

# 汇添富全球消费行业混合型证券投资基金 2021年中期报告

2021年06月30日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021年08月31日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年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 .....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 .....	6
2.5 信息披露方式 .....	6
2.6 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 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
§ 4 管理人报告 .....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介 .....	14
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	14
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	14
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	15
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
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 .....	17
§ 5 托管人报告 .....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	17
5.3 托管人对中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	17
6.1 资产负债表 .....	17
6.2 利润表 .....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	20
6.4 报表附注 .....	21
§ 7 投资组合报告 .....	63
7.1 期末基金资产组合情况 .....	63
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	63
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	64
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细 .....	64
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	115
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	120
7.7 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 .....	120

7.8 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	121
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	121
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	121
7.11 投资组合报告附注	121
§ 8 基金份额持有人信息	122
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	122
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	123
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	123
§ 9 开放式基金份额变动	124
§ 10 重大事件揭示	124
10.1 基金份额持有人大会决议	124
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	124
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	124
10.4 基金投资策略的改变	125
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	125
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	125
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	125
10.8 其他重大事件	128
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	128
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	128
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	129
§ 12 备查文件目录	129
12.1 备查文件目录	129
12.2 存放地点	129
12.3 查阅方式	129

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富全球消费行业混合型证券投资基金		
基金简称	添富全球消费混合(QDII)		
基金主代码	006308		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018年09月21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)	799,659,864.72		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	添富全球消费混合(QDII)人民币A	添富全球消费混合(QDII)人民币C	添富全球消费混合(QDII)美元现汇
下属分级基金的交易代码	006308	006309	006310
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	642,913,058.71	134,524,757.80	22,222,048.21

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选全球消费行业相关优质公司的股票进行投资布局，为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选全球消费行业相关优质公司的股票进行投资布局，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、个股精选策略、基金投资策略、固定收益类资产投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、汇率避险策略。
业绩比较基准	中证主要消费行业指数收益率*40%+恒生消费品制造及服务业指数收益率*24%+中债综合财富指数收益率*20%+明晟全球可选消费指数收益率*8%+明晟全球主要消费指数收益率*8%
风险收益特征	本基金为投资于全球范围内的消费行业相关优质上市公司股票的

	<p>混合型基金，风险与预期收益水平低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>
--	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	北美信托银行
	英文	The Northern Trust Company
注册地址		Chicago, County of Cook, State of Illinois, USA
办公地址		50 South La Salle Street, Chicago, Illinois USA
邮政编码		60603

注：本基金无境外投资顾问。

### 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日 - 2021年06月30日)		
	添富全球消费混合(QDII)人民币A	添富全球消费混合(QDII)人民币C	添富全球消费混合(QDII)美元现汇
本期已实现收益	-88,798,730.85	-21,724,242.13	-16,446,619.22
本期利润	-137,443,718.81	-35,163,998.40	-17,918,813.11
加权平均基金份额本期利润	-0.1976	-0.2447	-0.8218
本期加权平均净值利润率	-7.16%	-9.11%	-4.35%
本期基金份额净值增长率	-1.32%	-1.81%	-0.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)		
期末可供分配利润	587,274,827.75	114,226,544.31	138,464,400.71
期末可供分配基金份额利润	0.9135	0.8491	6.2309
期末基金资产净值	1,774,421,468.60	360,630,514.67	418,795,946.63
期末基金份额净值	2.7600	2.6808	2.9173
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	176.00%	168.08%	191.73%

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

添富全球消费混合(QDII)人民币 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	2.18%	1.07%	-1.81%	0.57%	3.99%	0.50%
过去三个月	6.09%	1.32%	4.57%	0.71%	1.52%	0.61%
过去六个月	-1.32%	1.88%	1.93%	1.08%	-3.25%	0.80%
过去一年	33.40%	1.70%	32.56%	1.02%	0.84%	0.68%
自基金合同生效日起至今	176.00%	1.41%	75.99%	1.07%	100.01%	0.34%
添富全球消费混合(QDII)人民币 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	2.10%	1.07%	-1.81%	0.57%	3.91%	0.50%
过去三个月	5.83%	1.32%	4.57%	0.71%	1.26%	0.61%
过去六个月	-1.81%	1.88%	1.93%	1.08%	-3.74%	0.80%
过去一年	32.07%	1.70%	32.56%	1.02%	-0.49%	0.68%
自基金合同生效日起至今	168.08%	1.41%	75.99%	1.07%	92.09%	0.34%
添富全球消费混合(QDII)美元现汇						
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



				④		
过去一个月	0.73%	1.09%	-1.81%	0.57%	2.54%	0.52%
过去三个月	7.92%	1.34%	4.57%	0.71%	3.35%	0.63%
过去六个月	-0.33%	1.91%	1.93%	1.08%	-2.26%	0.83%
过去一年	46.19%	1.71%	32.56%	1.02%	13.63%	0.69%
自基金合同生效日起至今	191.73%	1.41%	75.99%	1.07%	115.74%	0.34%

### 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

添富全球消费混合(QDII)人民币A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



添富全球消费混合(QDII)人民币C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富全球消费混合(QDII)美元现汇 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（2018年09月21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，公司注册资本为132,724,224元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人及QFII基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
郑慧莲	本基金的基金经理	2018年09月21日		11	国籍:中国。学历:复旦大学会计学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格,CPA。从业经历:2010年7月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任行业研究员、高级研究员。2017年5月18日至2017年12月11日任汇添富6

				<p>月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2017年5月18日至2017年12月11日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。2017年5月18日至2017年12月25日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。2017年12月12日至2020年6月10日任汇添富6月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2017年12月12日至2021年3月29日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月12日至今任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2017年12月12日至2020年2月26日任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理。2017年12月12日至2019年8月28日任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2017年12</p>
--	--	--	--	--

				<p>月 26 日至 2020 年 2 月 26 日任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月 26 日至 2021 年 3 月 29 日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 1 日至 2020 年 6 月 10 日任汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月 2 日至 2020 年 6 月 10 日任汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 7 月 6 日至 2020 年 6 月 10 日任汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 21 日至今任汇添富全球消费行业混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月 21 日至 2021 年 5 月 17 日任汇添富消费升级混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 30 日至 2020 年 6 月 10 日任汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019</p>
--	--	--	--	---

					<p>年7月31日至今任汇添富内需增长股票型证券投资基金的基金经理。2020年10月19日至今任汇添富品牌驱动六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021年1月25日至今任汇添富互联网核心资产六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人进一步完善了公司内部公平交易管理规范 and 流程, 以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略及投资品种。

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

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析, 具体方法为: 在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下, 对不同组合同一证券同向交易的溢价率进行了T分布检验。对于没有通过检验的交易, 再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析, 进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

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

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

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内, 本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有14次, 投资组合经理因投资组合的投资策略与其他组合发生同日反向交易, 相关交易事前严格根据公司内部规定进行审批, 事后对其交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析, 未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年半年度, A股方面, 上证指数上涨3.4%, 深证成指上涨4.78%, 沪深300上涨0.24%, 中小综指上涨5.19%, 创业板指上涨17.22%。港股方面, 恒生指数上涨5.86%。美股方面, 标普500上涨14.41%, 道琼斯工业指数上涨12.73%。

总体看, 上半年的市场波动比较大, 一季度受到流动性等收紧等预期, 市场在春节后出现大幅回调, 但随后, 随着一季报的披露, 不少行业的景气度明显上行, 不少企业都显示出很好的盈利增速, 加上流动性一直保持相对宽松状态, 市场从3月中旬后开始触底反弹, 并开展了结构性行情。涨幅较好的板块, 主要分布在成长潜力大、短期景气度已明显提升、甚至伴随着相关资源的供给紧缺的领域, 包括一季度表现较好的小白酒、新型小家电、cxo;

二季度表现较好的新能源车、半导体、光伏等主线。

我们仍在 A 股、港股、美股之间基本均衡配置。个股和行业选择方面，我们挑选了白酒、免税、医美、互联网、新消费等赛道。

2021 年上半年，本基金表现比较一般。互联网板块、中概股等，是我们持仓较重的领域，但受到政策、自身发展阶段等影响，今年以来的表现非常一般，拖累了整体业绩表现。此外，我们在新消费的布局欠佳，也拖累了净值。未来，我们仍需要夯实我们在新消费领域的研究框架。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期人民币 A 类基金份额净值增长率为-1.32%；人民币 C 类基金份额净值增长率为-1.81%；美元现汇基金份额净值增长率为-0.33%。同期业绩比较基准收益率为 1.93%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，下半年仍是结构性行情。我们看好 3 条主线，（1）龙头白马股经过上半年的估值消化后，目前已经处于性价比很合适的区域，包括大白酒、免税等；（2）持续看好新兴消费的方向，包括新型小家电、医美、医疗服务等；（3）试图寻找一些逆境反转的机会，包括调味品、互联网赛道等。

#### 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验，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：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；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。

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，本基金托管人在对汇添富全球消费行业混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，汇添富全球消费行业混合型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富全球消费行业混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富全球消费行业混合型证券投资基金2021年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富全球消费行业混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	172,467,524.94	148,347,930.17
结算备付金		6,870,979.62	17,420,209.71
存出保证金		2,324,649.85	5,450,951.14
交易性金融资产	6.4.7.2	2,423,993,441.55	1,732,409,180.89
其中：股票投资		2,287,511,833.55	1,681,357,880.89
基金投资		-	-
债券投资		136,481,608.00	51,051,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		57,940,425.40	92,844,629.92
应收利息	6.4.7.5	2,035,847.49	733,280.81
应收股利		1,098,532.08	209,049.91
应收申购款		8,172,303.70	52,462,242.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,674,903,704.63	2,049,877,475.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		35,934,357.14	73,003,347.81
应付赎回款		77,499,998.32	80,771,880.87
应付管理人报酬		3,821,722.08	2,503,552.73
应付托管费		743,112.61	486,801.92
应付销售服务费		309,444.68	202,086.58
应付交易费用	6.4.7.7	2,590,629.97	1,482,182.99
应交税费		0.34	0.04
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	156,509.59	262,442.31
负债合计		121,055,774.73	158,712,295.25
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	929,334,296.78	678,548,673.54

