汇添富美丽30混合型证券投资基金2021年年度报告

2021年12月31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：2022年03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。本年度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2022年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2021年01月01日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 18
4.9 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 19
§5 托管人报告 19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 19
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 19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 19
§6 审计报告 19
6.1 审计报告的基本信息 19
6.2 审计报告的基本内容 19
§7 年度财务报表 21
7.1 资产负债表 21
7.2 利润表 22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 23
7.4 报表附注 25
§8 投资组合报告 63
8.1 期末基金资产组合情况 63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 64
8.3 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 64

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....76
8.6 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.....76
8.7 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.....76
8.8 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.....76
8.9 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.....76
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....76
8.12 投资组合报告附注.....76
§9 基金份额持有人信息.....77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....77
9.3 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.....77
§10 开放式基金份额变动.....78
§11 重大事件揭示.....78
11.1 基金份额持有人大会决议.....78
11.2 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.....78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....78
11.4 基金投资策略的改变.....78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....79
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....79
11.8 其他重大事件.....83
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....84
12.1 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.....85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....85
§13 备查文件目录.....85
13.1 备查文件目录.....85
13.2 存放地点.....85
13.3 查阅方式.....85

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富美丽30混合型证券投资基金
基金简称	汇添富美丽30混合
基金主代码	000173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年06月25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）	529,429,111.59
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选个股和集中投资，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘拥有优秀管理层、盈利能力高于行业平均水平、增长可持续且估值水平相对合理的优质上市公司，辅以严格的风险管理，以获得中长期的较高投资收益。投资策略的重点是个股精选策略。本基金的投资策略还包括：债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

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		上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		李文	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号　汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路728号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	966,651,577.65	1,270,982,142.23	406,107,967.32
本期利润	156,613,852.20	1,358,452,418.43	1,580,694,151.07
加权平均基金份额本期利润	0.2775	0.9995	0.5830
本期加权平均净值利润率	7.73%	37.08%	25.53%
本期基金份额净值增长率	2.86%	45.05%	39.60%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	1,339,352,930.90	1,803,758,357.60	2,968,844,908.57
期末可供分配基金份额利润	2.5298	2.1852	1.1822
期末基金资产净值	1,868,782,042.49	2,832,704,584.10	5,941,901,584.11
期末基金份	3.530	3.432	2.366

额净值			
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	294.47%	283.52%	164.40%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

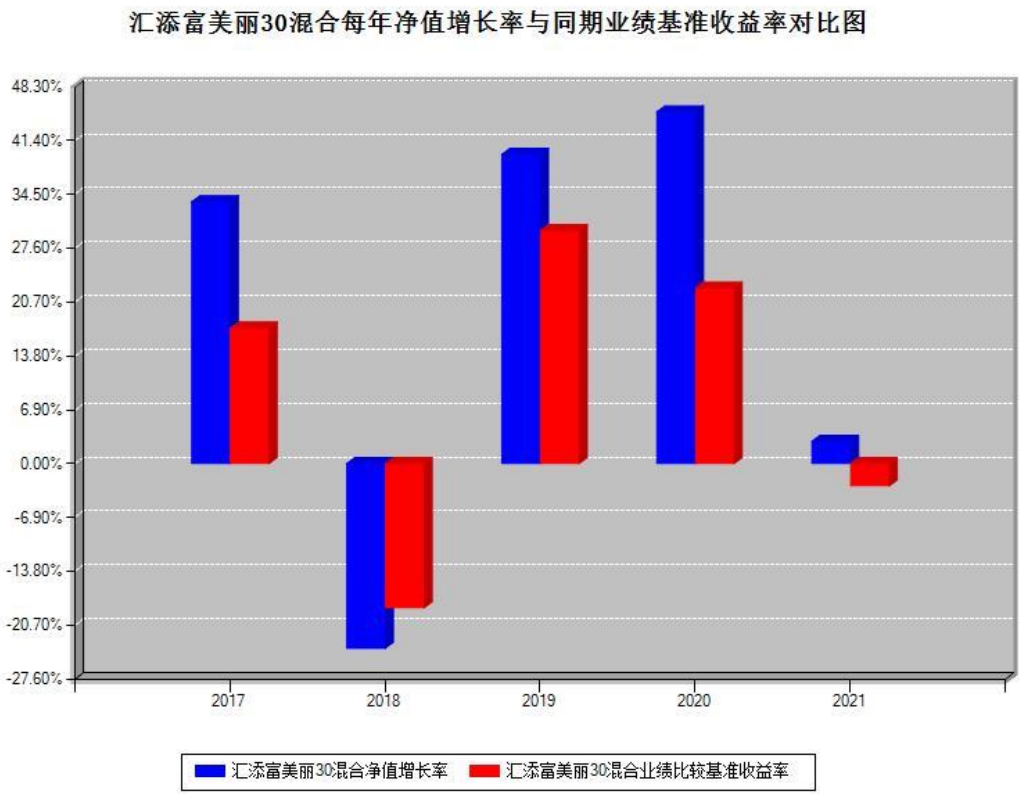
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率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
过去三个月	0.89%	1.02%	1.52%	0.63%	-0.63%	0.39%
过去六个月	-5.31%	1.39%	-3.65%	0.82%	-1.66%	0.57%
过去一年	2.86%	1.67%	-2.86%	0.94%	5.72%	0.73%
过去三年	108.27%	1.51%	54.18%	1.03%	54.09%	0.48%
过去五年	112.31%	1.43%	45.91%	0.96%	66.40%	0.47%
自基金合同生效日起至今	294.47%	1.75%	116.34%	1.15%	178.13%	0.60%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013 年 06 月 25 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本《基金合同》生效之日为 2013 年 06 月 25 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2020 年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2019 年	2.519	631,745,804.03	197,855,094.84	829,600,898.87	-
合计	2.519	631,745,804.03	197,855,094.84	829,600,898.87	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国

设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人、QFII基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

