

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2020 年第 4 季度报告

2020 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：招商证券股份有限公司

送出日期：2021 年 01 月 22 日

§ 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责任。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|---------------|--|
| 基金简称 | 汇添富中证 500 指数 (LOF) |
| 基金主代码 | 501036 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 (LOF) |
| 基金合同生效日 | 2017 年 08 月 10 日 |
| 报告期末基金份额总额(份) | 313,853,303.79 |
| 投资目标 | 本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率×95%+ 银行人民币活期存款利率（税后） |

| | | |
|--------------------|--|----------------------|
| | ×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商证券股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇添富中证 500 指数 (LOF) A | 汇添富中证 500 指数 (LOF) C |
| 下属分级基金场内简称 | 中证 500A | 中证 500C |
| 下属分级基金的交易代码 | 501036 | 501037 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额(份) | 188,653,666.27 | 125,199,637.52 |

注：A 级扩位证券简称为中证 500LOF；C 级扩位证券简称为中证 500LOFC。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2020年10月01日 - 2020年12月31日) | |
|-----------------|--------------------------------|----------------------|
| | 汇添富中证 500 指数 (LOF) A | 汇添富中证 500 指数 (LOF) C |
| 1. 本期已实现收益 | 10,238,296.08 | 5,921,114.03 |
| 2. 本期利润 | 9,246,524.93 | 5,485,707.80 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0421 | 0.0428 |
| 4. 期末基金资产净值 | 206,033,079.78 | 135,720,590.01 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0921 | 1.0840 |

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

| 汇添富中证 500 指数 (LOF) 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 |
| 过去三个月 | 3.61% | 1.10% | 2.70% | 1.10% | 0.91% | 0.00% |
| 过去六个月 | 14.89% | 1.35% | 8.20% | 1.38% | 6.69% | -0.03% |
| 过去一年 | 27.99% | 1.50% | 19.94% | 1.54% | 8.05% | -0.04% |
| 过去三年 | 14.86% | 1.44% | 2.25% | 1.46% | 12.61% | -0.02% |
| 自基金合同生效日起至今 | 9.21% | 1.37% | 0.91% | 1.40% | 8.30% | -0.03% |
| 汇添富中证 500 指数 (LOF) 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 |
| 过去三个月 | 3.54% | 1.10% | 2.70% | 1.10% | 0.84% | 0.00% |
| 过去六个月 | 14.75% | 1.35% | 8.20% | 1.38% | 6.55% | -0.03% |
| 过去一年 | 27.66% | 1.50% | 19.94% | 1.54% | 7.72% | -0.04% |
| 过去三年 | 14.06% | 1.44% | 2.25% | 1.46% | 11.81% | -0.02% |
| 自基金合同生效日起至今 | 8.40% | 1.37% | 0.91% | 1.40% | 7.49% | -0.03% |

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

汇添富中证500指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数（LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年08月10日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 (年) | 说明 |
|-----|----------------------|------------------|------|---------------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴振翔 | 本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监 | 2017 年 08 月 10 日 | | 14 | <p>国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。从业资格:证券投资基金从业资格。</p> <p>从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。</p> <p>2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>理。2015 年 3 月 24 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>金经理。2019 年 9 月 24 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 4 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度，国内疫情得到有效防控，经济数据持续改善，工业生产、投资、消费均保持了较高的景气度，反映出中国经济强大的韧性和良好的修复能力。得益于我国安全稳固的供应链，出口表现强劲，人民币升值趋势明显，人民币资产的国际吸引力持续提升。

国内政策面方面，四季度政治局会议、中央经济工作会议陆续召开。2021 年经济工作在强调以供给侧结构性改革为主线的同时，注重需求侧管理；强调宏观政策的连续性、稳定性、可持续性；将科技创新、自主可控、促进资本市场健康发展、碳达峰/碳中和放在重要位置。12 月，交易所退市新规征求意见稿出台，优化退市标准、简化退市流程、强化退市监管，有望促进 A 股优胜劣汰，提升上市公司整体质量。