未分配利润	6.4.7.1 0	1,624,513,633.12	1,212,616,506.31
所有者权益合计		2,553,847,929.90	1,891,165,179.85
负债和所有者权益总计		2,674,903,704.63	2,049,877,475.10

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 799,659,864.72 份。本基金下属添富全球消费混合(QDII)人民币 A 基金份额净值 2.7600 元，基金份额总额 642,913,058.71 份；本基金下属添富全球消费混合(QDII)人民币 C 基金份额净值 2.6808 元，基金份额总额 134,524,757.80 份；本基金下属 添富全球消费混合(QDII)美元现汇 基金份额净值 2.9173 元，基金份额总额 22,222,048.21 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富全球消费行业混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-141,412,694.94</b>	<b>184,511,727.63</b>
1. 利息收入		1,618,635.04	146,002.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	229,575.98	104,252.34
债券利息收入		1,389,059.06	41,750.53
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）		-84,021,392.76	56,501,353.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-89,470,880.33	54,622,276.15
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-14,400.00	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	5,463,887.57	1,879,077.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-63,556,938.12	126,436,489.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		568,021.77	223,904.03
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	3,978,979.13	1,203,978.11
<b>减：二、费用</b>		<b>49,113,835.38</b>	<b>8,603,823.32</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,388,809.37	4,417,857.68

2. 托管费	6.4.10.2.2	4,742,268.43	859,027.94
3. 销售服务费		1,920,994.53	592,534.61
4. 交易费用	6.4.7.20	17,793,944.00	2,583,669.57
5. 利息支出		2,689.56	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.24	-
7. 其他费用	6.4.7.21	265,129.25	150,733.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-190,526,530.32</b>	<b>175,907,904.31</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-190,526,530.32</b>	<b>175,907,904.31</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富全球消费行业混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	678,548,673.54	1,212,616,506.31	1,891,165,179.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-190,526,530.32	-190,526,530.32
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）	250,785,623.24	602,423,657.13	853,209,280.37
其中：1. 基金申购款	828,059,527.30	1,594,001,150.93	2,422,060,678.23
2. 基金赎回款	-577,273,904.06	-991,577,493.80	-1,568,851,397.86
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	929,334,296.78	1,624,513,633.12	2,553,847,929.90

权益(基金净值)			
项目	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	160,602,740.29	71,448,024.39	232,050,764.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	175,907,904.31	175,907,904.31
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)	264,399,764.44	203,683,041.76	468,082,806.20
其中: 1. 基金申购款	575,822,090.81	385,272,551.68	961,094,642.49
2. 基金赎回款	-311,422,326.37	-181,589,509.92	-493,011,836.29
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)	425,002,504.73	451,038,970.46	876,041,475.19

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

基金管理人负责人

李骁

主管会计工作负责人

雷青松

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富全球消费行业混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]636号文《关于准予汇添富全球消费行业混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集,基金合同于2018年9月21日生效,首次设立募集规模为347,747,420.28份人民币基金份额和3,255,290.62份美元基金份额。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,境外托管人北美信托银行(The Northern Trust Company.)。

本基金投资于境内境外市场。针对境外投资,本基金可投资于下列金融产品或工具:在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(以下无特别说明,均包括 exchange traded fund, ETF); 已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股(包括港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票)、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证; 政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券; 银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具; 远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品; 针对境内投资,本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具,具体包括:股票(包含中小板、创业板、其他依法上市的股票),存托凭证,衍生工具(股指期货、权证、国债期货、股票期权等),债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等资产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)。本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金为对冲外币的汇率风险,可以投资于外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易、境内融资交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

本基金采用自下而上的投资方法,以基本面分析为立足点,在科学严格管理风险的前提下,精选全球消费行业相关优质公司的股票进行投资布局,为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金业绩比较基准为:中证主要消费行业指数收益率 $\times$ 40%+恒生消费品制造及服务行业指数收益率 $\times$ 24%+明晟全球可选消费指数收益率 $\times$ 8%+明晟全球主要消费指数收益率 $\times$ 8%+中债综合财富指数收益率 $\times$ 20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具

体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年06月30日的财务状况以及2021年01月01日至2021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

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。

#### 6.4.5 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

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。

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。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.6.1 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	172,467,524.94
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	172,467,524.94

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元



项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,112,125,587.54	2,287,511,833.55	175,386,246.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	66,349,935.40	-15,327.40
	银行间市场	70,063,910.00	83,090.00
	境外OTC市场	-	-
	合计	136,413,845.40	67,762.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,248,539,432.94	2,423,993,441.55	175,454,008.61

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	7,698.47
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	2,623.04
应收债券利息	2,025,234.18
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	291.80
合计	2,035,847.49

注：“其他”为应收结算保证金利息。

## 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	2,590,629.97
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,590,629.97

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	52,371.24
应付证券出借违约金	-
应付审计费	44,630.98
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	156,509.59

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

添富全球消费混合(QDII)人民币 A		
项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	475,545,936.10	475,547,263.58
本期申购	540,181,762.36	540,182,443.73
本期赎回(以“-”号填列)	-372,814,639.75	-372,815,984.90
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	642,913,058.71	642,913,722.41
添富全球消费混合(QDII)人民币C		
项目	本期2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	94,868,647.07	94,862,969.93
本期申购	197,387,138.44	197,375,544.35
本期赎回(以“-”号填列)	-157,731,027.71	-157,721,829.10
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	134,524,757.80	134,516,685.18
添富全球消费混合(QDII)美元现汇		
项目	本期2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	15,819,615.87	108,138,440.03
本期申购	13,239,490.09	90,501,539.22
本期赎回(以“-”号填列)	-6,837,057.75	-46,736,090.06
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	22,222,048.21	151,903,889.19

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

添富全球消费混合(QDII)人民币A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	473,839,576.18	380,654,161.54	854,493,737.72

本期利润	-88,798,730.85	-48,644,987.96	-137,443,718.81
本期基金份额交易产生的变动数	202,233,982.42	212,223,744.86	414,457,727.28
其中：基金申购款	583,472,133.26	474,772,906.98	1,058,245,040.24
基金赎回款	-381,238,150.84	-262,549,162.12	-643,787,312.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	587,274,827.75	544,232,918.44	1,131,507,746.19
添富全球消费混合(QDII)人民币C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	89,457,993.15	74,678,234.91	164,136,228.06
本期利润	-21,724,242.13	-13,439,756.27	-35,163,998.40
本期基金份额交易产生的变动数	46,492,793.29	50,648,806.54	97,141,599.83
其中：基金申购款	202,652,910.45	159,633,750.87	362,286,661.32
基金赎回款	-156,160,117.16	-108,984,944.33	-265,145,061.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	114,226,544.31	111,887,285.18	226,113,829.49
添富全球消费混合(QDII)美元现汇			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	107,535,189.38	86,451,351.15	193,986,540.53
本期利润	-16,446,619.22	-1,472,193.89	-17,918,813.11
本期基金份额交易产生的变动数	47,375,830.55	43,448,499.47	90,824,330.02
其中：基金申购款	96,650,438.34	76,819,011.03	173,469,449.37
基金赎回款	-49,274,607.79	-33,370,511.56	-82,645,119.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	138,464,400.71	128,427,656.73	266,892,057.44

#### 6.4.7.11 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06月30日
活期存款利息收入	160,841.93
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	50,314.40
其他	18,419.65
合计	229,575.98

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	5,543,187,129.18
减：卖出股票成本总额	5,632,658,009.51
买卖股票差价收入	-89,470,880.33

#### 6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,405,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,014,400.00
减：应收利息总额	405,000.00
买卖债券差价收入	-14,400.00

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日

股票投资产生的股利收益	5,463,887.57
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	5,463,887.57

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-63,556,938.12
——股票投资	-63,588,620.72
——债券投资	31,682.60
——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	-63,556,938.12

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	3,978,979.13
替代损益	-
其他	-
合计	3,978,979.13

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	17,793,619.00
银行间市场交易费用	325.00
交易基金产生的费用	-
合计	17,793,944.00

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	857.00
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	151,133.90
合计	265,129.25

#### 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
北美信托银行 (The Northern Trust Company) (“北美信托”)	基金境外托管人
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
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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	1,767,903,724.63	14.95	1,103,388,026.71	50.29

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 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	-	-	7,998,829.00	100.00

## 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 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	1,555,591.21	14.86	884,172.80	34.13
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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	986,922.39	74.20	488,216.03	100.00



注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,388,809.37	4,417,857.68
其中：支付销售机构的客户维护费	5,655,031.04	1,405,083.42

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,742,268.43	859,027.94

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.35%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 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 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			
	添富全球消费混合(QDII)人民币 A	添富全球消费混合(QDII)人民币 C	添富全球消费混合(QDII)美元现汇	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	103,189.09	-	103,189.09
中国工商银行股份有限公司	-	61,410.86	-	61,410.86
东方证券股份有限公司	-	853.03	-	853.03
合计	-	165,452.98	-	165,452.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	添富全球消费混合(QDII)人民币 A	添富全球消费混合(QDII)人民币 C	添富全球消费混合(QDII)美元现汇	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	15,643.25	-	15,643.25
中国工商银行股份有限公司	-	29,482.39	-	29,482.39
合计	-	45,125.64	-	45,125.64

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 1.0%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 1.0% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，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5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位:份

添富全球消费混合(QDII)人民币 A		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日(2018年09月21日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	25,563,568.02	-
报告期间申购/买入总份额	-	8,928,417.82
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	16,293,325.51	-
报告期末持有的基金份额	9,270,242.51	8,928,417.82
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	1.44	3.20
添富全球消费混合(QDII)人民币 C		