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

2021 年，汇添富基金荣获“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2021年，汇添富基金新成立58只公募基金，包括31只混合型基金，21只股票型基金，6只债券型基金。2021年底，公司公募基金产品总数达226只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2021 年，汇添富基金继续坚持重度垂直兼顾开放的互联网金融平台战略，在不断夯实自有平台基础建设、全方位提升平台架构及安全系统的基础上，持续提升自有平台创新能力。从投资的生命周期各阶段出发，通过“渐进式”的创新和打磨，创造差异化的竞争优势。业内开创性地打造基于社区的大社交板块，涵盖视频、直播、资讯等各个维度，为客户架设可链接的投资及资讯服务桥梁；推出包括资产分析、基金转购、亲情宝等在内的多个重磅功能，全方面提升客户体验。汇添富基金于年内取得投顾资格，展业后着力打造全自研的投顾体系，引导客户升级，上线一个月以来升级金额超十亿元，为公司业务拓展打下坚实的基础。全年自有平台精准营销体系初见成效，实现了客户数、活跃度、保有量的齐头并进，力争形成长期增长的良性循环。对外合作上，进一步加深与多家互联网巨头的深度战略合作，继续大力开拓新型互联网销售及服务模式，实现与平台的合作共赢。

2021 年，汇添富基金持续推进大机构战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司深受专业机构投资者信任：与银行理财公司合作深入，为银行理财净值化转型提供综合解决方案；获得所有大型银行及保险委外专户组合，且保险委托管理规模同业领先。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务规模、受托管理组合账户数量持续增加。

2021年，公司以具有长久生命力、高辨识度的多策略产品体系为基础，通过“前瞻性”、

“多层次”、“体系化”、“全方位”的渠道服务和投资者教育，积极利用银行以及券商线上化数字营销工具，力争切实做好客户触达、深入织好连接网络、扎实做好客户服务。全年合计开展超4000余场“价值投资添富行” 线上、线下系列活动。持续大力开展目标收益定投、走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列客户活动，营销培训活动覆盖至银行和券商的网点、营业部。

2021 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2021 年，香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式继续深化，并发挥显著成效，国际业务总资产管理规模稳步进步，QDII 及港股通项下公募基金业绩优秀，“港股通”类委外专户管理规模继续保持领先，海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2021年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星五星评级；根据彭博统计，基金在最近三年、五年同类港股基金中业绩分别列第三、第一位。

2021年，汇添富基金全力助推“共同富裕”，深耕“河流•孩子”项目支持中西部乡村教育发展，投身农业升级、旅游扶持、人才培育等项目赋能乡村全面振兴；同时，在河南、山西灾情发生后第一时间支援灾区抢险防汛、重建家园。在乡村教育发展方面，汇添富连续第十四年开展“河流•孩子”公益助学计划，项目组在做好疫情防护的同时积极邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”提供公益服务，并顺利开展第十四届“河流•孩子”2021 乡村优秀青年教师培训，邀请不同领域的专家为来沪的 88 名乡村青年教师和校长们讲授多元化课程。截至目前，“河流•孩子”项目先后援建10所“添富小学”， 培训乡村教师、校长超 1,400 人次，受益学生超 10,000名，累计组织80多场“添富之爱”公益行，1,000多人次志愿者提供公益服务3万多小时。在乡村产业振兴方面，汇添富先后在汾西县开展建档立卡贫困学生资助项目，支持内蒙古兴和县开展乡村旅游扶贫项目和返乡青年创业发展特色种植业项目，捐助云南省普洱市孟连县芒信镇海东村开展“千户万头”肉牛养殖场示范产业项目基础设施建设，为推动当地产业脱贫而不懈努力。在应急救灾方面，2021年7月，汇添富第一时间捐赠300万元人民币紧急驰援河南特大水灾，全力支持鹤壁、新乡等灾区抢险救灾工作；2021年10月，汇添富再次迅速展开山西水灾支援工作，紧急筹措了6000多件总价值100万元的救援物资和生活物资，连夜送至山西省临汾市、晋中市、运城市14个汛情重灾县的最前线；同时向孝义市捐赠100万元，帮助受灾地区群众尽快恢

复正常生活，以及灾区灾后重建、生产恢复、防疫消杀等工作。

2022 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

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		
王栩	本基金的基金经理,总经理助理，权益投资总监	2013 年 06 月 25 日		19	国籍：中国。学历：同济大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海永嘉投资管理有限公司研究员。2004 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任总经理助理、权益投资总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月 21 日至 2013 年 5 月 10 日任汇添富医药保健混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 7 月 10 日至 2015

					年3月31日任汇添富理财14天债券型证券投资基金的基金经理。2013年6月25日至今任汇添富美丽30混合型证券投资基金的基金经理。2019年1月18日至今任汇添富外延增长主题股票型证券投资基金的基金经理。2020年1月8日至今任汇添富大盘核心资产增长混合型证券投资基金的基金经理。2021年9月7日至今任汇添富精选核心优势一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。（2）在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。另外，公司还建立机制要求公募投资组合经理与资产管理计划投资组合经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。（3）在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。（4）在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析环节，公司按季

度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3日内、5日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行T检验。对于未通过T检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有29次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年A股市场经历了极致结构分化的一年，市场整体的波动幅度并不大，但不同风格资产、不同投资主题的表现差异巨大。全年沪深300指数下跌5.20%，中证500指数上涨15.58%，而中证1000指数、国证2000指数分别上涨了20.52%、29.19%，市值越小涨幅越大。从投资主题方面看，新能源相关产业链、受益于价格上涨的资源和中上游材料都有很好的表现，而下游行业或受疫情影响或受损于成本上涨大都表现不佳。市场表现如此分化的一

个重要原因是外部宏观环境在发生剧烈变化。新冠疫情进入第二年，仍然对市场影响巨大。首先是美联储货币政策。此前超宽松的货币政策对于通胀的作用逐步显现，各类资源品甚至包括航运价格大幅上涨，市场因此呈现出典型的“上肥下瘦”特征。而货币政策回归正常化的路线图目前尚不清晰，即便通胀率高达 7%，美联储也迟迟不愿快速加息，这也在某些阶段导致市场的大幅波动。其次是受中美关系以及国内部分行业监管政策变化的影响，海外投资者对于国内资产的预期发生了很大的变化。尽管没有准确的统计数据，但大体上可以判断海外主流投资机构大幅降低了中国资产的配置，这对于消费类资产和互联网行业的影响尤为明显。另外，在整体经济增速下行和疫情防控严格的背景下，不同行业的景气度差异很大。新能源是少数能够克服经济下行压力的高成长行业，长期可持续性也很强，因此受到投资者追捧。而部分下游行业则受到需求不振和成本上升的双重压力。分行业来看，2021 年 A 股市场表现最好的是电力设备、有色金属、采掘、化工、黑色金属、公用事业等行业，涨幅都超过 30%左右；而家用电器、非银金融、房地产、休闲服务、食品饮料、医药生物等行业表现较差，逆势下跌。

