

汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 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：中国国际金融股份有限公司

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。

基金托管人中国国际金融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 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合规守信情况的说明	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	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	17
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	67
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	67
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
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.....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF)	
基金简称	汇添富沪深 300 指数 (LOF)	
基金主代码	501043	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 09 月 06 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国国际金融股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	226,230,404.45	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富沪深 300 指数 (LOF) A	汇添富沪深 300 指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	沪深 300A	沪深 300C
下属分级基金的交易代码	501043	501045
报告期末下属分级基金的份额总额 (份)	156,512,899.18	69,717,505.27

注: 本基金 A 类份额的扩位证券简称为沪深 300LOF; C 类份额的扩位证券简称为沪深 300LOFC。

2.2 基金产品说明

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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括: 股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 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。
--	--

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	中国国际金融股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	010-65353060; 010-65351622
传真	021-28932998	010-65059873
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	北京市朝阳区建外门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市朝阳区建外门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
邮政编码	200120	100004
法定代表人	李文	沈如军

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	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日 - 2021年06月30日)	
	汇添富沪深300指数(LOF) A	汇添富沪深300指数(LOF) C
本期已实现收益	14,245,144.04	6,445,933.75
本期利润	7,191,187.25	4,078,611.69
加权平均基金份额本期利润	0.0578	0.0689
本期加权平均净值利	3.68%	4.42%

润率		
本期基金份额净值增长率	3.38%	3.25%
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	81,349,607.22	35,588,697.35
期末可供分配基金份额利润	0.5198	0.5105
期末基金资产净值	249,743,501.85	110,564,336.30
期末基金份额净值	1.5957	1.5859
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	59.57%	58.59%

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

汇添富沪深 300 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
过去一个月	-0.86%	0.77%	-1.91%	0.76%	1.05%	0.01%
过去三个月	6.01%	0.94%	3.32%	0.93%	2.69%	0.01%
过去六个月	3.38%	1.26%	0.29%	1.25%	3.09%	0.01%
过去一年	36.18%	1.27%	24.19%	1.27%	11.99%	0.00%
过去三年	72.32%	1.30%	46.42%	1.30%	25.90%	0.00%
自基金合同生	59.57%	1.24%	34.00%	1.23%	25.57%	0.01%

效日起 至今						
汇添富沪深 300 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
过去一 个月	-0.88%	0.77%	-1.91%	0.76%	1.03%	0.01%
过去三 个月	5.94%	0.94%	3.32%	0.93%	2.62%	0.01%
过去六 个月	3.25%	1.26%	0.29%	1.25%	2.96%	0.01%
过去一 年	35.84%	1.27%	24.19%	1.27%	11.65%	0.00%
过去三 年	71.39%	1.30%	46.42%	1.30%	24.97%	0.00%
自基金 合同生 效日起 至今	58.59%	1.24%	34.00%	1.23%	24.59%	0.01%

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

汇添富沪深300指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富沪深300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09月06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		
董瑾	本基金的基金经理	2019 年 12 月 31 日		12	国籍:中国。学历:北京大学西方经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理,2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金

				<p>管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年</p>
--	--	--	--	---

					<p>12 月 31 日至今任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</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 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嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下：

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

别为 50.9%、53.5%和 52.9%，均持续位于临界点以上，我国经济运行继续保持扩张态势。

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 3.38%;C 类基金份额净值增长率为 3.25%。同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球疫情仍在持续演变，外部环境不确定性仍在；国内经济相对来说韧性更足，在高基数影响下，下半年预计季度增速温和回落，整体大概率能够维持稳健。消费有望延续复苏，制造业投资温和回升。

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

下半年市场行情或将延续分化，随着经济恢复常态，产业升级和消费升级所代表的“新经济”和成长风格可能重回主线。碳中和、物联网和先进制造等相关主题的投资机会也值得持续关注。

作为被动投资的指数型基金，汇添富沪深 300 指数 (LOF) 将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金可进行基金收益分配;若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

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,中国国际金融股份有限公司(以下称“本托管人”)在对本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,

不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金未进行收益分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	22,740,829.16	16,653,988.26
结算备付金		4,372,317.09	4,228,020.73
存出保证金		1,786,306.20	2,018,355.39
交易性金融资产	6.4.7.2	331,351,672.78	240,469,401.73
其中：股票投资		331,162,067.75	240,291,401.73
基金投资		-	-
债券投资		189,605.03	178,000.00
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		465,541.36	2,676,700.66
应收利息	6.4.7.5	6,084.11	5,227.74
应收股利		-	-
应收申购款		569,293.68	557,756.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		361,292,044.38	266,609,450.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		560,389.25	2,231,040.91
应付管理人报酬		134,794.46	109,638.41
应付托管费		26,958.90	21,927.67
应付销售服务费		21,704.24	19,136.10
应付交易费用	6.4.7.7	109,499.66	116,045.32
应交税费		17,128.17	38,889.64
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	113,731.55	213,583.41
负债合计		984,206.23	2,750,261.46
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	226,230,404.45	171,224,262.36
未分配利润	6.4.7.1 0	134,077,433.70	92,634,926.97
所有者权益合计		360,307,838.15	263,859,189.33
负债和所有者权益总计		361,292,044.38	266,609,450.79