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日(2018年09月21日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
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(%)	-	-
添富全球消费混合(QDII)美元现汇		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日(2018年09月21日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
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。

#### 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

份额单位: 份

添富全球消费混合(QDII)人民币 A				
关联方名称	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金	持有的基金份额	持有的基金

		份额占基金 总份额的比 例 (%)		份额占基金 总份额的比 例 (%)
汇添富资本 管理有限公司	9,025,592.98	1.40	13,222,563.71	2.78
上海菁聚金 投资管理合 伙企业(有 有限合伙)	1,987,328.44	0.31	-	-
添富全球消费混合(QDII)人民币 C				
关联方名称	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 (%)	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 (%)
	-	-	-	-
添富全球消费混合(QDII)美元现汇				
关联方名称	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 (%)	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 (%)
	-	-	-	-

注:除基金管理人之外的其他关联方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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方 名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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	81,739,036.03	160,841.93	28,538,699.87	84,263.36
北美信 托	90,728,488.91	-	46,429,588.76	3,784.48

#### 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。

#### 6.4.11 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（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301018	申菱环境	2021年06月28日	2022年01月07日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	
300991	创益通	2021年05月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	
300955	嘉亨家化	2021年03月16日	2021年09月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	
002507	涪陵榨菜	2021年05月17日	2021年11月18日	非公开发行流通受限	33.58	35.69	446,695	15,000,018.10	15,942,544.55	

				限						
300952	恒辉安防	2021年03月03日	2021年09月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	
300966	共同药业	2021年03月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	
2150HK	NAYUKI HOLDINGS LTD	2021年06月30日	2021年12月30日	新股配售流通受限	16.48	13.50	12,227,500	201,450,312.36	165,128,210.59	
300979	华利集团	2021年04月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	
300957	贝泰妮	2021年03月18日	2021年09月27日	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	
300950	德固特	2021年02月24日	2021年09月03日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	

300992	泰福泵业	2021年05月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00
300996	普联软件	2021年05月26日	2021年12月03日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43
301013	利和兴	2021年06月21日	2021年12月29日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81
688468	科美诊断	2021年03月31日	2021年10月11日	新股流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50
301010	晶雪节能	2021年06月09日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98
301016	雷尔伟	2021年06月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50
301017	漱玉平民	2021	2021	新股	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70



		年 06 月 23 日	年 07 月 05 日	流 通 受 限						
3010 17	漱玉平民	202 1 年 06 月 23 日	202 2 年 01 月 05 日	新 股 流 通 受 限	8.8 6	8.86	555	4,917.30	4,917.30	
3006 14	百川畅 银	202 1 年 05 月 18 日	202 1 年 11 月 25 日	新 股 流 通 受 限	9.1 9	40.3 8	329	3,023.51	13,285.02	
6884 99	利元亨	202 1 年 06 月 23 日	202 1 年 07 月 01 日	新 股 流 通 受 限	38. 85	38.8 5	2,149	83,488.65	83,488.65	
3009 73	立高食 品	202 1 年 04 月 08 日	202 1 年 10 月 15 日	新 股 流 通 受 限	28. 28	115. 71	360	10,180.80	41,655.60	
3010 18	申菱环 境	202 1 年 06 月 28 日	202 1 年 07 月 07 日	新 股 流 通 受 限	8.2 9	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	
3009 45	曼卡龙	202 1 年 02	202 1 年 08	新 股 流 通	4.5 6	18.8 8	474	2,161.44	8,949.12	

		月 03 日	月 10 日	受 限						
3009 95	奇德新材	202 1年 05月 17日	202 1年 11月 26日	新 股 流 通 受 限	14. 72	23.3 2	191	2,811.52	4,454.12	
6882 26	威腾电 气	202 1年 06月 28日	202 1年 07月 07日	新 股 流 通 受 限	6.4 2	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	
3010 21	英诺激 光	202 1年 06月 28日	202 1年 07月 06日	新 股 流 通 受 限	9.4 6	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	
3010 11	华立科 技	202 1年 06月 09日	202 1年 12月 17日	新 股 流 通 受 限	14. 20	33.8 4	175	2,485.00	5,922.00	
3009 86	志特新 材	202 1年 04月 21日	202 1年 11月 01日	新 股 流 通 受 限	14. 79	30.5 7	264	3,904.56	8,070.48	
6886 36	智明达	202 1年 03月 30日	202 1年 10月 08日	新 股 流 通 受 限	34. 50	80.7 2	918	31,671.00	74,100.96	

		日	日						
300993	玉马遮阳	2021年05月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90
300942	易瑞生物	2021年02月02日	2021年08月09日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36
300997	欢乐家	2021年05月26日	2021年12月02日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40
300971	博亚精工	2021年04月07日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05
300929	华骐环保	2021年01月12日	2021年07月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65
300968	格林精密	2021年04月06日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34
3009	春晖智	202	202	新	9.7	23.0	255	2,496.45	5,867.55

43	控	1 年 02 月 03 日	1 年 08 月 10 日	股 流 通 受 限	9	1				
6886 11	杭州柯 林	202 1 年 04 月 01 日	202 1 年 10 月 12 日	新 股 流 通 受 限	33. 44	42.3 4	1,400	46,816.00	59,276.00	
3010 07	德迈仕	202 1 年 06 月 04 日	202 1 年 12 月 16 日	新 股 流 通 受 限	5.2 9	14.4 4	303	1,602.87	4,375.32	
3009 48	冠中生 态	202 1 年 02 月 18 日	202 1 年 08 月 25 日	新 股 流 通 受 限	8.6 7	27.4 2	324	2,808.00	8,884.08	
6052 87	德才股 份	202 1 年 06 月 28 日	202 1 年 07 月 06 日	新 股 流 通 受 限	31. 56	31.5 6	349	11,014.44	11,014.44	
3009 72	万辰生 物	202 1 年 04 月 08 日	202 1 年 10 月 19 日	新 股 流 通 受 限	7.1 9	12.6 5	430	3,091.70	5,439.50	
3009 82	苏文电 能	202 1 年	202 1 年	新 股 流	15. 83	45.2 9	317	5,018.11	14,356.93	

		04月19日	10月27日	通受限						
301012	扬电科技	2021年06月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	
300981	中红医疗	2021年04月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	
688087	英科再生	2021年06月30日	2021年07月09日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	
605162	新中港	2021年06月29日	2021年07月07日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	
301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	
300930	屹通新材	2021年01月	2021年07月	新股流通受	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	

		13日	21日	限						
301015	百洋医药	2021年06月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	
300933	中辰股份	2021年01月15日	2021年07月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	
300958	建工修复	2021年03月18日	2021年09月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	
300962	中金辐照	2021年03月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	
300967	晓鸣股份	2021年04月02日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

					-	-	-	-	-
--	--	--	--	--	---	---	---	---	---

注：1、本基金持有的流通受限股票“冠中生态”（证券代码：300948）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108股（根据冠中生态2020年年度权益分派实施公告，冠中生态以公司现有总股本93,340,000股为基数，向全体股东每10股派0.80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2021年6月4日。）。

2、认购价格和期末估值单价分别采用认购日和2021年6月30日即期汇率将港币折算为人民币。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2021年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末2021年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末2021年06月30日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。此外,基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。

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,基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

除在附注6.4.12中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外,本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。



#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 1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	172,467,524.94	-	-	-	-	-	172,467,524.94
结算备付金	6,870,979.62	-	-	-	-	-	6,870,979.62
存出保证金	2,324,649.85	-	-	-	-	-	2,324,649.85
交易性金融资产	48,278,808.00	-	88,202,800.00	-	-	2,287,511,833.55	2,423,993,441.55
应	-	-	-	-	-	1,098,532.08	1,098,532.08

收股利							
应收利息		-	-	-	-	2,035,847.49	2,035,847.49
应收申购款		-	-	-	-	8,172,303.70	8,172,303.70
衍生金融资产		-	-	-	-	-	-
应收证券清算款		-	-	-	-	57,940,425.40	57,940,425.40
买入返售金融资产		-	-	-	-	-	-
其他资产		-	-	-	-	-	-
资产总计	229,941,962.41	-	88,202,800.00	-	-	2,356,758,942.22	2,674,903,704.63
负债							
应	-	-	-	-	-	77,499,998.32	77,499,998.32

付 赎 回 款							
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	3,821,722.08	3,821,722.08
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	743,112.61	743,112.61
应 付 证 券 清 算 款	-	-	-	-	-	35,934,357.14	35,934,357.14
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	309,444.68	309,444.68
应 付 交 易 费	-	-	-	-	-	2,590,629.97	2,590,629.97

用							
应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	156,509.59	156,509.59
负债总计	-	-	-	-	-	121,055,774.73	121,055,774.73
利率敏感度缺口	229,941,962.41	-	88,202,800.00	-	-	2,235,703,167.49	2,553,847,929.90
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	148,347,930.17	-	-	-	-	-	148,347,930.17

结算备付金	17,420,209.71	-	-	-	-	-	17,420,209.71
存出保证金	5,450,951.14	-	-	-	-	-	5,450,951.14
交易性金融资产	17,998,200.00	-	33,053,100.00	-	-	1,681,357,880.89	1,732,409,180.89
应收股利	-	-	-	-	-	209,049.91	209,049.91
应收利息	-	-	-	-	-	733,280.81	733,280.81
应收申购款	-	-	-	-	-	52,462,242.55	52,462,242.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	92,844,629.92	92,844,629.92
买	-	-	-	-	-	-	-

入返售金融资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	189,217,291.02	-	33,053,100.00	-	-	1,827,607,084.08	2,049,877,475.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	80,771,880.87	80,771,880.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,503,552.73	2,503,552.73
应付托管费	-	-	-	-	-	486,801.92	486,801.92
应付证券清算款	-	-	-	-	-	73,003,347.81	73,003,347.81
卖出回	-	-	-	-	-	-	-