本基金 2021 年的业绩并不理想，主要原因有两个方面。一是没有很好地把握住光伏、新能源汽车的投资机会。从投资主题而言，这两个领域的机会是清晰、可把握的。我们过去的投资理念和方法中，对于商业模式确定性不高的资产是偏谨慎的。因此，尽管对于这类机会有比较清晰的判断，但在资产配置上力度不足，尤其是基本上完全错失光伏行业的投资机会。二是重点配置的偏消费类资产大多给组合造成亏损。这固然有市场风格的因素，但也反映了我们对于一些消费类企业的周期性和估值方法上认识不足。虽然如此，我们仍然坚信投资于优质资产长期一定会给持有人带来比较好的回报，原有的投资方法仅需做一些微调。截至 2021 年末，本基金依然保持超过 90%的股票资产比例，主要配置在食品饮料、TMT、医药生物和新能源汽车相关产业链。

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 2.86%。同期业绩比较基准收益率为-2.86%。

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 2022 年，我们认为市场依然存在很大的不确定性。首先，欧美发达国家已经以“流感化”的态度来对待新冠疫情，但是否会出现新的变异、是否会在 2022 年终结，目前很难得出结论。对于国内而言，今年有可能面临更大的防疫压力，对于经济整体以及相关产业的影响可能会加大。其次，全球通胀前景和美联储加息的进程也很难判断。目前市场已经将美联储 2022 年加息次数的预期上调至 5~6 次，美国 10 年期国债利率已经接近 2%，但这取决

于通胀的发展，尤其是资源品价格。相对而言，国内货币政策收缩的压力稍小一些，但可以预期的是放松的空间也不大。值得乐观的因素是国内政策对于经济的支撑。去年底的中央经济工作会议再次提及以经济建设为中心，并且高度重视2022年经济稳增长，另外政府还通过一系列公开文章和政策调整以针对性解决“预期转弱”的问题。尽管面临重重压力，我们仍然有理由对今年的经济景气度乐观一些。综合考虑上述因素，我们认为现阶段的资产配置有两个方面尤为重要。一是，在通胀压力大、流动性趋于紧缩的背景下，要控制组合整体的估值水平，可以适度增加有资源属性的低估值价值股。二是，风险防范尤为重要。除了估值因素外，在不确定性的环境下，投资者会更加重视企业的商业模式、长期发展潜力，短期基本面趋势的重要性相对降低，要避免买入短期高增长、质地一般的所谓“高成长股”。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规法务管理

深入践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，持续宣导“正直”、“客户第一”的公司价值观，不断强化公司合规文化体系建设；持续完善各项制度和流程，制定多项合规审核标准，形成多项合规管理指引，对重点业务流程实施关键风险把控，有效保障各项业务规范开展；积极为各部门提供全面的合规咨询与法务支持，加强一线合规执行；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；严格执行合规考核问责机制，认真组织和落实合规培训，不断提升全体员工的合规执业意识及合规履职能力。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、加强稽核内审工作

通过开展日常风险排查，以及对重点业务开展专项稽核检查，尽早发现业务中存在的合规问题和风险隐患，并采取防范措施，督促责任部门落实整改；对风险事件和差错事件开展稽核审查，加强问责力度，促进业务合法合规开展；实施关键岗位离任审查，督促人员勤勉尽责、合规展业；配合监管检查与会计师事务所审计工作，通过问题反馈、实施整改，进一步完善公司内部控制管理机制。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金2021年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 60466941_B29 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富美丽30混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富美丽30混合型证券投资基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富美丽30混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富美丽30混合型证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富美丽30混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富美丽30混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富美丽30混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督汇添富美丽 30 混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关

	披露的合理性。 (4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富美丽30混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富美丽 30 混合型证券投资基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	许培菁	韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2022年03月29日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富美丽30混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	134,927,326.04	160,054,144.19
结算备付金		3,117,172.34	1,695,128.64
存出保证金		546,172.25	611,423.94
交易性金融资产	7.4.7.2	1,731,441,202.63	2,666,870,367.75
其中：股票投资		1,731,441,202.63	2,666,551,251.07
基金投资		-	-
债券投资		-	319,116.68
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		18,501,581.05	23,238,919.01
应收利息	7.4.7.5	17,607.71	16,231.22

应收股利		-	-
应收申购款		3,194,670.72	1,005,079.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,891,745,732.74	2,853,491,294.13
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		16,236,716.83	-
应付赎回款		1,413,582.78	15,314,182.35
应付管理人报酬		2,417,845.21	3,514,749.39
应付托管费		402,974.21	585,791.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,279,219.88	1,133,933.02
应交税费		-	1.05
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	213,351.34	238,052.65
负债合计		22,963,690.25	20,786,710.03
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	529,429,111.59	825,434,213.22
未分配利润	7.4.7.10	1,339,352,930.90	2,007,270,370.88
所有者权益合计		1,868,782,042.49	2,832,704,584.10
负债和所有者权益总计		1,891,745,732.74	2,853,491,294.13

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值3.530元，基金份额总额529,429,111.59份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富美丽30混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
一、收入		**207,050,112.98**	**1,442,259,161.74**

1.利息收入		758,549.19	1,665,793.75
其中：存款利息收入	7.4.7.11	651,632.60	1,665,135.33
债券利息收入		106,916.59	658.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,014,929,459.20	1,347,954,662.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,006,991,366.52	1,328,142,784.20
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	1,008,254.44	636,405.22
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	6,929,838.24	19,175,473.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-810,037,725.45	87,470,276.20
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,399,830.04	5,168,428.85
减：二、费用		**50,436,260.78**	**83,806,743.31**
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	30,472,786.10	55,376,237.90
2．托管费	7.4.10.2.2	5,078,797.74	9,229,373.00
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.20	14,635,912.89	18,952,790.93
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		14.07	2.40
7．其他费用	7.4.7.21	248,749.98	248,339.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**156,613,852.20**	**1,358,452,418.43**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**156,613,852.20**	**1,358,452,418.43**

