汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金
2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....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.....10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....16
§5 托管人报告.....16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....16
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....16
6.1 资产负债表.....16
6.2 利润表.....18
6.3 净资产（基金净值）变动表.....19
6.4 报表附注.....21
§7 投资组合报告.....53
7.1 期末基金资产组合情况.....53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....62
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.....63
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.....63
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.....63
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.....63

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....63
7.12 投资组合报告附注.....63
§8 基金份额持有人信息.....64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....65
§9 开放式基金份额变动.....66
§10 重大事件揭示.....66
10.1 基金份额持有人大会决议.....66
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.....66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....66
10.4 基金投资策略的改变.....66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....67
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.....67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....67
10.8 其他重大事件.....70
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....71
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.....72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....72
§12 备查文件目录.....72
12.1 备查文件目录.....72
12.2 存放地点.....72
12.3 查阅方式.....72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金		
基金简称	汇添富盈鑫混合		
基金主代码	002420		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019 年 03 月 19 日		
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额（份）	565,107,563.02		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇添富盈鑫混合 A	汇添富盈鑫混合 C	汇添富盈鑫混合 D
下属分级基金的交易代码	002420	014833	014834
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	359,894,690.04	92,780,332.12	112,432,540.86

注：本基金于 2022 年 1 月 17 日新增 C 类、D 类份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过积极主动的资产配置，充分挖掘各大类资产投资机会，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、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、融资投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号　汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路728号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日 - 2022年06月30日)		
	汇添富盈鑫混合A	汇添富盈鑫混合C	汇添富盈鑫混合D
本期已实现收益	-117,472,712.18	-66,960.56	-5,789,478.02
本期利润	11,559,854.21	1,475,530.97	65,438,747.40
加权平均基金份额本期利润	0.0344	0.3094	1.2739
本期加权平均净值利润率	2.06%	17.99%	77.52%
本期基金份额净值增长率	3.85%	14.82%	14.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年06月30日)		

期末可供分配利润	331,278,894.11	85,101,769.57	103,375,212.93
期末可供分配基金份额利润	0.9205	0.9172	0.9194
期末基金资产净值	757,219,849.02	194,809,011.30	236,394,724.73
期末基金份额净值	2.104	2.100	2.103
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 06 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	87.36%	14.82%	14.60%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富盈鑫混合 A						
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	29.08%	2.00%	4.61%	0.53%	24.47%	1.47%
过去三个月	32.66%	2.43%	3.37%	0.71%	29.29%	1.72%
过去六个月	3.85%	2.39%	-4.24%	0.73%	8.09%	1.66%
过去一年	1.69%	2.13%	-6.06%	0.62%	7.75%	1.51%
过去三	77.25%	1.64%	11.84%	0.63%	65.41%	1.01%

年						
自基金合同生效日起至今	87.36%	1.59%	11.63%	0.64%	75.73%	0.95%
汇添富盈鑫混合 C						
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	29.07%	2.01%	4.61%	0.53%	24.46%	1.48%
过去三个月	32.58%	2.44%	3.37%	0.71%	29.21%	1.73%
自基金合同生效日起至今	14.82%	2.34%	-3.18%	0.75%	18.00%	1.59%
汇添富盈鑫混合 D						
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	29.10%	2.01%	4.61%	0.53%	24.49%	1.48%
过去三个月	32.60%	2.44%	3.37%	0.71%	29.23%	1.73%
自基金合同生效日起至今	14.60%	2.33%	-2.65%	0.75%	17.25%	1.58%

3.2.2 自基金转型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

汇添富盈鑫混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

汇添富盈鑫混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

注：1、本基金由原汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金于 2019 年 3 月 19 日转型而来。2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3、本基金于 2022 年 1 月 17 日新增 C、D 类份额，新增份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§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。

汇添富基金自成立以来，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。

2022 上半年，汇添富基金新成立 26 只公开募集证券投资基金，包括 11 只股票型基金、11 只混合型基金、4 只债券型基金。截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 252 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
刘昇	本基金的基金经理	2021 年 09 月 28 日		7	国籍：中国。学历：浙江大学电气工程专业博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 7 月至今历任汇添富基金管理股份有限公司助理行业分析师、行业分析师，现任高级行业分析师。2021 年 9 月 28 日至今任汇添富盈鑫灵活配置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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 18 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

本基金主要聚焦能源转型领域的投资机会，如光、储、车、风、电网、半导体、公用事业、氢能等方向，并适度关注其他领域的逆向、低估值机会。本基金的组合构建策略仍然坚持个股适度集中、实时动态调整的原则。

本基金的选股思路主要包括以下三个方向：

1）5-10 年业绩有望成长 5-10 倍的公司，这是本基金重点布局的战略方向。这些公司一般具备空间大、增速快、顺应时代大势、商业模式清晰、格局相对清晰、竞争优势可持续、企业质地优秀等特征；