购金融资产款							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	202,086.58	202,086.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,482,182.99	1,482,182.99
应交税费	-	-	-	-	-	0.04	0.04
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	262,442.31	262,442.31
负债总计	-	-	-	-	-	158,712,295.25	158,712,295.25
利率敏感度	189,217,291.02	-	33,053,100.00	-	-	1,668,894,788.83	1,891,165,179.85

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	129,761.37	45,328.31
	基准利率增加 25 个基点	-129,410.24	-45,211.09

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日			合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的				



资产				
银行存款	3,033,392.09	78,521,533.40	16,906,270.83	98,461,196.32
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	617,328,085.29	875,280,134.97	92,808,380.05	1,585,416,600.31
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	51,366,164.38	-	-	51,366,164.38
应收利息	12.92	17.06	-	29.98
应收股利	-	742,423.68	-	742,423.68
应收申购款	982,354.14	-	-	982,354.14
其他资产	-	-	-	-
资产总计	672,710,008.82	954,544,109.11	109,714,650.88	1,736,968,768.81
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-

债				
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-
应付 证券 清算 款	-	18,650,618.24	12,618,809.86	31,269,428.10
应付 赎回 款	4,066,695.03	-	-	4,066,695.03
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-
应付 托管 费	-	-	-	-
应付 销售 服务 费	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-
应付 利息	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-
递延 所得 税负 债	-	-	-	-
其他 负债	2,728.55	-	-	2,728.55
负债 合计	4,069,423.58	18,650,618.24	12,618,809.86	35,338,851.68
资产 负债 表外	668,640,585.24	935,893,490.87	97,095,841.02	1,701,629,917.13

项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
汇风险敞口净额				
以外币计价的资产				
银行存款	38,926,212.33	11,791,366.31	-	50,717,578.64
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	454,021,945.37	582,976,907.86	-	1,036,998,853.23
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	33,448,948.34	-	33,448,948.34
应收利息	24.14	2.04	-	26.18
应收股利	-	209,049.91	-	209,049.91
应收申购款	4,411,989.79	-	-	4,411,989.79
其他资产	-	-	-	-
资产	497,360,171.63	628,426,274.46	-	1,125,786,446.09

总计				
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付证券清算款	33,484,195.70	-	-	33,484,195.70
应付赎回款	29,780,533.99	-	-	29,780,533.99
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延	-	-	-	-

所得税负债				
其他负债	1,522.00	-	-	1,522.00
负债合计	63,266,251.69	-	-	63,266,251.69
资产负债表外 外汇风险敞口净额	434,093,919.94	628,426,274.46	-	1,062,520,194.40

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	欧元相对人民币升值 5%	4,854,792.05	-
	欧元相对人民币贬值 5%	-4,854,792.05	-
	美元相对人民币升值 5%	33,432,029.26	21,704,696.00
	美元相对人民币贬值 5%	-33,432,029.26	-21,704,696.00
	港币相对人民币升值 5%	46,794,674.54	31,421,313.72
	港币相对人民币贬值 5%	-46,794,674.54	-31,421,313.72

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		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	2,287,511,833.55	89.57	1,681,357,880.89	88.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	136,481,608.00	5.34	51,051,300.00	2.70
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	2,423,993,441.55	94.92	1,732,409,180.89	91.61

注：本基金的股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%。本基金以全球消费行业相关公司股票及存托凭证为主要投资对象，投资于全球消费行业相关公司股票及存托凭证的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	中证主要消费指数上涨 5%	86,406,805.44	62,816,939.29
	中证主要消费指数下跌 5%	-86,406,805.44	-62,816,939.29

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

理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,287,511,833.55	85.52
	其中：普通股	1,932,781,421.08	72.26
	存托凭证	354,730,412.47	13.26
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	136,481,608.00	5.10
	其中：债券	136,481,608.00	5.10
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	179,338,504.56	6.70
8	其他各项资产	71,571,758.52	2.68
9	合计	2,674,903,704.63	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 296,056,247.38 元，占期末净值比例为 11.59%。

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	875,280,134.97	34.27
中国	702,095,233.24	27.49
美国	617,328,085.29	24.17
法国	92,808,380.05	3.63

合计	2,287,511,833.55	89.57
----	------------------	-------

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	17,993,157.70	0.70
20 工业	184,303,044.85	7.22
25 可选消费	1,085,873,899.80	42.52
30 日常消费	476,921,556.89	18.67
35 医疗保健	142,973,748.74	5.60
40 金融	14,731,261.82	0.58
45 信息技术	269,767,001.27	10.56
50 电信服务	78,882,763.78	3.09
55 公用事业	18,428.04	0.00
60 房地产	16,046,970.66	0.63
合计	2,287,511,833.55	89.57

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Li Ning Co. Ltd.	李宁有限公司	2331 HK	香港联合交易所	中国香港	3,319,300	261,830,314.05	10.25
2	Nayuki Holdings Limited	奈雪	2150 HK	香港	中国	12,227,500	165,128,210.59	6.47



		的茶控股有限公司		联合交易所	香港			
3	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co., Ltd.	山西杏花村汾酒厂股份有限公司	600809	上海证券交易所	中国	335,427	150,271,296.00	5.88
4	Pinduoduo Inc.	拼多多	PDD US	纳斯达克交易所	美国	125,959	103,357,156.61	4.05
5	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co., Ltd.	上海百润投资控股集团股份有限公司	002568	深圳证券交易所	中国	1,047,960	99,336,128.40	3.89

		司						
6	LVMH ORD		MC FP	巴黎交易所	法国	18,259	92,808,380.05	3.63
7	Sea Ltd		SE US	纽约证券交易所	美国	51,731	91,767,869.13	3.59
8	lululemon athletica inc.	露露柠檬公司	LULU US	纳斯达克交易所	美国	38,516	90,810,817.72	3.56
9	Bilibili Inc.	哔哩哔哩股份有限公司	BILI US	纳斯达克交易所	美国	104,194	82,010,949.86	3.21
10	Facebook Inc		FB US	纳斯达克交易所	美国	35,456	79,642,734.05	3.12
11	Meituan	美团	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	292,400	77,953,381.52	3.05

12	Imeik Technology Development Co., Ltd.	爱美客技术发展股份有限公司	300896	深圳证券交易所	中国	98,100	77,389,128.00	3.03
13	China Tourism Group Duty Free Corporation Limited	中国旅游集团中免股份有限公司	601888	上海证券交易所	中国	248,699	74,634,569.90	2.92
14	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港联合交易所	中国香港	152,300	74,007,857.86	2.90
15	ANTA Sports Products Limited	安踏体育用品有限公司	2020 HK	香港联合交易所	中国香港	465,720	70,837,979.20	2.77

		司						
16	Orient Overseas (International) Ltd.	东方海外 (国际)有限公司	316 HK	香港 联合交易所	中国 香港	483,000	67,598,678.4 5	2.65
17	ZTO Express (Cayman) Inc.	中通快递 (开曼)有限公司	ZTO US	纽约 证券交易所	美国	313,050	61,377,846.1 6	2.40
18	Kweichow Moutai Co., Ltd.	贵州茅台 酒股份有限公司	60051 9	上海 证券交易所	中国	28,657	58,938,851.9 0	2.31
19	Wuliangye Yibin Co., Ltd	宜宾五粮 液股份有限公司	00085 8	深圳 证券交易所	中国	186,327	55,504,950.0 3	2.17
20	Morimatsu	森	2155	香	中	7,488,00	50,281,063.3	1.97

	International Holdings Company Limited	松国际控股有限公司	HK	港 联 合 交 易 所	国 香 港	0	7	
21	DoorDash Inc		DASH US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	38,437	44,280,563.0 0	1.73
22	AMAZON COM INC	亚 马 逊 公 司	AMZN US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	1,767	39,269,415.0 5	1.54
23	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	江 苏 洋 河 酒 厂 股 份 有 限 公 司	00230 4	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	167,634	34,733,764.8 0	1.36
24	Jiugui Liquor Co., Ltd.	酒 鬼 酒 股 份 有 限 公 司	00079 9	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	128,700	32,895,720.0 0	1.29

25	AUTEK CHINA INC.	欧普康视科技股份有限公司	300595	深圳证券交易所	中国	288,040	29,826,542.00	1.17
26	Chongqing Fuling Zhacai Group Co., Ltd.	重庆市涪陵榨菜集团股份有限公司	002507	深圳证券交易所	中国	713,095	25,975,168.55	1.02
27	Pop Mart International Group Limited	泡泡玛特国际集团有限公司	9992 HK	香港联合交易所	中国香港	339,000	21,719,784.24	0.85
28	Flat Glass Group Co., Ltd	福莱特玻璃	6865 HK	香港联合交易所	中国香港	638,000	16,987,745.28	0.67

		集团 股份 有限 公司		易 所				
29	Futu Holdings Ltd	富 途 控 股 有 限 公 司	FUTU US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	12,538	14,505,705.0 6	0.57
30	InnoCare Pharma Limited	诺 诚 健 华 医 药 有 限 公 司	9969 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	529,000	12,566,862.6 4	0.49
31	Xilinmen Furniture Co., Ltd	喜 临 门 家 具 股 份 有 限 公 司	60300 8	上 海 证 券 交 易 所	中 国	294,800	9,731,348.00	0.38
32	Js Global Lifestyle Company Limited	JS 环 球 生 活 有 限	1691 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	531,000	9,654,083.39	0.38