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富美丽30混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31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)	825,434,213.22	2,007,270,370.88	2,832,704,584.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	156,613,852.20	156,613,852.20
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）	-296,005,101.63	-824,531,292.18	-1,120,536,393.81
其中：1.基金申购款	219,125,954.41	571,473,139.03	790,599,093.44
2.基金赎回款	-515,131,056.04	-1,396,004,431.21	-1,911,135,487.25
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)	529,429,111.59	1,339,352,930.90	1,868,782,042.49
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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)	2,511,282,755.49	3,430,618,828.62	5,941,901,584.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,358,452,418.43	1,358,452,418.43
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）	-1,685,848,542.27	-2,781,800,876.17	-4,467,649,418.44
其中：1.基金申购款	527,789,311.07	933,006,675.06	1,460,795,986.13
2.基金赎回款	-2,213,637,853.34	-3,714,807,551.23	-5,928,445,404.57
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）	825,434,213.22	2,007,270,370.88	2,832,704,584.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富美丽30混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），原汇添富美丽30股票型证券投资基金，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[2013]611号文《关于核准汇添富美丽30股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2013年6月25日正式生效，首次设立募集规模为669,054,192.59份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据中国证券监督管理委员会于2014年8月8日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，汇添富基金管理股份有限公司决定自2015年8月5日起将本基金变更为混合基金，并相应修改本基金的《基金合同》。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、债券回购等）、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款（包括定期存款及协议存款）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。本基金的投资目标为通过精选个股和集中投资，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×80%+中证全债指

数收益率×20%。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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；

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主要包括股票投资等；

(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。

7.4.4.4 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的股票等，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。

7.4.4.5 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；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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）”。

7.4.4.9 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)其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1.在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2.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；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按红利发放日基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费；

3.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；

4.每一基金份额享有同等分配权；

5.法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	134,927,326.04	160,054,144.19
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	134,927,326.04	160,054,144.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,522,308,243.05	1,731,441,202.63	209,132,959.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,522,308,243.05	1,731,441,202.63	209,132,959.58
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,647,448,582.72	2,666,551,251.07	1,019,102,668.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	251,100.00	319,116.68	68,016.68

	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	251,100.00	319,116.68	68,016.68
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,647,699,682.72	2,666,870,367.75	1,019,170,685.03

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位： 人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	15,959.31	15,134.06
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	1,402.70	762.80
应收债券利息	-	59.26
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	245.70	275.10
合计	17,607.71	16,231.22

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位： 人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日

交易所市场应付交易费用	2,279,219.88	1,133,933.02
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,279,219.88	1,133,933.02

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,351.34	28,052.65
应付证券出借违约金	-	-
应付审计费	90,000.00	90,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
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	213,351.34	238,052.65

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	825,434,213.22	825,434,213.22
本期申购	219,125,954.41	219,125,954.41
本期赎回（以“-”号填列）	-515,131,056.04	-515,131,056.04
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	529,429,111.59	529,429,111.59

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,803,758,357.60	203,512,013.28	2,007,270,370.88
本期利润	966,651,577.65	-810,037,725.45	156,613,852.20
本期基金份额交易产生的变动数	-748,296,023.56	-76,235,268.62	-824,531,292.18
其中：基金申购款	671,526,023.77	-100,052,884.74	571,473,139.03
基金赎回款	-1,419,822,047.33	23,817,616.12	-1,396,004,431.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,022,113,911.69	-682,760,980.79	1,339,352,930.90

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
活期存款利息收入	598,863.88	1,605,432.84
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	45,288.91	43,817.70
其他	7,479.81	15,884.79
合计	651,632.60	1,665,135.33

注:“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	5,356,939,535.47	7,712,737,628.14
减：卖出股票成本总额	4,349,948,168.95	6,384,594,843.94
买卖股票差价收入	1,006,991,366.52	1,328,142,784.20

7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 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01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到	11,369,798.64	2,620,624.28

期兑付）成交总额		
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,250,695.32	1,983,600.00
减：应收利息总额	110,848.88	619.06
买卖债券差价收入	1,008,254.44	636,405.22

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,929,838.24	19,175,473.52
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	6,929,838.24	19,175,473.52

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-810,037,725.45	87,470,276.20
——股票投资	-809,969,708.77	87,402,259.52
——债券投资	-68,016.68	68,016.68
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-

3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-810,037,725.45	87,470,276.20

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
基金赎回费收入	1,399,830.04	5,168,428.85
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	1,399,830.04	5,168,428.85

7.4.7.20 交易费用

单位： 人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	14,635,912.89	18,952,790.93
银行间市场交易费用	-	-
合计	14,635,912.89	18,952,790.93

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
审计费用	90,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行费用	1,148.66	1,139.08
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	401.32	-
合计	248,749.98	248,339.08

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

经与各基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人于2022年3月7日发布公告《汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增设基金份额并修改法律文件的公告》，决定自2022年3月7日起本基金增设C类、D类基金份额。

截至财务报表批准日，除上述事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人,基金销售机构,基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（"工商银行"）	基金托管人,基金代销机构
东方证券股份有限公司（"东方证券"）	基金管理人的股东,基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	393,736,835.08	4.12	1,463,320,797.26	13.34

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
东方证券	-	-	2,509,473.68	95.76

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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01日至2021年12月31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	342,283.41	4.09	-	-
关联方名称	上年度可比期间2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	1,343,864.21	13.34	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	30,472,786.10	55,376,237.90
其中：支付销售机构的客户维护费	10,851,546.83	14,936,584.87

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

H＝E×1.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,078,797.74	9,229,373.00

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间2020年01月01日至2020年12月31日
基金合同生效日（2013年06月25日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	4,709,844.56
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	4,709,844.56
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 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01日至2021年12月31日		上年度可比期间2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	134,927,326.04	598,863.88	160,054,144.19	1,605,432.84

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
300774	倍杰特	2021年07月26日	2022年02月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	
300814	中富电路	2021年08月04日	2022年02月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	
300854	中兰环保	2021年09月08日	2022年03月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	
300994	久祺股份	2021年08月02日	2022年02月14日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	
301017	漱玉平	2021年06	2022年01	新股流	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	

	民	月23日	月05日	通受限						
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	26.06	782	6,482.78	20,378.92	
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	41.43	290	2,743.40	12,014.70	
301025	读客文化	2021年07月06日	2022年01月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	
301026	浩通科技	2021年07月08日	2022年01月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	
301027	华蓝集团	2021年07月08日	2022年01月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	
301028	东亚机械	2021年07月12日	2022年01月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	
301032	新柴股份	2021年07月15	2022年01月24	新股流通受	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	

		日	日	限						
301033	迈普医学	2021年07月15日	2022年01月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	
301036	双乐股份	2021年07月21日	2022年02月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	
301037	保立佳	2021年07月21日	2022年02月07日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	
301038	深水规院	2021年07月22日	2022年02月07日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	
301039	中集车辆	2021年07月01日	2022年01月10日	新股流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	
301041	金百泽	2021年08月02日	2022年02月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	
301046	能辉科技	2021年08月10日	2022年02月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	
30104	金	202	202	新	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	

