939	建设银行	1,150,661.00	0.13
9	000858	五 粮 液	18,099,858.52	1.98
10	00388	香港交易所	16,510,336.04	1.81
11	01398	工商银行	10,640,521.80	1.16
11	601398	工商银行	4,525,984.00	0.49
12	000333	美的集团	14,173,349.55	1.55
13	300750	宁德时代	14,049,720.00	1.54
14	01810	小米集团-W	12,485,149.06	1.37
15	002594	比亚迪	6,755,302.00	0.74
15	01211	比亚迪股份	4,366,020.44	0.48
16	600276	恒瑞医药	10,052,846.00	1.10
17	601166	兴业银行	9,421,511.00	1.03
18	02269	药明生物	9,320,312.91	1.02

19	601888	中国中免	8,662,659.92	0.95
20	000651	格力电器	8,445,974.00	0.92

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	00700	腾讯控股	31,449,957.20	3.44
2	01299	友邦保险	8,735,384.62	0.96
3	03690	美团-W	8,725,432.24	0.95
4	00005	汇丰控股	7,126,032.79	0.78
5	02318	中国平安	4,702,935.74	0.51
5	601318	中国平安	1,260,618.88	0.14
6	000858	五粮液	5,790,504.20	0.63
7	00939	建设银行	5,538,166.80	0.61
7	601939	建设银行	54,926.00	0.01
8	00388	香港交易所	4,743,680.30	0.52
9	000333	美的集团	3,895,644.00	0.43
10	01398	工商银行	3,252,140.40	0.36
10	601398	工商银行	235,172.00	0.03
11	03968	招商银行	2,243,996.12	0.25
11	600036	招商银行	1,166,410.00	0.13
12	300750	宁德时代	3,136,202.00	0.34
13	01810	小米集团-W	2,707,250.33	0.30
14	000651	格力电器	2,706,437.00	0.30
15	02269	药明生物	2,548,210.29	0.28
16	002594	比亚迪	1,909,025.00	0.21
16	01211	比亚迪股份	522,024.61	0.06
17	300059	东方财富	2,356,134.50	0.26
18	00941	中国移动	2,296,949.19	0.25
19	000568	泸州老窖	2,235,586.00	0.24
20	000002	万科A	1,807,528.00	0.20
20	02202	万科企业	379,829.15	0.04

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,194,891,441.31
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	255,312,734.72
--------------	----------------

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	306,446.50	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	306,446.50	0.03

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	113050	南银转债	2,080	208,000.00	0.02
2	127036	三花转债	350	45,846.50	0.01
3	127038	国微转债	260	26,000.00	0.00
4	113049	长汽转债	160	16,000.00	0.00
5	123117	健帆转债	106	10,600.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2109	IF2109	10.00	15,499,200.00	835,800.00	
IF2112	IF2112	6.00	9,252,360.00	610,380.00	
公允价值变动总额合计					1,446,180.00
股指期货投资本期收益					-
股指期货投资本期公允价值变动					1,446,180.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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，南京银行股份有限公司、长城汽车股份有限公司、腾讯控股有限公司、招商银行股份有限公司、中国建设银行股份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	3,322,923.01
2	应收证券清算款	11,548,525.48
3	应收股利	2,114,638.15
4	应收利息	8,893.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	16,994,980.45
---	----	---------------

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688499	利元亨	83,488.65	0.01	新股流通受限
2	301018	申菱环境	64,753.19	0.01	新股流通受限
3	301017	漱玉平民	49,173.00	0.01	新股流通受限
4	301021	英诺激光	27,424.54	0.00	新股流通受限

§ 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 (%)
27,332	34,873.63	87,171,900.00	9.15	865,994,100.00	90.85

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	上海久事(集团)有限公司	48,065,700.00	5.04
2	威海市威力高档工具有限公司	15,000,000.00	1.57

3	招商证券股份有限公司	4,150,200.00	0.44
4	陆有为	4,000,000.00	0.42
5	中信证券股份有限公司	3,186,000.00	0.33
6	刘贞峰	3,160,000.00	0.33
7	中信建投证券股份有限公司	3,029,800.00	0.32
8	朴昌建	3,000,000.00	0.31
9	李静	3,000,000.00	0.31
10	厦门契合展览服务有限公司	2,999,000.00	0.31

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 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 02 月 01 日） 基金份额总额	1,089,166,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	184,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	320,000,000.00
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	953,166,000.00

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。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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 02 月 01 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	3	816,968,439.71	56.40	698,423.73	55.98	
华泰证券	2	140,245,956.94	9.68	121,549.42	9.74	

兴业证券	2	85,046,615.48	5.87	71,289.16	5.71	
安信证券	2	69,844,878.54	4.82	58,952.40	4.73	
国泰君安	2	65,531,771.36	4.52	55,395.85	4.44	
西南证券	1	57,173,585.33	3.95	45,793.16	3.67	
广发证券	1	47,743,777.71	3.30	44,464.10	3.56	
中金财富	1	42,631,216.53	2.94	39,702.44	3.18	
中金公司	2	41,744,500.29	2.88	37,671.55	3.02	
东兴证券	1	38,418,733.65	2.65	35,781.67	2.87	
东吴证券	2	14,955,841.89	1.03	14,955.92	1.20	
海通证券	2	9,810,136.83	0.68	7,879.45	0.63	
国信证券	2	5,138,436.57	0.35	4,169.02	0.33	
光大证券	1	4,286,158.65	0.30	3,991.96	0.32	
招商证券	2	2,812,625.14	0.19	2,254.74	0.18	
银河证券	3	2,205,869.00	0.15	2,054.35	0.16	
中泰证券	2	2,034,629.36	0.14	1,699.21	0.14	
国金证券	2	1,596,491.26	0.11	1,277.14	0.10	
中银国际	1	253,948.53	0.02	236.50	0.02	
北京高华	1	-	-	-	-	
财富证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	

国都证券	1	-	-	-	-	
华融证券	2	-	-	-	-	
华鑫证券	1	-	-	-	-	
上海证券	1	-	-	-	-	
申万宏源证券	1	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
中信证券华南	1	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
东方证券	70,492.69	6.86	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	24,979.98	2.43	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
西南	451,158.76	43.92	-	-	-	-	-	-

证券								
广发 证券	265,710.70	25.87	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	34,379.76	3.35	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	180,440.23	17.57	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-
北京 高华	-	-	-	-	-	-	-	-
财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券 华南	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发行文件	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 01 月 15 日
2	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金增加网下现金发售代理机构的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 01 月 20 日
3	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 01 月 22 日
4	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集期认购申请确认比例的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 02 月 01 日
5	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 02 月 02 日
6	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 02 月 10 日
7	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 02 月 10 日
8	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 02 月 10 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 02 月 20 日
10	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 02 月 22 日
11	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 03 月 31 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 03 月 31 日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金修订的招募说明书、产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 02 日

14	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 04 月 27 日
15	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 05 月 17 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加第一创业为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 05 月 19 日
17	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
18	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 06 月 28 日
19	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2021 年 06 月 29 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中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数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、报告期内汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 08 月 31 日