		公司						
33	Aier Eye Hospital Group Co.,Ltd	爱尔眼科医院集团股份有限公司	300015	深圳证券交易所	中国	119,415	8,476,076.70	0.33
34	Greentown Management Holdings Company Limited	绿城管理控股有限公司	9979 HK	香港联合交易所	中国香港	1,728,000	7,749,926.55	0.30
35	Xinyi Solar Holdings Limited	信义光能控股有限公司	968 HK	香港联合交易所	中国香港	546,000	7,614,330.80	0.30
36	Tesla, Inc.	特斯拉	TSLA US	纳斯达克交易所	美国	1,643	7,214,297.94	0.28
37	Fujian Anjoy Foods	福	60334	上	中	27,400	6,960,148.00	0.27



	Co., Ltd.	建安井食品股份有限公司	5	海 证 券 交 易 所	国			
38	Bosideng International Holdings Ltd.	波司登国际控股有限公司	3998 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,490,000	6,880,885.56	0.27
39	China Resources Mixc Lifestyle Services Limited	华润万象生活有限公司	1209 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	145,000	6,412,632.54	0.25
40	Beijing Kingsoft Office Software, Inc.	北京金山办公软件股份有限公司	688111	上 海 证 券 交 易 所	中 国	14,500	5,724,600.00	0.22

		公司						
41	Kuaishou Technology	快手科技	1024 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	30,000	4,862,675.52	0.19
42	Bloomage Biotechnology Corporation Limited	华熙生物科技股份有限公司	68836 3	上海 证券 交易所	中国	13,187	3,664,139.82	0.14
43	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	药明生物技术有限公司	2269 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	25,900	3,066,689.09	0.12
44	Guangdong Xinbao Electrical Appliances Holdings Co., Ltd	广东新宝电器股份有限公司	00270 5	深圳 证券 交易所	中国	112,500	2,953,125.00	0.12
45	Proya Cosmetics	珀	60360	上	中	14,300	2,812,953.00	0.11

	Co., Ltd.	莱雅化妆品股份有限公司	5	海 证 券 交 易 所	国			
46	Angel Yeast Co., Ltd	安琪酵母股份有限公司	600298	上 海 证 券 交 易 所	中 国	46,100	2,506,918.00	0.10
47	Luzhou Laojiao Co., Ltd	泸州老窖股份有限公司	000568	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	10,293	2,428,530.42	0.10
48	Wenzhou Kangning Hospital Co., Ltd.	温州康宁医院股份有限公司	2120 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	57,700	2,366,943.09	0.09
49	Yunnan Botanee	云	30095	深	中	8,523	2,298,784.18	0.09

	Bio-Technology Group Co. LTD	南贝泰妮生物科技集团股份有限公司	7	圳 证 券 交 易 所	国			
50	D&O Home Collection Co., Ltd	帝欧家居股份有限公司	002798	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	133,000	2,072,140.00	0.08
51	Ever Sunshine Lifestyle Services Group Limited	永升生活服务集团有限公司	1995HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	117,300	1,881,785.53	0.07
52	Microport Cardioflow Medtech Corporation	微创心通医疗	2160HK	香 港 联 合 交 易	中 国 香 港	110,000	1,495,580.59	0.06

		科 技 有 限 公 司		所				
53	JD.com, Inc.	京 东 集 团 股 份 有 限 公 司	JD US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	1,709	881,127.21	0.03
53	JD.com, Inc.	京 东 集 团 股 份 有 限 公 司	9618 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	2,200	559,057.91	0.02
54	Beijing Roborock Technology Co., Ltd.	北 京 石 头 世 纪 科 技 股 份 有 限 公 司	68816 9	上 海 证 券 交 易 所	中 国	951	1,199,211.00	0.05
55	New Frontier Health Corp	新 风 医 疗	NFH US	纽 约 证 券	美 国	15,900	1,147,333.14	0.04

		集团		交易所				
56	China Yuhua Education Corporation Limited	中国宇华教育集团有限公司	6169 HK	香港联合交易所	中国香港	180,000	1,052,914.03	0.04
57	Zwsoft Co., Ltd. (Guangzhou)	广州中望龙腾软件股份有限公司	688083	上海证券交易所	中国	1,837	1,014,575.10	0.04
58	Man Wah Holdings Limited	敏华控股有限公司	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	63,600	987,492.57	0.04
59	Three Squirrels Inc.	三只松鼠股份有	300783	深圳证券交易所	中国	20,500	970,880.00	0.04

		限公司						
60	Tongcheng-Elong Holdings Limited	同程艺龙控股有限公司	780 HK	香港联合交易所	中国香港	55,200	892,895.06	0.03
61	Joyy Inc.	欢聚集团	YY US	纳斯达克交易所	美国	1,947	829,758.44	0.03
62	China Railway Construction Heavy Industry Corporation Limited	中国铁建重工集团股份有限公司	688425	上海证券交易所	中国	135,282	827,925.84	0.03
63	Sansure Biotech Inc.	圣湘生物科技股份有限公司	688289	上海证券交易所	中国	6,806	676,856.70	0.03

		公司						
64	Ligao Foods Co.,Ltd	立高食品股份有限公司	300973	深圳证券交易所	中国	3,593	542,770.60	0.02
65	China East Education Holdings Limited	中国东方教育控股有限公司	667HK	香港联合交易所	中国香港	52,500	532,947.24	0.02
66	Shanghai Electric Wind Power Group Co., Ltd.	上海电气风电集团股份有限公司	688660	上海证券交易所	中国	51,238	450,894.40	0.02
67	Suzhou Nanomicro Technology Co., Ltd.	苏州纳微科技	688690	上海证券交易所	中国	3,477	408,547.50	0.02



		股份有限公司		所				
68	Shenzhen Xinyichang Technology Co., Ltd.	深圳新益昌科技股份有限公司	688383	上海证券交易所	中国	2,701	380,868.01	0.01
69	Yihai Kerry Arawana Holdings Co., Ltd	益海嘉里金龙鱼粮油食品股份有限公司	300999	深圳证券交易所	中国	4,391	373,059.36	0.01
70	Changchun Bcht Biotechnology Co.	长春百克生物科技	688276	上海证券交易所	中国	3,486	364,565.88	0.01

		股份 公司						
71	Sinopep-Allsino Bio Pharmaceutical Co., Ltd.	江苏 诺泰 澳赛 诺生 物制 药股 份有 限公 司	68807 6	上 海 证 券 交 易 所	中 国	4,984	339,958.64	0.01
72	Shandong Weigao Orthopaedic Device Co., Ltd.	山 东 威 高 骨 科 材 料 股 份 有 限 公 司	68816 1	上 海 证 券 交 易 所	中 国	3,069	325,467.45	0.01
73	Kaili Catalyst & New Materials Co., Ltd	西 安 凯 立 新 材 料 股 份	68826 9	上 海 证 券 交 易 所	中 国	1,941	270,808.32	0.01

		有限公司						
74	Qingdao Baheal Medical INC.	青岛百洋医药股份有限公司	301015	深圳证券交易所	中国	4,614	251,115.78	0.01
75	Roblox Corp		RBLX US	纽约证券交易所	美国	400	232,511.92	0.01
76	Joinn Laboratories (China) Co., Ltd.	北京昭衍新药研究中心股份有限公司	6127 HK	香港联合交易所	中国香港	1,960	203,859.60	0.01
77	Guangdong Greenway Technology Co., Ltd.	广东博力威	688345	上海证券交易所	中国	2,332	171,518.60	0.01

		科技股份有限公司		易所				
78	Shenzhen Lihexing Co., Ltd	深圳市利和兴股份有限公司	301013	深圳证券交易所	中国	4,704	168,966.51	0.01
79	Zhejiang Lante Optics Co., Ltd.	浙江蓝特光学股份有限公司	688127	上海证券交易所	中国	5,322	148,004.82	0.01
80	Gch Technology Co., Ltd.	呈和科技股份有限公司	688625	上海证券交易所	中国	2,672	142,764.96	0.01
81	Rayitek Hi-Tech Film Company Ltd.,	深圳	688323	上海	中国	4,513	142,565.67	0.01

	Shenzhen	瑞华泰薄膜科技股份有限公司		证券交易所				
82	Suzhou Uigreen Micro&Nano Technologies Co.,Ltd	苏州和林微纳科技股份有限公司	688661	上海证券交易所	中国	1,452	136,705.80	0.01
83	China Chippacking Technology Co.,Ltd.	气派科技股份有限公司	688216	上海证券交易所	中国	2,000	133,400.00	0.01
84	Pansoft Company Limitid	普联软件股份有	300996	深圳证券交易所	中国	2,410	132,487.34	0.01

		限公司						
85	Beijing Sun-Nov Pharmaceutical Research Co.,Ltd.	北京阳光诺和药物研究股份有限公司	688621	上海证券交易所	中国	1,485	131,868.00	0.01
86	Caida Securities Co.,Ltd	财达证券股份有限公司	600906	上海证券交易所	中国	7,597	128,237.36	0.01
87	Great Wall Motor Company Limited	长城汽车股份有限公司	2333 HK	香港联合交易所	中国香港	6,000	125,311.25	0.00
88	Nanjing Railway New Technology Co.,Ltd.	南京雷尔伟	301016	深圳证券交	中国	2,747	115,711.58	0.00

		新 技 术 股 份 有 限 公 司		易 所				
89	Jiangxi GETO New Materials Corporation Limited	江 西 志 特 新 材 料 股 份 有 限 公 司	30098 6	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	2,632	103,429.84	0.00
90	Jiangsu Hanvo Safety Product Co., Ltd.	江 苏 恒 辉 安 防 股 份 有 限 公 司	30095 2	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	3,398	95,320.48	0.00
91	Shenzhen Chuangyitong Technology Co.,Ltd.	深 圳 市 创 益 通 技 术 股 份	30099 1	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	2,535	89,214.50	0.00