8	鹰重工	1年08月11日	2年02月28日	股流通受限						
301049	超越科技	2021年08月17日	2022年02月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	
301052	果麦文化	2021年08月23日	2022年02月28日	新股流通受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	
301053	远信工业	2021年08月25日	2022年03月01日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	
301055	张小泉	2021年08月26日	2022年03月07日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	
301057	汇隆新材	2021年08月31日	2022年03月09日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	
301058	中粮工科	2021年09月01日	2022年03月09日	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	
301062	上海艾	2021年09	2022年03	新股流	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	

	录	月07日	月14日	通受限						
301063	海锅股份	2021年09月09日	2022年03月24日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	
301068	大地海洋	2021年09月16日	2022年03月28日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	
301069	凯盛新材	2021年09月16日	2022年03月28日	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	
301072	中捷精工	2021年09月22日	2022年03月29日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	
301073	君亭酒店	2021年09月22日	2022年03月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	
301078	孩子王	2021年09月30日	2022年04月14日	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	
301079	邵阳液压	2021年10月11	2022年04月19	新股流通受	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	

		日	日	限						
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年04月27日	新股流通受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年04月28日	新股流通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	
301091	深城交	2021年10月20日	2022年04月29日	新股流通受限	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年05月05日	新股流通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年05月05日	新股流通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	
301098	金埔园林	2021年11月04日	2022年05月12日	新股流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	
301118	恒光股份	2021年11月09日	2022年05月18日	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	
30113	招	202	202	新	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	

6	标股份	1年12月31日	2年01月11日	股流通受限						
600941	中国移动	2021年12月24日	2022年01月05日	新股流通受限	57.58	57.58	37,440	2,155,795.20	2,155,795.20	
600941	中国移动	2021年12月24日	2022年07月05日	新股流通受限	57.58	57.58	87,363	5,030,361.54	5,030,361.54	
601728	中国电信	2021年08月11日	2022年02月21日	新股流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	
688087	英科再生	2021年06月30日	2022年01月10日	新股流通受限	21.96	93.40	2,469	54,219.24	230,604.60	
688211	中科微至	2021年10月18日	2022年04月26日	新股流通受限	90.20	71.32	4,501	405,990.20	321,011.32	
688212	澳华内镜	2021年11月08日	2022年05月16日	新股流通受限	22.50	32.82	3,496	78,660.00	114,738.72	
688226	威腾电	2021年06	2022年01	新股流	6.42	15.76	2,693	17,289.06	42,441.68	

	气	月28日	月07日	通受限						
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年01月06日	新股流通受限	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	
688272	富吉瑞	2021年10月08日	2022年04月18日	新股流通受限	22.56	39.09	1,263	28,493.28	49,370.67	
688499	利元亨	2021年06月23日	2022年01月04日	新股流通受限	38.85	293.00	2,149	83,488.65	629,657.00	
688701	卓锦股份	2021年09月08日	2022年03月16日	新股流通受限	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	
603290	斯达半导	2021年11月16日	2022年05月12日	非公开发行流通受限	330.00	351.44	3,871	1,277,430.00	1,360,424.24	
7.4.12.1.2 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
					-	-	-	-	-	

7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
					-	-	-	-	-	

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2021年12月31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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末2021年12月31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。

7.4.12.4 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12月31日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注7.4.12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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	134,927,326.04	-	-	-	-	-	134,927,326.04
结算备付金	3,117,172.34	-	-	-	-	-	3,117,172.34
存出保证金	546,172.25	-	-	-	-	-	546,172.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,731,441,202.63	1,731,441,202.63
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	-	-	17,607.71	17,607.71
应收申购款	-	-	-	-	-	3,194,670.72	3,194,670.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	18,501,581.05	18,501,581.05
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	138,590,670.63	-	-	-	-	1,753,155,062.11	1,891,745,732.74
负债							
应付赎回	-	-	-	-	-	1,413,582.78	1,413,582.78

款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,417,845.21	2,417,845.21
应付托管费	-	-	-	-	-	402,974.21	402,974.21
应付证券清算款	-	-	-	-	-	16,236,716.83	16,236,716.83
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,279,219.88	2,279,219.88
应交	-	-	-	-	-	-	-

税费							
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	213,351.34	213,351.34
负债总计	-	-	-	-	-	22,963,690.25	22,963,690.25
利率敏感度缺口	138,590,670.63	-	-	-	-	1,730,191,371.86	1,868,782,042.49
上年度末2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	160,054,144.19	-	-	-	-	-	160,054,144.19
结算备	1,695,128.64	-	-	-	-	-	1,695,128.64

付金							
存出保证金	611,423.94	-	-	-	-	-	611,423.94
交易性金融资产	-	-	319,116.68	-	-	2,666,551,251.07	2,666,870,367.75
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	16,231.22	16,231.22
应收申购款	-	-	-	-	-	1,005,079.38	1,005,079.38
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	23,238,919.01	23,238,919.01
买入返售	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	162,360,696.77	-	319,116.68	-	-	2,690,811,480.68	2,853,491,294.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	15,314,182.35	15,314,182.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,514,749.39	3,514,749.39
应付托管费	-	-	-	-	-	585,791.57	585,791.57
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融	-	-	-	-	-	-	-

资产款							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,133,933.02	1,133,933.02
应交税费	-	-	-	-	-	1.05	1.05
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	238,052.65	238,052.65
负债总计	-	-	-	-	-	20,786,710.03	20,786,710.03
利率敏感度缺口	162,360,696.77	-	319,116.68	-	-	2,670,024,770.65	2,832,704,584.10

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券(不含可转换债券及可交换债券)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末2021年12月31日		上年度末2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	1,731,441,202.63	92.65	2,666,551,251.07	94.13
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	319,116.68	0.01
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	1,731,441,202.63	92.65	2,666,870,367.75	94.15

本基金的投资组合比例为：60%以上的基金资产投资于股票及存托凭证；其中投资于基金持仓比例最高的前30只股票的资产不低于非现金基金资产的80%；其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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。其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；基金持有单只中小企业私募债，其市值不得超过基金资产净值的10%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款

等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末2020年12月31日
	沪深300指数上涨5%	112,695,452.07	135,940,248.21
	沪深300指数下跌5%	-112,695,452.07	-135,940,248.21