2）逆向的投资机会。这种投资机会的一般特点是：行业和公司长期前景光明，但短期基本面、股价承压；

3）基本面驱动的低估值重估投资机会。这种机会的一般特点是：过往的行业或公司基本面预期过于悲观，但后来基本面发生重大变化驱动业绩和估值戴维斯双击。

年初以来的光储板块的调整主要是随着全市场的成长股一起被杀估值、杀业绩，而非杀逻辑，光储行业的长、中、短期逻辑都在强化，且相对其他行业的增速有比较优势。很多高成长公司的估值在一季度已经调整到风险收益比较好的位置，4 月份新能源一季报业绩压力释放完毕后，后续板块反弹较多。

组合保持较高仓位运行，期间主要操作：

1）在下跌过程中增持了高景气度有望持续强劲的“分布式光储”产业链。

2）减持了部分业绩有压力、盈利预期较饱满、估值偏高、盈利能力周期向下的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富盈鑫混合 A 类份额净值增长率为 3.85%，同期业绩比较基准收益率为-4.24%。本报告期新增汇添富盈鑫混合 C 类份额，自实际有资产之日起至报告期末基金份额净值增长率为 14.82%。同期业绩比较基准收益率为-3.18%。本报告期内新增汇添富盈鑫混合 D 类份额，自实际有资产之日起至报告期末的净值增长率为 14.60%，同期业绩比较基准收益率为-2.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

“光伏+储能”行业 2021 年体现出了很强的韧性，2022 年有望体现出很强的弹性，2023 年有望在模糊的预期中不断超预期，未来仍是一个长期高速成长的行业。2021 年是光伏行业首年实现“量价齐升”的质变一年（过往十年都是“价跌量升”），组件价格从 2021 年初 1.7 元/w 一路涨到年底约 2.0 元/w，全球光伏新增装机需求却逆势强韧地增长了 25%。2022、

2023 年全球光伏新增装机需求有望连续两年保持高增长，较过往十年行业 22%左右的复合增速大上台阶，且有进一步超预期的可能性。此外，还很重要的一点是行业需求结构正在发生长趋势的有利变化，以分布式为代表的高端市场迅速崛起，叠加“光伏—>光储”的产品形态升级，有望带来全产业链的价值量和利润空间大幅提升。

对光储行业未来半年、一年、三年、五年的需求前景都持乐观态度，部分环节也有望长期保持向好的竞争格局。二季度开始，“户用光储”业务占比高的公司（主要是逆变器环节的公司）有望在订单、收入、业绩上体现出高景气度。

驱动光储行业的底层逻辑已显著强化升级，随着全球能源短缺问题越发显现，全球有望迎来再一轮对清洁能源（光伏、储能、风电、电网等）的认知重塑、定价重估、政策加码、需求增长。发展光伏这个事对于全球各国来说过去还只是个事关 “永续发展”（碳中和）的问题，这次俄乌地缘冲突以后升级为事关“生死存亡”（能源安全和独立）的问题，各国的光储政策力度、需求强度、价格接受度后续都有望进一步大大加强。

光储行业的几大核心驱动力在显著不断强化，还处于蓬勃生长的青春期。光伏行业是一个过去“十年八倍”的产业，即全球光伏新增装机从 2010 年约 16GW 增长到 2020 年约 130GW，十年翻了约八倍多，十年复合增速约 22%。有人以线性思维判断光伏行业即将进入平稳增长期甚至瓶颈期，因为大部分行业的典型增长模式都是越大越慢。但我们认为光伏仍是一个未来有望“十年高成长”的非典型朝阳行业，且未来十年行业复合增速中枢有望较过去十年抬升。底层逻辑是因为我们观察到几大行业驱动力在不断强化——全球光伏低价上网、全球碳中和加速、全球能源短缺涨价、全球能源独立加速、行业产能加速扩张。而且，光伏虽然已经快速发展了十多年，但至今占全球发电量的比例仍然很低，还处于蓬勃生长的青春期。

此外，不必担心未来所谓“全球碳中和纠偏”、“全球碳中和不搞了”的论调。本轮全球能源短缺有两方面本质原因：一方面以光伏、风电、储能为代表的新能源发展太慢，另一方面以煤炭、天然气为代表的旧能源退出太快。未来各国推进碳中和的方式都会更加科学：各国对于新能源发展的力度毫无放松迹象，而且在不断加码，但各国对于旧能源的退出未来会更加有序，不会再用“一刀切”的方式。我们要清醒的认识到，旧能源有序退出并非是挤占新能源的发展空间，而是为新能源更快更好发展提供了更强的必要支撑，也是增强能源体系安全的必要做法。未来，市场对于碳中和路径的认识也有望从混乱逐步走向理性，在未来一段时间内，新旧能源并非此消彼长的关系，而是相辅相成、并举共进的关系。

我们清醒的认识到，虽然全球能源转型的产业大势仍在强劲推进，但能源转型领域的股票投资难度是在加大的。过去三年新能源行业经历了宏观宽松、业绩高增、估值扩张的高度

繁荣期，后续想再赚估值扩张的钱已比较困难，只有沉下心扎扎实实赚企业业绩高质量持续成长的钱。下个阶段更要进一步精选个股，真正做到去伪存真、精益求精、业绩为王、重视估值。