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 226,230,404.45 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.5957 元，基金份额总额 156,512,899.18 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.5859 元，基金份额总额 69,717,505.27 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

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
一、收入		12,699,207.53	11,113,556.25
1. 利息收入		106,966.64	126,995.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	106,909.47	126,978.98
债券利息收入		57.17	16.64

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)		21,906,261.28	13,148,668.01
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	18,776,010.28	11,189,002.00
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	19,914.87	22,240.42
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	967,631.07	210,189.32
股利收益	6.4.7.17	2,142,705.06	1,727,236.27
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-9,421,278.85	-2,249,429.28
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	107,258.46	87,321.90
减: 二、费用		1,429,408.59	1,156,602.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	712,374.13	509,869.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	142,474.87	101,973.72
3. 销售服务费		114,078.97	86,852.02
4. 交易费用	6.4.7.20	325,164.57	333,707.46
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3,483.52	756.70
7. 其他费用	6.4.7.21	131,832.53	123,443.17
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		11,269,798.94	9,956,953.95
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		11,269,798.94	9,956,953.95

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

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	171,224,262.36	92,634,926.97	263,859,189.33

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,269,798.94	11,269,798.94
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)	55,006,142.09	30,172,707.79	85,178,849.88
其中:1.基金申购款	195,529,942.38	113,440,213.60	308,970,155.98
2.基金赎回款	-140,523,800.29	-83,267,505.81	-223,791,306.10
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)	226,230,404.45	134,077,433.70	360,307,838.15
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)	205,329,274.00	25,807,451.67	231,136,725.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,956,953.95	9,956,953.95
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)	-50,753,775.17	-9,431,455.98	-60,185,231.15
其中:1.基金申购款	172,729,448.04	13,316,248.20	186,045,696.24
2.基金赎回款	-223,483,223.21	-22,747,704.18	-246,230,927.39
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)	154,575,498.83	26,332,949.64	180,908,448.47
---------------------	----------------	---------------	----------------

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) (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[2017]1332 号文《关于准予汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 注册的批复》准予注册, 由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人向社会公开发行募集, 基金合同于 2017 年 9 月 6 日生效, 首次设立募集规模为 512,823,476.78 份基金份额。本基金为上市契约型开放式 (LOF), 存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标, 基金还可投资于其他股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、债券 (包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券 (分离交易可转债)、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款 (包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生工具 (包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等) 以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会的相关规定)。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。本基金业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 \times 95% + 银行人民币活期存款利率 (税后) \times 5%。

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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点

金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策

问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2013 年 1 月 1 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内 (含 1 个月) 的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年 (含 1 年) 的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税;

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

6.4.7 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	22,740,829.16
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	22,740,829.16

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	302,610,858.83	331,162,067.75	28,551,208.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	183,500.00	189,605.03	6,105.03

	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	183,500.00	189,605.03	6,105.03
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		302,794,358.83	331,351,672.78	28,557,313.95

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,472,040.00	-	-	-
（股指期货投资）	13,472,040.00			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,472,040.00	-	-	-

注：本期末 2021 年 6 月 30 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IF2109	3	4,420,200.00	4,649,760.00	229,560.00
IF2112	6	9,051,840.00	9,252,360.00	200,520.00
总额合计：		430,080.00		
减：可抵销期货暂收款		430,080.00		
股指期货投资净额：		0.00		

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
----	--------------------

应收活期存款利息	4,417.62
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,604.42
应收债券利息	14.28
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	47.79
合计	6,084.11

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	109,499.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	109,499.66

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	14,552.60
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	113,731.55

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富沪深 300 指数 (LOF) 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	113,371,124.29	113,371,124.29
本期申购	119,721,946.88	119,721,946.88
本期赎回 (以“-”号填列)	-76,580,171.99	-76,580,171.99
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	156,512,899.18	156,512,899.18
汇添富沪深 300 指数 (LOF) 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	57,853,138.07	57,853,138.07
本期申购	75,807,995.50	75,807,995.50
本期赎回 (以“-”号填列)	-63,943,628.30	-63,943,628.30
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	69,717,505.27	69,717,505.27

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

汇添富沪深 300 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	46,172,682.48	15,452,848.96	61,625,531.44
本期利润	14,245,144.04	-7,053,956.79	7,191,187.25
本期基金份额交易产生的变动数	20,931,780.70	3,482,103.28	24,413,883.98