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，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中属于第一层次的余额为人民币 1,718,978,936.99 元，属于第二层次的余额为人民币7,560,881.60元，属于第三层次的余额为人民币4,901,384.04元（于2020年12月31日，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中属于第一层次的余额为人民币2,550,477,297.02元，属于第二层次的余额为人民币21,789.54元，属于第三层次的余额为人民币116,371,281.19元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值期末余额为人民币4,901,384.04元，期初余额为人民币116,371,281.19元，本期减少人民币111,469,897.15元。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第22号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号-金融资产转移》、《企业会计准则第24号-套期会计》和《企业会计准则第37号-金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

除上述事项外，截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月29日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	1,731,441,202.63	91.53
	其中：股票	1,731,441,202.63	91.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	138,044,498.38	7.30
8	其他各项资产	22,260,031.73	1.18
9	合计	1,891,745,732.74	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	43,268.51	0.00
B	采矿业	10,463.66	0.00
C	制造业	1,244,799,224.36	66.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	69,380.16	0.00
E	建筑业	68,847.08	0.00
F	批发和零售业	88,691,357.32	4.75
G	交通运输、仓储和邮政业	41,155,263.41	2.20
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,770,310.15	4.11
J	金融业	36,170,154.40	1.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	113,131,741.25	6.05
M	科学研究和技术服务业	83,171,826.05	4.45
N	水利、环境和公共设施管理业	182,588.01	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,279.37	0.00
Q	卫生和社会工作	47,100,000.00	2.52
R	文化、体育和娱乐业	55,890.90	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,731,441,202.63	92.65

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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	600702	舍得酒业	616,000	140,016,800.00	7.49
2	000568	泸州老窖	505,800	128,407,446.00	6.87
3	002371	北方华创	280,000	97,165,600.00	5.20
4	300014	亿纬锂能	750,000	88,635,000.00	4.74
5	601888	中国中免	400,000	87,764,000.00	4.70
6	603259	药明康德	700,000	83,006,000.00	4.44
7	002484	江海股份	2,299,916	62,833,705.12	3.36
8	002475	立讯精密	1,100,000	54,120,000.00	2.90
9	688169	石头科技	66,000	53,658,000.00	2.87
10	002460	赣锋锂业	360,000	51,426,000.00	2.75
11	002044	美年健康	6,000,000	47,100,000.00	2.52
12	688008	澜起科技	550,000	46,128,500.00	2.47
13	300755	华致酒行	900,000	45,072,000.00	2.41
14	300783	三只松鼠	1,116,600	43,513,902.00	2.33
15	603027	千禾味业	1,806,000	43,488,480.00	2.33
16	003012	东鹏控股	2,999,919	41,158,888.68	2.20
17	300033	同花顺	250,000	36,145,000.00	1.93
18	002568	百润股份	600,000	35,898,000.00	1.92
19	002594	比亚迪	120,000	32,174,400.00	1.72
20	600529	山东药玻	650,000	28,535,000.00	1.53
21	300170	汉得信息	3,259,600	27,999,964.00	1.50
22	002352	顺丰控股	399,913	27,562,003.96	1.47
23	300624	万兴科	500,000	27,555,000.00	1.47

		技			
24	600399	抚顺特钢	1,100,000	27,247,000.00	1.46
25	603197	保隆科技	450,000	26,280,000.00	1.41
26	605168	三人行	150,000	25,348,500.00	1.36
27	688363	华熙生物	160,000	24,848,000.00	1.33
28	603348	文灿股份	405,500	23,685,255.00	1.27
29	688167	炬光科技	102,014	22,341,066.00	1.20
30	603290	斯达半导	53,871	20,410,424.24	1.09
31	689009	九号公司	280,000	19,619,600.00	1.05
32	603351	威尔药业	500,000	19,585,000.00	1.05
33	603919	金徽酒	500,000	19,305,000.00	1.03
34	300855	图南股份	250,000	17,622,500.00	0.94
35	300745	欣锐科技	250,000	16,050,000.00	0.86
36	300957	贝泰妮	70,853	13,623,614.84	0.73
37	603713	密尔克卫	100,000	13,478,000.00	0.72
38	000858	五 粮液	60,000	13,359,600.00	0.71
39	688036	传音控股	80,000	12,552,000.00	0.67
40	688269	凯立新材	100,000	12,500,000.00	0.67
41	002063	远光软件	1,200,000	11,928,000.00	0.64
42	603612	索通发展	500,000	10,260,000.00	0.55
43	688356	键凯科技	30,000	10,113,900.00	0.54
44	605128	上海沿浦	200,000	8,940,000.00	0.48
45	600559	老白干酒	300,000	8,382,000.00	0.45
46	600941	中国移	124,803	7,186,156.74	0.38

		动			
47	603035	常熟汽饰	300,000	5,316,000.00	0.28
48	688187	时代电气	50,000	4,100,000.00	0.22
49	688037	芯源微	10,000	1,688,000.00	0.09
50	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.09
51	688499	利元亨	2,149	629,657.00	0.03
52	688211	中科微至	4,501	321,011.32	0.02
53	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.02
54	688087	英科再生	2,469	230,604.60	0.01
55	688093	世华科技	4,595	171,393.50	0.01
56	688345	博力威	2,332	138,987.20	0.01
57	688212	澳华内镜	3,496	114,738.72	0.01
58	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
59	688272	富吉瑞	1,263	49,370.67	0.00
60	603529	爱玛科技	1,019	46,435.83	0.00
61	301053	远信工业	1,544	45,992.00	0.00
62	601156	东航物流	2,090	45,729.20	0.00
63	603324	盛剑环境	733	42,997.78	0.00
64	688226	威腾电气	2,693	42,441.68	0.00
65	300867	圣元环保	1,498	41,299.86	0.00
66	688038	中科通达	2,132	40,742.52	0.00
67	300870	欧陆通	478	40,037.28	0.00
68	688565	力源科技	2,464	39,916.80	0.00
69	688681	科汇股份	1,899	38,245.86	0.00
70	300910	瑞丰新	474	37,848.90	0.00