从较长的历史表现来看，市场风格变化是较短期的、难以捉摸的，但企业长期价值由企业长期基本面决定，本基金应对市场风格变化的策略是：用更长期的基本面深入研究和长期投资策略来应对中短期市场风格的变化，赚企业长期成长的钱，靠企业的长期业绩成长穿越市场风格变化的中短周期。在板块急跌过程中，更加考验投资人员对所投公司长期基本面的研究深度，如果一家公司的长期竞争优势、成长空间等核心基本面没有变化，则短期景气度趋势走弱、股价下跌的时候都是很好的加仓良机。

组合将继续聚焦“光伏+储能”产业链，不断研究挖掘顺应时代大势、管理层优秀、商业模式良好、竞争优势突出、长期成长性良好、估值具有吸引力的个股，适度做逆向布局，以期实现可预期的长期投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2022 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：汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	6.4.7.1	66,392,716.48	50,917,313.95
结算备付金		2,100,028.27	2,118,449.63
存出保证金		349,118.88	123,642.57
交易性金融资产	6.4.7.2	1,122,881,069.56	639,163,473.44
其中：股票投资		1,122,613,431.84	639,163,473.44
基金投资		-	-
债券投资		267,637.72	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	1,320,042.68
应收股利		-	-
应收申购款		32,176,625.03	108,152.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	7,166.32
资产总计		1,223,899,558.22	693,758,240.59
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2022 年 06 月 30 日**	**上年度末 2021 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		19,944,018.82	14,055,139.60
应付赎回款		13,065,363.74	88,331.17
应付管理人报酬		984,757.31	788,420.23
应付托管费		164,126.21	131,403.35
应付销售服务费		35,952.51	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.29	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,281,753.29	1,292,655.31
负债合计		35,475,973.17	16,355,949.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	565,107,563.02	334,384,051.31
未分配利润	6.4.7.9	623,316,022.03	343,018,239.62

净资产合计		1,188,423,585.05	677,402,290.93
负债和净资产总计		1,223,899,558.22	693,758,240.59

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 565,107,563.02 份。本基金下属 A 类基金份额净值 2.104 元，基金份额总额 359,894,690.04 份；本基金下属 C 类基金份额净值 2.100 元，基金份额总额 92,780,332.12 份；本基金下属 D 类基金份额净值 2.103 元，基金份额总额 112,432,540.86 份。

比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年末”余额。

6.2 利润表

会计主体：汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
一、营业总收入		**84,231,806.61**	**35,948,092.19**
1.利息收入		126,650.85	45,548.31
其中：存款利息收入	6.4.7.10	126,650.85	45,424.40
债券利息收入		-	123.91
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）		-121,203,823.86	39,661,664.03
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-123,160,567.01	38,894,759.82
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	57,586.32	61,657.27
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,899,156.83	705,246.94
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.18	201,803,283.34	-3,953,004.49

“-”号填列）			
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	3,505,696.28	193,884.34
减：二、营业总支出		**5,757,674.03**	**2,767,093.97**
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	4,772,333.23	1,946,046.33
2．托管费	6.4.10.2.2	795,388.92	324,341.08
3．销售服务费		86,512.78	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7．税金及附加		0.54	0.35
8．其他费用	6.4.7.21	103,438.56	496,706.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**78,474,132.58**	**33,180,998.22**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**78,474,132.58**	**33,180,998.22**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**78,474,132.58**	**33,180,998.22**

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	334,384,051.31	343,018,239.62	677,402,290.93
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	334,384,051.31	343,018,239.62	677,402,290.93
三、本期增减变	230,723,511.71	280,297,782.41	511,021,294.12

动额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	78,474,132.58	78,474,132.58
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	230,723,511.71	201,823,649.83	432,547,161.54
其中：1.基金申购款	432,586,370.11	334,953,044.33	767,539,414.44
2.基金赎回款	-201,862,858.40	-133,129,394.50	-334,992,252.90
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	565,107,563.02	623,316,022.03	1,188,423,585.05

项目	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	158,499,259.67	133,188,635.67	291,687,895.34
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	158,499,259.67	133,188,635.67	291,687,895.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-38,628,218.63	-5,039,938.54	-43,668,157.17
（一）、综合收益总额	-	33,180,998.22	33,180,998.22
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-38,628,218.63	-38,220,936.76	-76,849,155.39
其中：1.基金申购款	3,681,724.84	3,495,513.32	7,177,238.16
2.基金赎回款	-42,309,943.47	-41,716,450.08	-84,026,393.55

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	119,871,041.04	128,148,697.13	248,019,738.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），是由汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金变更而来。原汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金，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[2016]194 号文《关于准予汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》的准予注册，由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 2016 年 3 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 4,849,549,217.33 份基金份额。

汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金于 2019 年 3 月 11 日第一个保本周期到期，由于不符合保本基金存续条件，按照《汇添富盈鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，该基金保本周期到期后转型为非保本的混合基金，名称相应变更为“汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金”，该变更无须基金份额持有人大会决议。2019 年 3 月 19 日（基金合同生效日），《汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效，基金合同生效日的规模为 509,816,875.73 份基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自 2022 年 1 月 17 日起，本基金增设 C 类和 D 类份额类别，原基金份额变更为 A 类基金份额，基金注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括

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(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、股票期权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)。本基金参与融资业务。在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过积极主动的资产配置，充分挖掘各大类资产投资机会，力争实现基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

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（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金