		有限公司						
92	Guangdong Lyric Robot Automation Co., Ltd.	广东利元亨智能装备股份有限公司	688499	上海证券交易所	中国	2,149	83,488.65	0.00
93	Huali Industrial Group Company Limited	中山华利实业集团股份有限公司	300979	深圳证券交易所	中国	925	80,937.50	0.00
94	Cheng Du Sheng Nuo Biotec Co., Ltd.	成都圣诺生物科技股份有限公司	688117	上海证券交易所	中国	1,672	80,924.80	0.00



		限公司						
95	Ningbo Deye Technology Co., Ltd.	宁波德业科技股份有限公司	605117	上海证券交易所	中国	627	80,005.20	0.00
96	Guangzhou Wahlap Technology Corporation Limited	广州华立科技股份有限公司	301011	深圳证券交易所	中国	1,750	79,474.50	0.00
97	Guangzhou Sanfu New Materials Technology Co., Ltd	广州三孚新材料科技股份有限公司	688359	上海证券交易所	中国	2,213	78,561.50	0.00
98	Yangling Metron New Material Co., Ltd.	杨凌	300861	深圳	中国	895	75,457.45	0.00

		美畅新材料股份有限公司		证券交易所				
99	Chengdu Zhimingda Electronics Co., Ltd.	成都智明达电子股份有限公司	688636	上海证券交易所	中国	918	74,100.96	0.00
100	Fujian Wanchen Biotechnology Co., Ltd.	福建万辰生物科技股份有限公司	300972	深圳证券交易所	中国	4,300	71,539.10	0.00
101	Zhiyang Innovation Technology Co., Ltd.	智洋创新科技	688191	上海证券交易所	中国	3,203	69,184.80	0.00

		股份有限公司		所				
10 2	Guangdong Shenling Environmental Systems Co., Ltd.	广东申菱环境系统股份有限公司	301018	深圳证券交易所	中国	7,811	64,753.19	0.00
10 3	Chemclin Diagnostics Co., Ltd.	科美诊断技术股份有限公司	688468	上海证券交易所	中国	3,919	64,663.50	0.00
10 4	Suzhou Gyz Electronic Technology Co., Ltd.	苏州昀冢电子科技有限公司	688260	上海证券交易所	中国	2,990	64,105.60	0.00

		公司						
10 5	Shenzhen Xunjiexing Technology Corp. Ltd.	深圳市迅捷兴科技股份有限公司	68865 5	上海 证券 交易 所	中国	3,083	62,893.20	0.00
10 6	Qilu Bank Co.,Ltd	齐鲁银行股份有限公司	60166 5	上海 证券 交易 所	中国	6,731	62,598.30	0.00
10 7	Dalian Demaishi Precision Technology Co.,Ltd.	大连德迈仕精密科技股份有限公司	30100 7	深圳 证券 交易 所	中国	3,022	60,305.15	0.00
10 8	Hangzhou Kelin Electric Co.Ltd.	杭州柯	68861 1	上海 证	中国	1,400	59,276.00	0.00

		林电气股份有限公司		券交易所				
109	Aima Technology Group Co., Ltd.	爱玛科技集团股份有限公司	603529	上海证券交易所	中国	1,019	59,224.28	0.00
110	Optowide Technologies Co., Ltd.	腾景科技股份有限公司	688195	上海证券交易所	中国	2,693	58,626.61	0.00
111	Zhejiang Taifu Pump Co., Ltd	浙江泰福泵业股份有限公司	300992	深圳证券交易所	中国	1,998	55,828.42	0.00
11	Zhonghong Pulin	中	30098	深	中	601	54,324.39	0.00

2	Medical Products Co., Ltd.	红普林医疗用品股份有限公司	1	圳	国			
				证				
				券				
				交				
				易				
				所				
113	Shandong Intco Recycling Resources Co., Ltd.	山东英科环保再生资源股份有限公司	688087	上	中	2,469	54,219.24	0.00
				海				
				证				
				券				
				交				
				易				
				所				
114	Jiangsu Jingxue Insulation Technology Co., Ltd.	江苏晶雪节能科技股份有限公司	301010	深	中	2,172	50,480.96	0.00
				圳				
				证				
				券				
				交				
				易				
				所				
11	Eastern Air	东	60115	上	中	2,090	49,470.30	0.00

5	Logistics Co., Ltd.	方航空物流股份有限公司	6	海 证 券 交 易 所	国			
11 6	Shu Yu Civilian Pharmacy Corp., Ltd.	漱玉平民大药房连锁股份有限公司	30101 7	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	5,550	49,173.00	0.00
11 7	Anhui Yuanchen Environmental Protection Science & Technology Co., Ltd.	安徽元琛环保科技有限公司	68865 9	上 海 证 券 交 易 所	中 国	3,671	48,530.62	0.00
11 8	Zhejiang Haiyan Power System Resources Environmental	浙江海盐	68856 5	上 海 证 券	中 国	2,464	44,376.64	0.00

	Technology Co.,Ltd	力源环保科技股份有限公司		交易所				
119	Jinguan Electric Co., Ltd.	金冠电气股份有限公司	688517	上海证券交易所	中国	2,892	41,095.32	0.00
120	Ave Science&Technology Co.,Ltd	爱威科技股份有限公司	688067	上海证券交易所	中国	1,259	39,520.01	0.00
121	Namchow Food Group( Shanghai) Co., Ltd.	南侨食品集团(上海)股份有限公司	605339	上海证券交易所	中国	864	37,307.52	0.00



		公司						
12 2	Shandong Kehui Power Automation Co., Ltd.	山东科汇电力自动化股份有限公司	688681	上海证券交易所	中国	1,899	34,903.62	0.00
12 3	Zhejiang Shaoxing Ruifeng Rural Commercial Bank Co., Ltd.	浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司	601528	上海证券交易所	中国	2,230	34,721.10	0.00
12 4	Suzhou Weizhixiang Food Co., Ltd.	苏州市味知香食品股	605089	上海证券交易所	中国	370	32,197.40	0.00

		份有限公司						
12 5	Shenzhen Honor Electronic Co., Ltd.	深圳欧陆通电子股份有限公司	300870	深圳证券交易所	中国	478	29,884.56	0.00
12 6	INNO LASER TECHNOLOGY CO., LTD.	英诺激光科技股份有限公司	301021	深圳证券交易所	中国	2,899	27,424.54	0.00
12 7	Dongrui Food Group Co., Ltd.	东瑞食品集团股份有限公司	001201	深圳证券交易所	中国	668	27,347.92	0.00
12 8	Yunnan Shennong Agricultural	云南	605296	上海	中国	569	26,856.80	0.00

	Industry Group Co., Ltd.	神农农业产业集团股份有限公司		证券交易所				
129	Wangli Security & Surveillance Product Co., Ltd	王力安防科技股份有限公司	605268	上海证券交易所	中国	1,642	22,659.60	0.00
130	Shandong Link Science and Technology Co., Ltd.	山东联科科技股份有限公司	001207	深圳证券交易所	中国	682	22,581.02	0.00
131	Zhejiang Entive Smart Kitchen Appliance Co., Ltd.	浙江亿田智能	300911	深圳证券交易所	中国	309	21,407.52	0.00

		厨电股份有限公司		所				
13 2	JiangSu Changling Hydraulic Co.,Ltd	江苏长龄液压股份有限公司	60538 9	上海 证券 交易 所	中国	356	20,890.08	0.00
13 3	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒股份有限公司	168 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	300	20,868.57	0.00
13 4	Tianjin Yiyi Hygiene Products Co., ltd.	天津市依依卫生用品股份有限公司	00120 6	深圳 证券 交易 所	中国	321	20,389.92	0.00

		司						
13 5	Guangdong Huiyun Titanium Industry Co., Ltd.	广东惠云钛业股份有限公司	300891	深圳证券交易所	中国	1,143	19,876.77	0.00
13 6	Nanjing Shenghang Shipping Co., Ltd.	南京盛航海运股份有限公司	001205	深圳证券交易所	中国	577	18,850.59	0.00
13 7	Panda Dairy Corporation	熊猫乳品集团股份有限公司	300898	深圳证券交易所	中国	496	17,984.96	0.00
13 8	Wetown Electric Group Co., Ltd.	威腾电气集团股	688226	上海证券交易所	中国	2,693	17,289.06	0.00

		份有限公司						
139	Zhongjing Food Co., Ltd.	仲景食品股份有限公司	300908	深圳证券交易所	中国	285	16,983.15	0.00
140	Shenzhen Hui Chuang Da Technology Co., Ltd	深圳市汇创达科技股份有限公司	300909	深圳证券交易所	中国	386	16,636.60	0.00
141	TES Touch Embedded Solutions (Xiamen) Co., Ltd.	宸展光电(厦门)股份有限公司	003019	深圳证券交易所	中国	601	16,263.06	0.00
142	Hebei Huatong Wires and Cables Group Co., Ltd	河北华	605196	上海证	中国	1,172	16,079.84	0.00

		通 线 缆 集 团 股 份 有 限 公 司		券 交 易 所				
14 3	Jiahe Foods Industry Co., Ltd.	佳 禾 食 品 工 业 股 份 有 限 公 司	60530 0	上 海 证 券 交 易 所	中 国	576	16,012.80	0.00
14 4	Bondex Supply Chain Management Co., Ltd.	海 程 邦 达 供 应 链 管 理 股 份 有 限 公 司	60383 6	上 海 证 券 交 易 所	中 国	733	15,994.06	0.00
14 5	Suwen Electric Energy Technology Co., Ltd.	苏 文 电 能 科 技	30098 2	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	317	14,356.93	0.00

		股份有限公司		所				
14 6	Shandong Bailong Chuangyuan Bio-Tech Co., Ltd.	山东百龙创园生物科技股份有限公司	60501 6	上海 证券 交易 所	中国	445	14,222.20	0.00
14 7	Guangdong Green Precision Components Co., Ltd.	广东格林精密部件股份有限公司	30096 8	深圳 证券 交易 所	中国	1,162	14,025.34	0.00
14 8	Wuxi Zhenhua Auto Parts Co., Ltd.	无锡市振华汽车部	60531 9	上海 证券 交易 所	中国	764	13,706.16	0.00