资金面角度，公募基金发行火热，给 A 股带来持续增量资金，权益资产在国内居民资产配置中的重要性逐步提升。

海外方面，美国、欧洲多地疫情出现反复，虽疫苗研发稳步推进，但接种进度低于预期，

疫情压力下海外经济刺激政策延续。11 月美国大选结果出炉，民主党在参众两院具有控制权，未来美国抗疫政策协调性有望提升，新能源等政策侧重板块相对受益。

在上述因素影响下，市场表现出显著的结构性情行，新能源、消费以及部分顺周期行业表现突出，成长风格显著优于价值风格。中证 500 指数是 A 股市场典型的成长性指数品种，是投资者抓住 A 股成长性投资机会的便利工具。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。权益投资仓位报告期内基本保持在 90%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

在上述因素影响下，市场表现出显著的结构性情行，新能源、消费以及部分顺周期行业表现突出。大市值公司收益显著优于中小市值公司。成长风格显著优于价值风格。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 3.61%;C 类基金份额净值增长率为 3.54%。同期业绩比较基准收益率为 2.70%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 (元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 315,194,074.37 | 91.10 |
| | 其中：股票 | 315,194,074.37 | 91.10 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 959,657.24 | 0.28 |
| | 其中：债券 | 959,657.24 | 0.28 |
| | 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 | 26,662,475.10 | 7.71 |
| 8 | 其他资产 | 3,184,135.53 | 0.92 |
| 9 | 合计 | 346,000,342.24 | 100.00 |

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 42,551,125.00 元，占期末基金资产净值比例 12.45%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,509,128.00 | 1.03 |
| B | 采矿业 | 10,056,920.36 | 2.94 |
| C | 制造业 | 199,466,675.86 | 58.37 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,237,254.32 | 2.12 |
| E | 建筑业 | 4,468,575.12 | 1.31 |
| F | 批发和零售业 | 11,209,309.05 | 3.28 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,212,523.17 | 1.82 |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,485,376.53 | 0.43 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 23,642,168.33 | 6.92 |
| J | 金融业 | 19,075,840.07 | 5.58 |
| K | 房地产业 | 8,558,864.40 | 2.50 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,792,607.30 | 0.82 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,827,793.88 | 0.83 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,900,988.51 | 0.85 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 253,616.00 | 0.07 |
| Q | 卫生和社会工作 | 2,743,654.28 | 0.80 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,568,628.00 | 0.75 |
| S | 综合 | 1,506,153.20 | 0.44 |
| | 合计 | 310,516,076.38 | 90.86 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 3,543,768.84 | 1.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 21,457.98 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 23,537.92 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 28,512.50 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 598,009.56 | 0.17 |
| J | 金融业 | 61,102.80 | 0.02 |
| 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 | 15,649.20 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 385,959.19 | 0.11 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,677,997.99 | 1.37 |

5.2.3 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股

票投资明细

| 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 | 300274 | 阳光电源 | 55,300 | 3,997,084.00 | 1.17 |
| 2 | 300012 | 华测检测 | 90,200 | 2,468,774.00 | 0.72 |
| 3 | 600426 | 华鲁恒升 | 63,160 | 2,355,868.00 | 0.69 |
| 4 | 002074 | 国轩高科 | 56,800 | 2,222,016.00 | 0.65 |
| 5 | 600089 | 特变电工 | 205,700 | 2,087,855.00 | 0.61 |
| 6 | 600079 | 人福医药 | 59,995 | 2,032,630.60 | 0.59 |
| 7 | 000547 | 航天发展 | 71,200 | 1,958,000.00 | 0.57 |
| 8 | 603882 | 金域医学 | 15,100 | 1,934,612.00 | 0.57 |
| 9 | 300496 | 中科创达 | 16,200 | 1,895,400.00 | 0.55 |
| 10 | 300285 | 国瓷材料 | 41,900 | 1,890,109.00 | 0.55 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名 | 数量 (股) | 公允价值 (元) | 占基金资产 |
|----|------|-----|--------|----------|-------|
|----|------|-----|--------|----------|-------|