流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生

违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 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)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益 ，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益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；

(7)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扣除适用情况下的相关税费后的净额，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，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8)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。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 50,917,313.95 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 6,157.32 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 50,923,471.27 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,118,449.63 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 953.30 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,119,402.93 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 123,642.57 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 55.70 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 123,698.27 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,166.32 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 6,157.32 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 953.30 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 55.70 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影

响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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

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。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金

的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（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。

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。

5. 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基

金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
活期存款	66,392,716.48
等于：本金	66,386,091.23
加：应计利息	6,625.25
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	66,392,716.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		910,841,117.68	-	1,122,613,431.84	211,772,314.16
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	194,000.00	150.52	267,637.72	73,487.20
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-

合计	194,000.00	150.52	267,637.72	73,487.20
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	911,035,117.68	150.52	1,122,881,069.56	211,845,801.36

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5.40
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,107,445.33
其中：交易所市场	1,107,445.33
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	114,795.19
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-

应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	1,281,753.29

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富盈鑫混合 A		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	334,384,051.31	334,384,051.31
本期申购	136,541,844.71	136,541,844.71
本期赎回（以“-”号填列）	-111,031,205.98	-111,031,205.98
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	359,894,690.04	359,894,690.04
汇添富盈鑫混合 C		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	112,195,477.68	112,195,477.68
本期赎回（以“-”号填列）	-19,415,145.56	-19,415,145.56
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	92,780,332.12	92,780,332.12
汇添富盈鑫混合 D		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	-	-
本期申购	183,849,047.72	183,849,047.72
本期赎回（以“-”号填列）	-71,416,506.86	-71,416,506.86
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	112,432,540.86	112,432,540.86

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富盈鑫混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	425,553,501.05	-82,535,261.43	343,018,239.62
本期利润	-117,472,712.18	129,032,566.39	11,559,854.21
本期基金份额交易产生的变动数	23,198,105.24	19,548,959.91	42,747,065.15
其中：基金申购款	135,850,331.09	-27,680,013.18	108,170,317.91
基金赎回款	-112,652,225.85	47,228,973.09	-65,423,252.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	331,278,894.11	66,046,264.87	397,325,158.98
汇添富盈鑫混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-66,960.56	1,542,491.53	1,475,530.97
本期基金份额交易产生的变动数	85,168,730.13	15,384,418.08	100,553,148.21
其中：基金申购款	104,713,542.24	3,897,344.05	108,610,886.29
基金赎回款	-19,544,812.11	11,487,074.03	-8,057,738.08
本期已分配利润	-	-	-

本期末	85,101,769.57	16,926,909.61	102,028,679.18
汇添富盈鑫混合 D			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-5,789,478.02	71,228,225.42	65,438,747.40
本期基金份额交易产生的变动数	109,164,690.95	-50,641,254.48	58,523,436.47
其中：基金申购款	174,014,770.14	-55,842,930.01	118,171,840.13
基金赎回款	-64,850,079.19	5,201,675.53	-59,648,403.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	103,375,212.93	20,586,970.94	123,962,183.87

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	106,251.60
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	17,972.73
其他	2,426.52
合计	126,650.85

注:“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,143,759,496.06
减：卖出股票成本总额	1,263,572,528.81
减：交易费用	3,347,534.26
买卖股票差价收入	-123,160,567.01

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	891.42
债券投资收益——买卖债券差价收入	56,694.90
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	57,586.32

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,664,420.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,527,333.00
减：应计利息总额	80,383.85
减：交易费用	9.06
买卖债券差价收入	56,694.90

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,899,156.83
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	1,899,156.83

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
1.交易性金融资产	201,803,283.34
——股票投资	201,729,796.14
——债券投资	73,487.20
——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	201,803,283.34

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	3,505,696.28
替代损益	-
其他	-
合计	3,505,696.28

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行费用	536.00
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	103,438.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	108,236,849.13	4.04	2,886,856.00	1.37

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	82,799.77	4.25	717.96	0.06
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 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	2,630.81	1.36	-	-

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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,772,333.23	1,946,046.33
其中：支付销售机构的客户维护费	574,167.22	690,697.65

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。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首日起 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	795,388.92	324,341.08

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。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首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	汇添富盈鑫混合 A	汇添富盈鑫混合 C	汇添富盈鑫混合 D	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	9,082.11	72,114.01	81,196.12
合计	-	9,082.11	72,114.01	81,196.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	汇添富盈鑫混合 A	汇添富盈鑫混合 C	汇添富盈鑫混合 D	合计
合计	-	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40%年费率计提，D 类基金份额的销售服务费按前一日 D 类基金份额资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×基金销售服务费年费率÷当年天数

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	66,392,716.48	106,251.60	25,120,062.55	44,056.50

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位:股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022年01月06日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	352	19,560.64	10,570.56	
301103	何氏眼科	2022年03月14日	6个月	新股流通受限	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	
301109	军信股份	2022年04月06日	6个月	新股流通受限	23.20	16.14	1,187	27,534.71	19,158.18	
301110	青木	2022年	6个	新股	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	