		件股份有限公司						
149	Hunan Valin Wire&Cable Co.,Ltd.	湖南华菱线缆股份有限公司	001208	深圳证券交易所	中国	1,754	13,558.42	0.00
150	Henan BCCY Environmental Energy Co.,Ltd	河南百川畅银环保能源股份有限公司	300614	深圳证券交易所	中国	329	13,285.02	0.00
151	Shenzhen Bioeasy Biotechnology Co., Ltd.	深圳市易瑞生物技术	300942	深圳证券交易所	中国	443	12,634.36	0.00

		股份有限公司						
15 2	Pinlive Foods Co., Ltd.	品渥食品股份有限公司	300892	深圳证券交易所	中国	272	12,479.36	0.00
15 3	Servyou Software Group Co., Ltd.	税友软件集团股份有限公司	603171	上海证券交易所	中国	637	12,230.40	0.00
15 4	Jiangsu Tongli Risheng Machinery Co., Ltd.	江苏同力日升机械股份有限公司	605286	上海证券交易所	中国	597	12,208.65	0.00
15 5	HUANLEJIA Food Group Co., Ltd.	欢乐	300997	深圳	中国	928	12,110.40	0.00

		家食品集团股份有限公司		证券交易所				
156	Shenzhen Exc-Led Technology Co., Ltd	深圳爱克莱特科技股份有限公司	300889	深圳证券交易所	中国	479	11,639.70	0.00
157	Sinostar Cable Co., Ltd.	中辰电缆股份有限公司	300933	深圳证券交易所	中国	1,112	11,609.28	0.00
158	Zhejiang Fulai New Material Co., Ltd.	浙江福莱新材料股份	605488	上海证券交易所	中国	416	11,103.04	0.00

		有限公司						
159	Decai Decoration Co., Ltd	德才装饰股份有限公司	605287	上海证券交易所	中国	349	11,014.44	0.00
160	Jahen Household Products Co., Ltd.	嘉亨家化股份有限公司	300955	深圳证券交易所	中国	232	10,688.24	0.00
161	Lutian Machinery Co., Ltd.	绿田机械股份有限公司	605259	上海证券交易所	中国	295	10,516.75	0.00
162	Longyan Kaolin Clay Co., Ltd.	龙岩高岭土股份有限公司	605086	上海证券交易所	中国	443	10,512.39	0.00

		司						
16 3	Wuhu Fuchun Dye and Weave Co., Ltd.	芜湖富春染织股份有限公司	60518 9	上海 证 券 交 易 所	中 国	422	10,165.98	0.00
16 4	Zhejiang Truelove Vogue Co., Ltd	浙江真爱美家股份有限公司	00304 1	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	349	9,876.70	0.00
16 5	Zhongjin Irradiation Incorporated Company	中金辐照股份有限公司	30096 2	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	576	9,429.12	0.00
16 6	Hubei Goto Biopharm Co., Ltd.	湖北共同药业股份有	30096 6	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	286	9,020.44	0.00

		限公司						
167	Guangdong Jushen Logistics Company Limited	广东炬申物流股份有限公司	001202	深圳证券交易所	中国	459	9,014.76	0.00
168	Mclon Jewellery Co.,Ltd.	曼卡龙珠宝股份有限公司	300945	深圳证券交易所	中国	474	8,949.12	0.00
169	Qingdao Greensum Ecology Co.,Ltd.	青岛冠中生态股份有限公司	300948	深圳证券交易所	中国	324	8,884.08	0.00
170	Doright Co.,Ltd.	青岛德固特节	300950	深圳证券交易所	中国	219	8,569.47	0.00

		能装备股份有限公司		所				
17 1	Zhejiang Xinzhonggang Thermal Power Co., LTD.	浙江新中港热电股份有限公司	60516 2	上海 证券 交易 所	中国	1,377	8,358.39	0.00
17 2	BCEG Environmental Remediation Co., Ltd.	北京建工环境修复股份有限公司	30095 8	深圳 证券 交易 所	中国	300	8,166.00	0.00
17 3	Shandong Yuma Sun-Shading Technology Corp., Ltd.	山东玉马遮阳科技	30099 3	深圳 证券 交易 所	中国	410	7,908.90	0.00

		股份有限公司						
174	Hang Zhou Yitong New Materials Co.,Ltd.	杭州屹通新材料股份有限公司	300930	深圳证券交易所	中国	322	7,882.56	0.00
175	Jiangsu Bide Science and Technology Co., Ltd.	江苏必得科技股份有限公司	605298	上海证券交易所	中国	391	7,847.37	0.00
176	Xiangyang BOYA Precision Industrial Equipments Co., Ltd.	襄阳博亚精工装备股份有限公司	300971	深圳证券交易所	中国	245	6,931.05	0.00



		司						
17 7	Zhejiang Chunhui Intelligent Control Co., Ltd.	浙江春晖 智能控制 股份有限 公司	30094 3	深圳证 券交易 所	中国	255	5,867.55	0.00
17 8	Ningxia Xiaoming Agriculture & Animal Husbandry Co., Ltd.	宁夏晓鸣 农牧股份 有限公 司	30096 7	深圳证 券交易 所	中国	507	5,850.78	0.00
17 9	Anhui Huaqi Environmental Protection&Technol ogy Co.,Ltd.	安徽华 骐环保 科技股 份有限 公司	30092 9	深圳证 券交易 所	中国	183	5,407.65	0.00
18 0	Hangzhou Cogeneration Group Co., Ltd.	杭州热	60501 1	上海证	中国	525	4,662.00	0.00

		电集团股份有限公司		券交易所				
18 1	Guangdong Kitech New Material Holding Co., Ltd.	广东奇德新材料股份有限公司	30099 5	深圳证 券交易 所	中国	191	4,454.12	0.00
18 2	Jiangsu Yangdian Science&Technology Co. Ltd.	江苏扬电科技股份有限公司	30101 2	深圳证 券交易 所	中国	170	4,124.20	0.00
18 3	China Feihe Limited	中国飞鹤有限公司	6186 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	200	2,789.13	0.00
18 4	Central China New Life Limited	建业	9983 HK	香港	中国	400	2,626.04	0.00

		新生活有限公司		联合交易所	香港			
185	Tianli Education International Holdings Limited	天立教育国际控股有限公司	1773 HK	香港联合交易所	中国香港	800	1,963.71	0.00
186	Shandong Pharmaceutical Glass Co., Ltd	山东省药用玻璃股份有限公司	600529	上海证券交易所	中国	50	1,697.50	0.00

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Wuliangye Yibin Co., Ltd	000858	294,157,795.00	15.55
2	Focus Media	002027	273,430,057.64	14.46

	Information Technology Co., Ltd.			
3	Kweichow Moutai Co., Ltd.	600519	258,983,704.64	13.69
4	Tencent Holdings Ltd	700 HK	237,944,624.85	12.58
5	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co., Ltd.	600809	229,287,528.74	12.12
6	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	221,935,414.04	11.74
7	Nayuki Holdings Limited	2150 HK	201,450,312.36	10.65
8	Pinduoduo Inc.	PDD US	186,021,950.86	9.84
9	Vipshop Holdings Ltd	VIPS US	164,815,929.85	8.72
10	Yalla Group Ltd	YALA US	164,060,928.11	8.68
11	Meituan	3690 HK	153,675,345.82	8.13
12	Luzhou Laojiao Co., Ltd	000568	147,722,965.75	7.81
13	Imeik Technology Development Co., Ltd.	300896	143,308,915.89	7.58
14	Joyy Inc.	YY US	138,536,710.21	7.33
15	Aier Eye Hospital Group Co., Ltd	300015	137,015,662.78	7.25
16	Smoore International Holdings Limited	6969 HK	134,823,900.12	7.13
17	China Tourism Group Duty Free Corporation Limited	601888	127,585,843.75	6.75
18	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co., Ltd.	002568	122,295,379.46	6.47
19	Bilibili Inc.	BILI US	97,650,804.97	5.16
20	Haier Smart Home Co., Ltd.	6690 HK	75,525,594.72	3.99
20	Haier Smart Home Co., Ltd.	600690	21,727,615.37	1.15
21	LVMH ORD	MC FP	94,455,783.49	4.99
22	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	2269 HK	88,310,556.29	4.67
23	ZTO Express (Cayman) Inc.	ZTO US	84,236,566.49	4.45
24	lululemon athletica inc.	LULU US	84,111,927.01	4.45
25	Xiaomi Corporation	1810 HK	83,348,529.21	4.41
26	Country Garden	6098 HK	81,071,469.61	4.29

	Services Holdings Company Limited			
27	Js Global Lifestyle Company Limited	1691 HK	40,311,893.39	2.13
27	Js Global Lifestyle Company Limited	01691	39,629,036.04	2.10
28	Sea Ltd	SE US	78,830,909.04	4.17
29	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co.,Ltd.	603882	76,892,340.88	4.07
30	Facebook Inc	FB US	71,821,471.62	3.80
31	Man Wah Holdings Limited	1999 HK	69,284,048.38	3.66
32	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	68,933,809.14	3.65
33	Betta Pharmaceuticals Co.,Ltd	300558	67,226,298.38	3.55
34	Orient Overseas (International) Ltd.	316 HK	66,653,245.96	3.52
35	Futu Holdings Ltd	FUTU US	66,124,444.36	3.50
36	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	002304	63,753,911.56	3.37
37	Tsingtao Brewery Company Limited	168 HK	57,786,762.28	3.06
37	Tsingtao Brewery Company Limited	600600	3,550,327.00	0.19
38	Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai	000651	60,907,212.64	3.22
39	Innovent Biologics, Inc.	1801 HK	56,051,187.77	2.96
40	New Horizon Health Limited	6606 HK	53,723,242.74	2.84
41	Chongqing Fuling Zhacai Group Co.,Ltd.	002507	52,868,600.35	2.80
42	Shandong Pharmaceutical Glass Co.,Ltd	600529	52,070,310.20	2.75
43	AMAZON COM INC	AMZN US	46,225,416.35	2.44
44	DoorDash Inc	DASH US	45,441,587.81	2.40
45	Li Auto Inc.	LI US	43,033,579.11	2.28