| | | 称 | | | 净值比例 (%) |
|---|--------|------|--------|------------|-------------|
| 1 | 300896 | 爱美客 | 1,324 | 860,375.70 | 0.25 |
| 2 | 688568 | 中科星图 | 11,020 | 483,778.00 | 0.14 |
| 3 | 300888 | 稳健医疗 | 2,925 | 457,440.75 | 0.13 |
| 4 | 688520 | 神州细胞 | 6,518 | 296,894.90 | 0.09 |
| 5 | 300910 | 瑞丰新材 | 3,946 | 244,397.15 | 0.07 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------|------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 370,517.70 | 0.11 |
| 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) | 589,139.54 | 0.17 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 959,657.24 | 0.28 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 (张) | 公允价值 (元) | 占基金资产 净值比例 (%) |
|----|--------|-------------|--------|------------|----------------------|
| 1 | 019640 | 20 国债 10 | 3,710 | 370,517.70 | 0.11 |

| | | | | | |
|---|--------|----------|-------|------------|------|
| 2 | 127025 | 冀东转 债 | 1,097 | 124,706.96 | 0.04 |
| 3 | 128115 | 巨星转 债 | 375 | 95,115.00 | 0.03 |
| 4 | 127023 | 华菱转 2 | 703 | 74,996.04 | 0.02 |
| 5 | 110076 | 华海转 债 | 500 | 63,475.00 | 0.02 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量 (买/ 卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动 (元) | 风险说明 |
|-------------------|--------|------------------|--------------|---------------|------------|
| IC2101 | IC2101 | 7 | 8,881,320.00 | 103,120.00 | |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | 103,120.00 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | -1,865.83 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | 802,920.00 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,以降低交易成本和组合风险,提高投资效率。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,599,428.82 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 34,362.26 |
| 5 | 应收申购款 | 1,550,344.45 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,184,135.53 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|---------------|-----------|
| 1 | 600426 | 华鲁恒升 | 611,720 | 0.18 | 转融通出借流通受限 |
| 2 | 002074 | 国轩高科 | 578,976 | 0.17 | 转融通出借流通受限 |
| 3 | 600089 | 特变电工 | 545,055 | 0.16 | 转融通出借流通受限 |
| 4 | 600079 | 人福医药 | 528,528 | 0.15 | 转融通出借流通受限 |
| 5 | 000547 | 航天发展 | 508,750 | 0.15 | 转融通出借流通受限 |

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-----------------|---------------|----------|
| 1 | 688568 | 中科星图 | 483,778.00 | 0.14 | 新股流通受限 |
| 2 | 300888 | 稳健医疗 | 457,440.75 | 0.13 | 新股流通受限 |
| 3 | 300896 | 爱美客 | 80,246.88 | 0.02 | 新股流通受限 |

| | | | | | |
|---|--------|------|-----------|------|--------|
| 4 | 300910 | 瑞丰新材 | 18,908.65 | 0.01 | 新股流通受限 |
|---|--------|------|-----------|------|--------|

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 汇添富中证 500 指数 (LOF) A | 汇添富中证 500 指数 (LOF) C |
|---------------|----------------------|----------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 241,815,520.19 | 137,823,828.13 |
| 本报告期基金总申购份额 | 30,432,471.82 | 76,946,905.26 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 83,594,325.74 | 89,571,095.87 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 188,653,666.27 | 125,199,637.52 |

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10002700.27 份为发起份额，发起份额承诺的持有期为 2017 年 8 月 10 日至 2020 年 8 月 10 日。截至本报告期末，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 募集的文件;
- 2、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- 3、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5、报告期内汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 在指定报刊上披露的各项公告;
- 6、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

10.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 01 月 22 日