	股份	03月04日	月	流通受限						
301116	益客食品	2022年01月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	
301117	佳缘科技	2022年01月07日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	
301123	奕东电子	2022年01月14日	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	463	17,237.49	11,755.57	
301135	瑞德智能	2022年04月01日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	
301148	嘉戎技术	2022年04月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	
301162	国能日新	2022年04月19日	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	
301181	标榜股份	2022年02月	6个月	新股流通	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	

		11日		受限						
301187	欧圣电气	2022年04月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	
301196	唯科科技	2022年01月04日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	257	16,468.56	9,642.64	
301200	大族数控	2022年02月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	349	26,719.44	18,120.08	
301201	诚达药业	2022年01月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	
301207	华兰疫苗	2022年02月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	268	15,243.84	15,120.56	
301212	联盛化学	2022年04月07日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	
301235	华康医疗	2022年01月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	

301263	泰恩康	2022年03月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	
301268	铭利达	2022年03月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	
600938	中国海油	2022年04月14日	6个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	
688281	华秦科技	2022年02月28日	6个月	新股流通受限	135.34	246.22	1,515	205,039.00	373,023.30	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“何氏眼科”（证券代码：301103）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 117 股（根据何氏眼科 2021 年年度权益分派实施

公告，何氏眼科以公司现有总股本 121,558,824 股为基数，向全体股东每 10 股派 6 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股，除权除息日为 2022 年 6 月 1 日。)。本基金持有的流通受限股票“华秦科技”（证券代码：688281）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 433 股(根据华秦科技 2021 年年度权益分派实施公告，华秦科技以公司现有总股本 66,666,668 股为基数，向全体股东每股派 0.35 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每股转增 0.40 股，除权除息日为 2022 年 6 月 6 日。)。本基金持有的流通受限股票“军信股份”（证券代码：301109）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 396 股（根据军信股份 2021 年年度权益分派实施公告，军信股份以公司现有总股本 273,340,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 3.80 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股，除权除息日为 2022 年 6 月 17 日。)。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 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 2022 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 2022 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发

行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金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。

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。

期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本期末本基金的资产均能及时变现。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 2022 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	66,392,716.48	-	-	-	-	-	66,392,716.48
结算备付金	2,100,028.27	-	-	-	-	-	2,100,028.27
存出保证金	349,118.88	-	-	-	-	-	349,118.88
交易性金融资产	267,637.72	-	-	-	-	1,122,613,431.84	1,122,881,069.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-	32,176,625.03	32,176,625.03
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	69,109,501.35	-	-	-	-	1,154,790,056.87	1,223,899,558.22
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	19,944,018.82	19,944,018.82
应付赎回款	-	-	-	-	-	13,065,363.74	13,065,363.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	984,757.31	984,757.31
应付托管费	-	-	-	-	-	164,126.21	164,126.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	35,952.51	35,952.51
应付	-	-	-	-	-	-	-

投资顾问费							
应交税费	-	-	-	-	-	1.29	1.29
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,281,753.29	1,281,753.29
负债总计	-	-	-	-	-	35,475,973.17	35,475,973.17
利率敏感度缺口	69,109,501.35	-	-	-	-	1,119,314,083.70	1,188,423,585.05
上年度末 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	50,917,313.95	-	-	-	-	-	50,917,313.95
结算备付金	2,118,449.63	-	-	-	-	-	2,118,449.63
存出保证金	123,642.57	-	-	-	-	-	123,642.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	639,163,473.44	639,163,473.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,320,042.68	1,320,042.68
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	108,152.00	108,152.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	7,166.32	7,166.32
资产总计	53,159,406.15	-	-	-	-	640,598,834.44	693,758,240.59
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	14,055,139.60	14,055,139.60
应付赎回款	-	-	-	-	-	88,331.17	88,331.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	788,420.23	788,420.23

应付托管费	-	-	-	-	-	131,403.35	131,403.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,292,655.31	1,292,655.31
负债总计	-	-	-	-	-	16,355,949.66	16,355,949.66
利率敏感度缺口	53,159,406.15	-	-	-	-	624,242,884.78	677,402,290.93

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

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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由

所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 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	1,122,613,431.84	94.46	639,163,473.44	94.36
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	267,637.72	0.02	-	-
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	1,122,881,069.56	94.48	639,163,473.44	94.36

本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	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 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	62,417,876.19	36,832,820.84
	沪深 300 指数下跌 5%	-62,417,876.19	-36,832,820.84

本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、

可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 06 月 30 日
第一层次	1,120,875,429.33
第二层次	-
第三层次	2,005,640.23
合计	1,122,881,069.56

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,122,613,431.84	91.72
	其中：股票	1,122,613,431.84	91.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	267,637.72	0.02
	其中：债券	267,637.72	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	68,492,744.75	5.60
8	其他各项资产	32,525,743.91	2.66
9	合计	1,223,899,558.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,960,520.89	0.16
C	制造业	1,082,382,752.17	91.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	919,720.20	0.08
E	建筑业	9,976.01	0.00
F	批发和零售业	480,968.22	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	13,518.40	0.00
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	478,511.02	0.04
J	金融业	39,900.59	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	1,005,189.40	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	35,121,807.58	2.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	171,479.62	0.01

R	文化、体育和娱乐业	14,110.30	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,122,613,431.84	94.46