46	Jiangsu King's Luck Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	603369	42,278,542.38	2.24
47	Xiabuxiabu Catering Management (China) Holdings Co., Ltd.	520 HK	40,087,025.65	2.12
48	Wanhua Chemical Group Co., Ltd.	600309	39,271,399.74	2.08
49	Morimatsu International Holdings Company Limited	2155 HK	38,609,065.17	2.04

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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Focus Media Information Technology Co., Ltd.	002027	349,879,181.03	18.50
2	Wuliangye Yibin Co., Ltd	000858	314,928,447.80	16.65
3	Tencent Holdings Ltd	700 HK	248,306,352.11	13.13
4	Kweichow Moutai Co., Ltd.	600519	247,994,417.00	13.11
5	Luzhou Laojiao Co., Ltd	000568	203,003,148.65	10.73
6	China Tourism Group Duty Free Corporation Limited	601888	174,756,765.08	9.24
7	Vipshop Holdings Ltd	VIPS US	160,849,735.51	8.51
8	Xiaomi Corporation	1810 HK	143,852,435.87	7.61
9	Meituan	3690 HK	142,983,678.85	7.56
10	Yalla Group Ltd	YALA US	140,003,163.49	7.40
11	Joyy Inc.	YY US	136,677,936.20	7.23
12	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co., Ltd.	600809	135,112,748.61	7.14
13	Smoore International Holdings Limited	6969 HK	130,476,839.67	6.90
14	Bilibili Inc.	BILI US	129,915,649.00	6.87

15	Pinduoduo Inc.	PDD US	119,442,070.18	6.32
16	Man Wah Holdings Limited	1999 HK	116,362,193.21	6.15
17	Haier Smart Home Co., Ltd.	6690 HK	78,506,315.89	4.15
17	Haier Smart Home Co., Ltd.	600690	23,154,003.00	1.22
18	APPLE INC	AAPL US	99,615,894.24	5.27
19	Aier Eye Hospital Group Co., Ltd	300015	95,525,696.75	5.05
20	Imeik Technology Development Co., Ltd.	300896	95,287,803.38	5.04
21	Country Garden Services Holdings Company Limited	6098 HK	91,143,917.53	4.82
22	Tesla, Inc.	TSLA US	87,603,913.21	4.63
23	Futu Holdings Ltd	FUTU US	82,534,154.88	4.36
24	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	77,331,766.51	4.09
25	Innovent Biologics, Inc.	1801 HK	72,582,551.03	3.84
26	AMAZON COM INC	AMZN US	71,018,066.85	3.76
27	Tsingtao Brewery Company Limited	168 HK	63,122,096.60	3.34
27	Tsingtao Brewery Company Limited	600600	6,120,999.00	0.32
28	Tianli Education International Holdings Limited	1773 HK	65,164,169.60	3.45
29	Js Global Lifestyle Company Limited	01691	35,563,002.41	1.88
29	Js Global Lifestyle Company Limited	1691 HK	26,422,185.96	1.40
30	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	2269 HK	60,613,847.09	3.21
31	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co., Ltd.	603882	60,243,691.00	3.19
32	Betta Pharmaceuticals Co., Ltd	300558	57,240,866.16	3.03
33	Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai	000651	57,195,370.91	3.02

34	Songcheng Performance Development Co., Ltd	300144	54,495,428.82	2.88
35	Shandong Pharmaceutical Glass Co., Ltd	600529	52,890,171.62	2.80
36	Great Wall Motor Company Limited	2333 HK	52,008,361.26	2.75
37	Jiangsu King's Luck Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	603369	42,492,454.40	2.25
38	Bosideng International Holdings Ltd.	3998 HK	42,131,013.95	2.23
39	New Horizon Health Limited	6606 HK	39,555,670.20	2.09
40	Li Auto Inc.	LI US	39,370,413.97	2.08

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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	6,302,400,582.89
卖出收入（成交）总额	5,543,187,129.18

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A-至 A+	136,333,000.00	5.34
无评级	148,608.00	0.01

注：本基金债券投资组合主要采用穆迪、标准普尔等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息。

### 7.7 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	210401	21 农发 01	700,000	70,147,000.00	2.75
2	019640	20 国债 10	330,000	33,000,000.00	1.29
3	019645	20 国债 15	180,000	18,055,800.00	0.71
4	010107	21 国债 (7)	151,000	15,130,200.00	0.59
5	113616	韦尔转 债	960	148,608.00	0.01

### 7.8 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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明 细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 7.11.2

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。

#### 7.11.3 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	2,324,649.85
2	应收证券清算款	57,940,425.40
3	应收股利	1,098,532.08
4	应收利息	2,035,847.49
5	应收申购款	8,172,303.70
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,571,758.52

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	2150 HK	Nayuki Holdings Limited	165,128,210.59	6.47	新股配售流通受限

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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(%)
添富全球消费混合(QDII)人民币A	143,671	4,474.90	200,699,993.72	31.22	442,213,064.99	68.78
添富全球消费混合(QDII)人民币C	70,995	1,894.85	2,026,194.38	1.51	132,498,563.42	98.49
添富全球消费混合(QDII)	3,618	6,142.08	0.00	0.00	22,222,048.21	100.00

美元现汇						
合计	218,284	3,663.39	202,726,188.10	25.35	596,933,676.62	74.65

注：表内美元现汇份额以及占比未按汇率进行折算。

## 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	添富全球消费混合(QDII)人民币A	7,235,270.66	1.13
	添富全球消费混合(QDII)人民币C	121,074.20	0.09
	添富全球消费混合(QDII)美元现汇	5,299.54	0.02
	合计	7,361,644.40	0.92

注：如果将美元现汇份额按照 2021 年 06 月 30 日中国人民银行美元兑换人民币汇率中间价折算为人民币份额后进行计算，美元份额的管理人所有从业人员持有本基金为 34,235.56 份；从业人员持有本基金合计份额为 7,390,580.42 份，合计份额占比为 0.80%。

## 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	添富全球消费混合(QDII)人民币A	>100
	添富全球消费混合(QDII)人民币C	0
	添富全球消费混合(QDII)美元现汇	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	添富全球消费混合(QDII)人民币A	10~50
	添富全球消费混合(QDII)人民币C	0
	添富全球消费混合(QDII)美元现汇	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	添富全球消费混合(QDII)人民币 A	添富全球消费混合(QDII)人民币 C	添富全球消费混合(QDII)美元现汇
基金合同生效日(2018年09月21日)基金份额总额	285,568,522.32	62,178,897.96	3,255,290.62
本报告期期初基金份额总额	475,545,936.10	94,868,647.07	15,819,615.87
本报告期基金总申购份额	540,181,762.36	197,387,138.44	13,239,490.09
减:本报告期基金总赎回份额	372,814,639.75	157,731,027.71	6,837,057.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	642,913,058.71	134,524,757.80	22,222,048.21

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 (%)	
兴业证券	2	2,722,513,423.01	23.03	2,385,966.23	22.79	
东方证券	2	1,767,903,724.63	14.95	1,555,591.21	14.86	
安信证券	2	1,532,210,027.83	12.96	1,365,690.30	13.04	
CGS-CIMB Securities (Singapore)	-	697,661,178.60	5.90	161,266.32	1.54	
Goldman Sachs	-	603,360,567.24	5.10	265,826.45	2.54	
Sanford C. Bernstein	-	577,360,428.45	4.88	171,134.98	1.63	
JPMorgan Securities	-	533,465,250.65	4.51	160,039.63	1.53	
Jefferies International	-	511,199,361.44	4.32	155,078.08	1.48	
长江证券	1	480,851,267.03	4.07	447,816.24	4.28	
Huatai Securities (HK)	-	430,035,419.37	3.64	2,197,371.21	20.99	
Wolfe Research	-	427,139,451.49	3.61	176,245.65	1.68	
国泰君安	2	265,736,870.67	2.25	247,480.76	2.36	
Macquarie	-	234,053,534.17	1.98	70,216.24	0.67	
Haitong	-	229,713,564.14	1.94	146,595.14	1.40	

International Securities						
Morgan Stanley	-	190,566,762.19	1.61	192,118.85	1.84	
Oppenheimier	-	180,765,853.65	1.53	79,604.83	0.76	
海通证券	1	166,513,679.04	1.41	155,072.10	1.48	
CICC Hong Kong Securities	-	156,388,067.32	1.32	168,052.94	1.61	
Credit Suisse	-	67,896,482.15	0.57	15,643.21	0.15	
CLSA Asia-Pacific Markets	-	39,197,334.24	0.33	345,387.24	3.30	
China Merchant Security (HK)	-	8,918,055.23	0.08	7,134.45	0.07	
长城证券	1	-	-	-	-	
中泰证券	2	-	-	-	-	

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
CGS-CIMB Securities (Singapore)	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies International	-	-	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Securities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
Wolfe Research	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	33,349,115.40	100.00	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
Oppenhemier	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC Hong Kong Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Asia-Pacific Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchant Security (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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, 同一基金管理机构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, 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, 上证报, 公司网站, 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	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, 上证报, 公司网站, 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, 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, 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, 上证报, 公司网站, 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旗下部分基金获配非公开发行股票的公告(涪陵榨菜)	上交所, 上证报, 公司网站	2021年05月19日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021年06月24日

## § 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全球消费行业混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富全球消费行业混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富全球消费行业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、报告期内汇添富全球消费行业混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2021年08月31日