		材			
71	605305	中际联合	368	35,434.72	0.00
72	001213	中铁特货	5,818	35,257.08	0.00
73	605089	味知香	370	35,094.50	0.00
74	688067	爱威科技	1,259	35,012.79	0.00
75	300869	康泰医学	862	34,954.10	0.00
76	605507	国邦医药	1,202	34,653.66	0.00
77	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.00
78	601921	浙版传媒	3,154	30,373.02	0.00
79	300872	天阳科技	871	29,056.56	0.00
80	301039	中集车辆	2,140	26,795.72	0.00
81	605555	德昌股份	655	26,724.00	0.00
82	300871	回盛生物	927	26,400.96	0.00
83	605020	永和股份	850	26,095.00	0.00
84	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
85	300911	亿田智能	309	25,313.28	0.00
86	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
87	601528	瑞丰银行	2,230	25,154.40	0.00
88	605167	利柏特	2,471	24,339.35	0.00
89	001217	华尔泰	1,239	23,925.09	0.00
90	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
91	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00
92	605296	神农集团	569	22,936.39	0.00
93	603171	税友股份	637	22,422.40	0.00

94	300878	维康药业	401	21,164.78	0.00
95	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
96	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
97	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
98	001216	华瓷股份	1,178	19,684.38	0.00
99	603836	海程邦达	733	19,241.25	0.00
100	603759	海天股份	1,119	19,101.33	0.00
101	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
102	603213	镇洋发展	799	18,504.84	0.00
103	300891	惠云钛业	1,143	18,299.43	0.00
104	605162	新中港	1,377	17,570.52	0.00
105	605056	咸亨国际	933	17,521.74	0.00
106	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
107	001215	千味央厨	295	17,171.95	0.00
108	300986	志特新材	264	16,898.64	0.00
109	300909	汇创达	386	16,617.30	0.00
110	300898	熊猫乳品	496	16,417.60	0.00
111	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
112	605098	行动教育	289	16,279.37	0.00
113	300997	欢乐家	928	16,082.24	0.00
114	300968	格林精密	1,162	15,977.50	0.00
115	300614	百川畅银	329	15,792.00	0.00
116	605016	百龙创园	445	15,623.95	0.00
117	605277	新亚电	507	15,448.29	0.00

		子			
118	300908	仲景食品	285	15,447.00	0.00
119	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
120	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.00
121	605289	罗曼股份	379	15,197.90	0.00
122	003029	吉大正元	716	15,071.80	0.00
123	001207	联科科技	682	14,922.16	0.00
124	001206	依依股份	321	14,894.40	0.00
125	300877	金春股份	569	14,458.29	0.00
126	300884	狄耐克	749	14,395.78	0.00
127	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
128	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
129	605378	野马电池	473	13,650.78	0.00
130	300933	中辰股份	1,112	13,588.64	0.00
131	605180	华生科技	384	13,555.20	0.00
132	300967	晓鸣股份	507	13,516.62	0.00
133	603048	浙江黎明	464	13,456.00	0.00
134	605567	春雪食品	629	13,397.70	0.00
135	605566	福莱蕙特	435	13,350.15	0.00
136	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
137	605599	菜百股份	980	13,190.80	0.00
138	002997	瑞鹄模具	751	13,187.56	0.00
139	603511	爱慕股	553	13,117.16	0.00

		份			
140	605319	无锡振华	764	12,957.44	0.00
141	300942	易瑞生物	443	12,784.98	0.00
142	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
143	605196	华通线缆	1,172	12,575.56	0.00
144	605300	佳禾食品	576	12,401.28	0.00
145	605365	立达信	645	12,364.65	0.00
146	300996	普联软件	386	12,193.74	0.00
147	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
148	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
149	300943	春晖智控	255	11,801.40	0.00
150	300993	玉马遮阳	410	11,771.10	0.00
151	300966	共同药业	286	11,731.72	0.00
152	605069	正和生态	608	11,685.76	0.00
153	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
154	300962	中金辐照	576	11,422.08	0.00
155	605033	美邦股份	423	11,298.33	0.00
156	605488	福莱新材	416	11,119.68	0.00
157	605011	杭州热电	525	11,056.50	0.00
158	001210	金房节能	311	11,037.39	0.00
159	300892	品渥食品	272	11,021.44	0.00
160	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
161	003042	中农联合	420	10,878.00	0.00

162	003002	壶化股份	921	10,830.96	0.00
163	605189	富春染织	422	10,625.96	0.00
164	605580	恒盛能源	654	10,614.42	0.00
165	300876	蒙泰高新	350	10,594.50	0.00
166	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
167	605086	龙高股份	443	10,463.66	0.00
168	300930	屹通新材	322	10,445.68	0.00
169	605287	德才股份	349	9,991.87	0.00
170	300945	曼卡龙	474	9,968.22	0.00
171	001212	中旗新材	308	9,951.48	0.00
172	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
173	605259	绿田机械	295	9,838.25	0.00
174	300971	博亚精工	245	9,787.75	0.00
175	301012	扬电科技	191	9,672.24	0.00
176	003036	泰坦股份	776	9,606.88	0.00
177	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
178	300889	爱克股份	479	9,263.86	0.00
179	300879	大叶股份	466	9,212.82	0.00
180	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
181	300950	德固特	219	9,143.25	0.00
182	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
183	605598	上海港湾	553	8,809.29	0.00
184	001209	洪兴股份	321	8,756.88	0.00
185	605138	盛泰集	723	8,733.84	0.00

		团			
186	003041	真爱美家	349	8,690.10	0.00
187	605577	龙版传媒	588	8,625.96	0.00
188	001202	炬申股份	459	8,551.17	0.00
189	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
190	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
191	003003	天元股份	756	8,391.60	0.00
192	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
193	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
194	300958	建工修复	300	8,103.00	0.00
195	300952	恒辉安防	340	7,956.00	0.00
196	300948	冠中生态	324	7,944.48	0.00
197	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
198	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
199	300955	嘉亨家化	232	7,625.84	0.00
200	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
201	301068	大地海洋	236	6,904.68	0.00
202	300972	万辰生物	430	6,815.50	0.00
203	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
204	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
205	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
206	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
207	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
208	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00

209	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
210	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
211	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
212	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
213	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
214	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.00
215	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
216	300992	泰福泵业	200	4,950.00	0.00
217	300929	华骐环保	183	4,904.40	0.00
218	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
219	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
220	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
221	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
222	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
223	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
224	300863	卡倍亿	21	1,883.07	0.00
225	003009	中天火箭	23	1,420.71	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600702	舍得酒业	176,377,097.79	6.23
2	000568	泸州老窖	140,571,842.31	4.96
3	002460	赣锋锂业	102,118,583.03	3.60
4	688363	华熙生物	89,374,497.35	3.16