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688390	固德威	398,680	124,790,826.80	10.50
2	300750	宁德时代	212,300	113,368,200.00	9.54
3	601012	隆基绿能	1,525,600	101,650,728.00	8.55
4	605117	德业股份	319,278	89,362,719.42	7.52
5	688063	派能科技	277,843	86,742,584.60	7.30
6	688348	昱能科技	125,789	61,385,032.00	5.17
7	002706	良信股份	3,409,700	56,362,341.00	4.74
8	300763	锦浪科技	242,900	51,737,700.00	4.35
9	002518	科士达	1,659,800	50,789,880.00	4.27
10	688032	禾迈股份	54,398	47,380,658.00	3.99
11	603688	石英股份	340,556	45,161,131.16	3.80
12	300316	晶盛机电	579,500	39,168,405.00	3.30
13	603568	伟明环保	1,041,901	34,768,236.37	2.93
14	002335	科华数据	962,500	29,693,125.00	2.50
15	300751	迈为股份	49,922	24,506,709.80	2.06
16	300586	美联新材	1,316,600	22,632,354.00	1.90
17	300382	斯莱克	1,343,300	21,049,511.00	1.77

18	002011	盾安环境	1,483,600	18,233,444.00	1.53
19	601689	拓普集团	245,400	16,792,722.00	1.41
20	688301	奕瑞科技	29,940	14,162,817.60	1.19
21	300124	汇川技术	201,400	13,266,218.00	1.12
22	688107	安路科技	139,672	9,595,466.40	0.81
23	835185	贝特瑞	93,843	7,758,939.24	0.65
24	002459	晶澳科技	71,340	5,628,726.00	0.47
25	300661	圣邦股份	28,050	5,105,661.00	0.43
26	300286	安科瑞	166,600	4,523,190.00	0.38
27	603612	索通发展	118,800	4,377,780.00	0.37
28	603659	璞泰来	50,500	4,262,200.00	0.36
29	600938	中国海油	120,005	1,960,520.89	0.16
30	300568	星源材质	44,200	1,283,568.00	0.11
31	300274	阳光电源	12,000	1,179,000.00	0.10
32	000683	远兴能源	94,800	996,348.00	0.08
33	002812	恩捷股份	3,800	951,710.00	0.08
34	601985	中国核电	134,070	919,720.20	0.08
35	688223	晶科能源	60,705	906,325.65	0.08
36	688599	天合光能	13,596	887,139.00	0.07
37	603290	斯达半导	2,100	810,390.00	0.07
38	688789	宏华数科	4,799	790,059.37	0.07
39	002484	江海股份	33,500	781,890.00	0.07
40	603259	药明康德	6,300	655,137.00	0.06

41	603501	韦尔股份	3,080	532,932.40	0.04
42	688261	东微半导	1,904	460,691.84	0.04
43	688281	华秦科技	1,515	373,023.30	0.03
44	301201	诚达药业	3,525	257,444.02	0.02
45	688800	瑞可达	1,967	248,451.77	0.02
46	301268	铭利达	6,407	243,766.07	0.02
47	301263	泰恩康	6,813	234,514.72	0.02
48	688234	天岳先进	3,428	229,676.00	0.02
49	301187	欧圣电气	8,759	228,329.22	0.02
50	688167	炬光科技	1,381	205,423.75	0.02
51	301109	军信股份	11,852	201,849.63	0.02
52	301162	国能日新	3,331	201,609.02	0.02
53	301177	迪阿股份	2,640	195,888.00	0.02
54	301200	大族数控	3,483	187,356.08	0.02
55	301103	何氏眼科	5,065	171,479.62	0.01
56	301235	华康医疗	4,178	162,419.54	0.01
57	301207	华兰疫苗	2,676	158,179.84	0.01
58	301212	联盛化学	4,158	155,441.76	0.01
59	301117	佳缘科技	2,616	145,922.50	0.01
60	301096	百诚医药	1,764	139,356.00	0.01
61	301148	嘉戎技术	5,153	133,358.10	0.01
62	301123	奕东电子	4,622	120,513.42	0.01
63	301116	益客食品	5,764	119,695.02	0.01

64	300834	星辉环材	3,513	106,222.42	0.01
65	301196	唯科科技	2,569	97,174.96	0.01
66	301135	瑞德智能	3,376	96,066.48	0.01
67	301110	青木股份	2,013	86,466.00	0.01
68	301181	标榜股份	2,564	81,939.40	0.01
69	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.00
70	300896	爱美客	62	37,200.62	0.00
71	688038	中科通达	2,132	29,911.96	0.00
72	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.00
73	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
74	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.00
75	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.00
76	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.00
77	301018	申菱环境	782	20,183.42	0.00
78	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
79	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
80	301180	万祥科技	736	15,419.20	0.00
81	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.00
82	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.00
83	301118	恒光股份	342	14,716.26	0.00
84	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
85	301185	鸥玛软件	676	12,499.24	0.00

86	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00
87	301082	久盛电气	610	11,315.50	0.00
88	301078	孩子王	756	11,082.96	0.00
89	301017	漱玉平民	555	10,289.70	0.00
90	301046	能辉科技	290	10,036.90	0.00
91	300994	久祺股份	291	9,547.71	0.00
92	301039	中集车辆	854	9,248.82	0.00
93	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
94	300774	倍杰特	444	8,951.04	0.00
95	301098	金埔园林	369	8,948.25	0.00
96	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.00
97	301052	果麦文化	252	8,298.36	0.00
98	301092	争光股份	256	8,053.76	0.00
99	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
100	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.00
101	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.00
102	301038	深水规院	346	7,193.34	0.00
103	301093	华兰股份	212	7,184.68	0.00
104	301027	华蓝集团	286	6,944.08	0.00
105	301048	金鹰重工	595	6,550.95	0.00
106	301055	张小泉	355	6,311.90	0.00
107	301062	上海艾录	523	6,103.41	0.00
108	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
109	301072	中捷精	181	5,797.43	0.00

		工			
110	301025	读客文化	403	5,311.54	0.00
111	301057	汇隆新材	218	5,308.30	0.00
112	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
113	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
114	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
115	301036	双乐股份	197	4,428.56	0.00
116	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
117	301041	金百泽	215	4,237.65	0.00
118	301037	保立佳	193	4,215.12	0.00
119	300854	中兰环保	203	4,035.64	0.00
120	301053	远信工业	155	3,620.80	0.00
121	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00
122	301079	邵阳液压	140	3,472.00	0.00
123	300986	志特新材	90	3,312.00	0.00
124	301012	扬电科技	70	2,870.70	0.00
125	301011	华立科技	75	2,466.75	0.00
126	300996	普联软件	66	1,950.30	0.00
127	300995	奇德新材	91	1,947.40	0.00
128	603213	镇洋发展	99	1,482.03	0.00
129	301016	雷尔伟	75	1,398.75	0.00
130	301015	百洋医药	62	1,337.96	0.00
131	301013	利和兴	107	1,282.93	0.00
132	603048	浙江黎明	64	1,272.32	0.00

133	300991	创益通	86	1,236.68	0.00
134	600927	永安期货	59	1,190.03	0.00
135	603216	梦天家居	72	1,165.68	0.00
136	300981	中红医疗	45	1,134.90	0.00
137	605566	福莱蒽特	35	798.70	0.00
138	300982	苏文电能	17	798.32	0.00
139	300614	百川畅银	29	729.64	0.00
140	001288	运机集团	37	577.57	0.00
141	603230	内蒙新华	40	500.40	0.00
142	603071	物产环能	27	489.78	0.00
143	301010	晶雪节能	18	456.30	0.00
144	300997	欢乐家	28	374.08	0.00
145	001296	长江材料	13	319.54	0.00
146	605138	盛泰集团	23	287.04	0.00
147	300993	玉马遮阳	18	230.04	0.00
148	603176	汇通集团	24	229.44	0.00
149	688206	概伦电子	5	152.00	0.00
150	600935	华塑股份	11	57.64	0.00
151	301007	德迈仕	3	45.21	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基绿能	113,648,709.89	16.78

2	300750	宁德时代	86,544,379.00	12.78
3	688063	派能科技	71,660,434.33	10.58
4	300763	锦浪科技	68,871,227.00	10.17
5	688032	禾迈股份	68,099,829.55	10.05
6	688390	固德威	65,497,470.24	9.67
7	002812	恩捷股份	53,771,193.08	7.94
8	605117	德业股份	50,629,636.75	7.47
9	002335	科华数据	48,688,914.52	7.19
10	300316	晶盛机电	47,275,344.00	6.98
11	002706	良信股份	42,241,867.46	6.24
12	002518	科士达	41,319,634.56	6.10
13	688348	昱能科技	40,612,451.48	6.00
14	603688	石英股份	39,091,655.94	5.77
15	300274	阳光电源	37,396,621.02	5.52
16	603568	伟明环保	35,051,151.22	5.17
17	603501	韦尔股份	29,252,233.00	4.32
18	688599	天合光能	28,546,788.91	4.21
19	002484	江海股份	27,669,525.00	4.08
20	603659	璞泰来	27,290,456.20	4.03
21	002459	晶澳科技	26,149,711.00	3.86
22	300382	斯莱克	24,766,330.00	3.66
23	002714	牧原股份	24,514,297.10	3.62
24	300568	星源材质	23,335,955.47	3.44
25	300586	美联新材	23,210,357.00	3.43
26	603035	常熟汽饰	21,644,180.00	3.20
27	002028	思源电气	20,359,504.00	3.01
28	300751	迈为股份	20,116,246.78	2.97
29	002011	盾安环境	20,039,097.00	2.96
30	603260	合盛硅业	17,719,902.70	2.62
31	300661	圣邦股份	16,555,625.80	2.44
32	601888	中国中免	16,356,267.79	2.41
33	601689	拓普集团	15,852,847.00	2.34
34	603806	福斯特	15,171,958.00	2.24

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	91,829,970.33	13.56
2	002812	恩捷股份	81,518,457.11	12.03