5	300142	沃森生物	82,542,355.51	2.91
6	002371	北方华创	81,493,407.37	2.88
7	600111	北方稀土	80,097,810.74	2.83
8	000762	西藏矿业	80,002,966.00	2.82
9	300390	天华超净	75,780,336.12	2.68
10	600588	用友网络	72,889,509.74	2.57
11	603882	金域医学	66,472,149.55	2.35
12	000983	山西焦煤	53,897,066.16	1.90
13	002568	百润股份	53,224,244.32	1.88
14	603290	斯达半导	52,563,949.00	1.86
15	002484	江海股份	50,400,696.24	1.78
16	002475	立讯精密	50,353,154.22	1.78
17	688180	君实生物	50,084,935.11	1.77
18	300624	万兴科技	49,651,744.48	1.75
19	000516	国际医学	49,329,100.81	1.74
20	300783	三只松鼠	46,633,759.64	1.65

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	280,904,731.90	9.92
2	002466	天齐锂业	239,147,809.63	8.44
3	600588	用友网络	217,904,213.19	7.69
4	000858	五 粮 液	180,169,594.09	6.36
5	603259	药明康德	164,892,338.25	5.82
6	300413	芒果超媒	147,825,175.40	5.22
7	000786	北新建材	138,006,253.72	4.87
8	002044	美年健康	132,880,751.42	4.69
9	000762	西藏矿业	117,027,956.09	4.13
10	300014	亿纬锂能	115,701,217.58	4.08
11	603027	千禾味业	115,089,502.07	4.06
12	601888	中国中免	112,305,108.58	3.96
13	600702	舍得酒业	104,512,824.66	3.69
14	002847	盐津铺子	100,118,013.12	3.53
15	300390	天华超净	92,654,766.00	3.27
16	600111	北方稀土	89,953,313.75	3.18
17	000799	酒鬼酒	87,190,907.49	3.08
18	603882	金域医学	82,260,263.53	2.90
19	688169	石头科技	73,123,482.43	2.58

20	300285	国瓷材料	68,311,700.32	2.41
21	300142	沃森生物	67,509,575.13	2.38
22	002127	南极电商	65,127,828.45	2.30

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。

8.4.3 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	4,234,228,960.92
卖出股票收入（成交）总额	5,356,939,535.47

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、中国银保监会及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

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。

8.12.3 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	546,172.25
2	应收证券清算款	18,501,581.05
3	应收股利	-
4	应收利息	17,607.71
5	应收申购款	3,194,670.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,260,031.73

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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（%）
92,203	5,741.99	51,770,433.85	9.78	477,658,677.74	90.22

9.2 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	96,664.93	0.02

9.3 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年06月25日）基金份额总额	669,054,192.59
本报告期期初基金份额总额	825,434,213.22
本报告期基金总申购份额	219,125,954.41
减：本报告期基金总赎回份额	515,131,056.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	529,429,111.59

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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

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。

11.3 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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 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（2013年06月25日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币90,000.00元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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（%）	
广发证券	1	1,214,761,599.06	12.71	1,066,725.25	12.75	
兴业证券	2	1,148,353,209.04	12.02	1,059,579.95	12.66	
中泰证券	2	992,202,633.36	10.39	825,177.33	9.86	
东吴证券	2	907,408,630.07	9.50	733,137.34	8.76	
华泰证券	2	670,222,693.17	7.02	544,264.66	6.50	
安信证券	2	590,287,757.36	6.18	538,056.26	6.43	
海通证券	2	457,564,745.07	4.79	418,252.90	5.00	
东兴证券	1	430,460,128.09	4.51	377,644.70	4.51	
西南证券	1	404,984,317.60	4.24	369,061.98	4.41	
东方证券	4	393,736,835.08	4.12	342,283.41	4.09	
国金证券	2	336,139,706.09	3.52	275,311.38	3.29	
国信	2	271,698,952.22	2.84	250,619.18	3.00	

证券						
光大证券	1	233,341,740.65	2.44	217,310.65	2.60	
长江证券	1	205,625,167.43	2.15	157,677.70	1.88	
中金公司	2	193,693,704.07	2.03	177,238.24	2.12	
国泰君安	2	169,698,285.42	1.78	155,483.51	1.86	
方正证券	1	146,918,836.10	1.54	131,286.59	1.57	
国都证券	1	119,989,149.94	1.26	111,875.63	1.34	
中金财富	1	110,806,278.11	1.16	103,193.62	1.23	
中银国际	1	109,702,138.24	1.15	102,164.92	1.22	
北京高华	1	98,398,180.25	1.03	91,638.38	1.10	
上海证券	1	83,463,252.63	0.87	77,726.12	0.93	
银河证券	3	74,477,522.66	0.78	69,423.60	0.83	
申万宏源证券	1	61,894,982.83	0.65	57,643.32	0.69	
中信建投证券	1	44,746,877.97	0.47	37,110.14	0.44	
华鑫证券	1	38,386,497.32	0.40	35,749.57	0.43	
长城证券	1	34,757,473.81	0.36	32,369.74	0.39	
招商证券	2	10,336,891.00	0.11	9,419.93	0.11	
财信证券	1	-	-	-	-	
华融证券	2	-	-	-	-	
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。

11.7.2 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（%）
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	126,250.00	1.00	-	-	-	-	-	-
中泰证券	1,239,993.17	9.87	-	-	-	-	-	-
东吴证券	189,004.51	1.50	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	4,081,495.13	32.48	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	5,061,556.40	40.28	-	-	-	-	-	-
西南证券	1,866,549.00	14.86	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告	上交所,上证报,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年01月09日
2	汇添富基金旗下164只基金2020年4季度报告	上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年01月22日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年02月08日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2020年年度报告	上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年03月30日
5	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,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年04月20日

6	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年04月21日
7	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,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年04月22日
8	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,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年06月24日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2021年第2季度报告	上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年07月21日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于获准设立子公司的公告	上交所,上证报,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年08月26日
11	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2021年中期报告	上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年08月31日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于变更直销中心银行账户信息的公告	上交所,上证报,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年09月16日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于本公司及上海分公司办公地址变更的公告	上交所,上证报,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年10月09日
14	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2021年第3季度报告	上交所,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年10月27日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金获配非公开发行股票的公告	上交所,上证报,公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年11月18日
16	关于汇添富基金管理股份有限公司投顾业务中通过投资者投顾账户交易本公司旗下基金免除相关费用的公告	上交所,上证报,公司网站及中国证监会基金电子披露网站,深交所	2021年12月23日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富美丽30股票型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富美丽30混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富美丽30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、报告期内汇添富美丽30混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路728号　汇添富基金管理股份有限公司

13.3 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

2022年03月31日