3	688680	海优新材	58,238,552.72	8.60
4	688390	固德威	50,301,751.05	7.43
5	603806	福斯特	45,048,050.96	6.65
6	688032	禾迈股份	41,045,899.70	6.06
7	300750	宁德时代	40,512,666.12	5.98
8	601012	隆基绿能	39,196,993.14	5.79
9	688599	天合光能	29,373,530.48	4.34
10	601985	中国核电	28,330,212.74	4.18
11	300763	锦浪科技	24,640,866.00	3.64
12	603501	韦尔股份	23,930,669.20	3.53
13	002714	牧原股份	23,808,078.23	3.51
14	603659	璞泰来	23,651,372.20	3.49
15	300568	星源材质	23,446,721.21	3.46
16	002335	科华数据	22,834,801.00	3.37
17	002459	晶澳科技	22,645,513.20	3.34
18	002487	大金重工	22,005,050.00	3.25
19	600563	法拉电子	21,836,744.00	3.22
20	002241	歌尔股份	21,047,505.01	3.11
21	002484	江海股份	20,914,809.00	3.09
22	002837	英维克	20,189,733.00	2.98
23	603035	常熟汽饰	19,854,323.08	2.93
24	605117	德业股份	19,111,089.80	2.82
25	603260	合盛硅业	19,015,518.00	2.81
26	603568	伟明环保	17,646,545.25	2.61
27	688187	时代电气	17,114,018.90	2.53
28	601888	中国中免	16,031,289.83	2.37
29	002139	拓邦股份	15,229,933.32	2.25
30	603290	斯达半导	13,586,706.00	2.01

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	1,545,292,691.07
卖出股票收入（成交）总额	1,143,759,496.06

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）	267,637.72	0.02
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	267,637.72	0.02

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	113053	隆 22 转债	1,940	267,637.72	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国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。

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	349,118.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	32,176,625.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,525,743.91

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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（%）
汇添富盈鑫混合A	8,360	43,049.60	147,736,635.81	41.05	212,158,054.23	58.95
汇添	1,802	51,487.42	62,176,573.38	67.01	30,603,758.74	32.99

富盈鑫混合C						
汇添富盈鑫混合D	108	1,041,042.05	107,700,769.48	95.79	4,731,771.38	4.21
合计	10,270	55,025.08	317,613,978.67	56.20	247,493,584.35	43.80

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	汇添富盈鑫混合A	3,570,183.74	0.99
	汇添富盈鑫混合C	0.00	0.00
	汇添富盈鑫混合D	184,639.84	0.16
	合计	3,754,823.58	0.66

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	汇添富盈鑫混合 A	>100
	汇添富盈鑫混合 C	0
	汇添富盈鑫混合 D	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富盈鑫混合 A	0
	汇添富盈鑫混合 C	0
	汇添富盈鑫混合 D	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富盈鑫混合 A	汇添富盈鑫混合 C	汇添富盈鑫混合 D
基金合同生效日（2019 年 03 月 19 日）基金份额总额	509,816,875.73	-	-
本报告期期初基金份额总额	334,384,051.31	-	-
本报告期基金总申购份额	136,541,844.71	112,195,477.68	183,849,047.72
减：本报告期基金总赎回份额	111,031,205.98	19,415,145.56	71,416,506.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	359,894,690.04	92,780,332.12	112,432,540.86

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，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
华泰证券	2	578,061,449.13	21.58	424,960.25	21.83	
中信建投证券	1	397,462,314.03	14.84	285,677.97	14.68	
国海证券	2	351,195,012.06	13.11	250,940.37	12.89	
东兴证券	1	154,766,691.68	5.78	110,656.77	5.68	
瑞银证券	2	146,093,425.69	5.45	115,656.18	5.94	
信达证券	1	130,356,844.42	4.87	93,192.19	4.79	
国泰君安	1	111,519,580.62	4.16	80,311.10	4.13	
东方证券	4	108,236,849.13	4.04	82,799.77	4.25	
东吴证券	1	105,407,122.36	3.94	75,751.72	3.89	
中泰证券	1	93,727,672.53	3.50	67,199.35	3.45	
长城证券	2	87,590,768.84	3.27	62,302.55	3.20	
中银国际	1	86,194,158.20	3.22	61,310.42	3.15	

长江证券	1	77,469,110.43	2.89	55,105.23	2.83	
申万宏源证券	1	76,134,731.01	2.84	54,260.83	2.79	
太平洋证券	2	74,222,358.37	2.77	52,793.88	2.71	
东北证券	2	46,703,949.92	1.74	33,424.54	1.72	
中信证券	2	41,936,339.60	1.57	30,034.47	1.54	
中金公司	2	10,004,222.00	0.37	9,316.79	0.48	
海通证券	1	1,405,112.66	0.05	999.48	0.05	
广发证券	1	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
恒泰证券	2	-	-	-	-	
华西证券	1	-	-	-	-	
平安证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）

华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	282,656.60	3.18	-	-	-	-	-	-
国海证券	4,301,419.00	48.41	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	4,301,333.00	48.41	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期

1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	关于汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额和 D 类份额开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	证券时报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 17 日
3	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	上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 17 日
4	汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金更新法律文件	公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 17 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年年度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 31 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于提高汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额净值精度的公告	证券时报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第一季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 22 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于在直销中心开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 28 日
11	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 27 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盈鑫保本混合型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富盈鑫灵活配置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、报告期内汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号　汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 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 08 月 31 日