其中:基金申购款	55,499,049.18	15,157,894.52	70,656,943.70
基金赎回款	-34,567,268.48	-11,675,791.24	-46,243,059.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	81,349,607.22	11,880,995.45	93,230,602.67
汇添富沪深 300 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,171,206.19	7,838,189.34	31,009,395.53
本期利润	6,445,933.75	-2,367,322.06	4,078,611.69
本期基金份额交易产生的变动数	5,971,557.41	-212,733.60	5,758,823.81
其中:基金申购款	34,647,224.02	8,136,045.88	42,783,269.90
基金赎回款	-28,675,666.61	-8,348,779.48	-37,024,446.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,588,697.35	5,258,133.68	40,846,831.03

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	69,397.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	32,471.71
其他	5,040.33
合计	106,909.47

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	95,679,642.59
减:卖出股票成本总额	76,903,632.31
买卖股票差价收入	18,776,010.28

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	427,371.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	407,400.00
减：应收利息总额	56.43
买卖债券差价收入	19,914.87

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
买卖权证差价收入应缴纳增值税	-
卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	-
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	967,631.07
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

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	2,142,705.06
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	2,142,705.06

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	-8,684,238.85
——股票投资	-8,690,343.88
——债券投资	6,105.03
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-737,040.00
——权证投资	-
——期货投资	-737,040.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,421,278.85

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	107,258.46
替代损益	-
其他	-
合计	107,258.46

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	325,164.57
银行间市场交易费用	-
合计	325,164.57

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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	3,758.63
指数使用费	28,494.95
持有人大会-公证费	-

持有人大会-律师费	-
开户费	400.00
上市费	-
其他	-
合计	131,832.53

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, 基金发起人
中国国际金融股份有限公司 (“中金公司”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注: 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2021 年 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 (%)
中金公司	267,736,139.64	100.00	224,893,921.16	100.00

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 (%)
中金公司	427,371.30	100.00	93,353.22	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 (%)
中金公司	193,747.93	100.00	109,499.66	100.00
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 (%)
中金公司	162,914.95	100	64,319.42	100

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	712,374.13	509,869.23
其中：支付销售机构的客户维护费	94,872.24	59,801.56

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 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、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 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	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	142,474.87	101,973.72

注: 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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

6.4.10.2.3 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		
	汇添富沪深 300 指数 (LOF) A	汇添富沪深 300 指数 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	52,169.93	52,169.93
东方证券股份有限公司	-	3,066.59	3,066.59
合计	-	55,236.52	55,236.52
获得销售服务费的各关联方	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		

名称	汇添富沪深 300 指数 (LOF) A	汇添富沪深 300 指数 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	41,076.46	41,076.46
东方证券股份有限公司	-	4,797.67	4,797.67
合计	-	45,874.13	45,874.13

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年费率为 0.25%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 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付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 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 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期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

份额单位：份

汇添富沪深 300 指数 (LOF) 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 (2017 年 09 月 06 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	10,002,700.27
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	-	10,002,700.27
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%)	-	9.90
汇添富沪深 300 指数 (LOF) 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 (2017 年 09 月 06 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

汇添富沪深 300 指数 (LOF) 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 (%)

	-	-	-	-
汇添富沪深 300 指数 (LOF) 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 (%)
东方证券股份有限公司	5,862,046.51	8.41	-	-

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

注:本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额,本报告期及上年度可比期间均未有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

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

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

于本报告期末,本基金按照指数权重比例持有东方证券 66,200.00 股。

6.4.11 利润分配情况

注:本基金本报告期末未进行利润分配。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	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

				型						
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	171	2,826.63	7,877.97	
688601	力芯微	2021年06月18日	2021年12月28日	新股流通受限	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	
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	
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	148	7,004.84	37,290.08	
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	204	4,245.24	8,614.92	
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	2021	2021	新	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	

	福 泵 业	年 05 月 17 日	年 11 月 25 日	股 流 通 受 限						
300943	春 晖 智 控	2021 年 02 月 03 日	2021 年 08 月 10 日	新 股 流 通 受 限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	
301017	漱 玉 平 民	2021 年 06 月 23 日	2022 年 01 月 05 日	新 股 流 通 受 限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	
301017	漱 玉 平 民	2021 年 06 月 23 日	2021 年 07 月 05 日	新 股 流 通 受 限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	
301010	晶 雪 节 能	2021 年 06 月 09 日	2021 年 12 月 20 日	新 股 流 通 受 限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	
300614	百 川 畅 银	2021 年 05 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新 股 流 通 受 限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	
301018	申 菱 环 境	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 07 日	新 股 流 通 受 限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	
688076	诺 泰 生	2021 年 05 月	2021 年 11 月	新 股 流	15.57	48.55	2,305	35,888.85	111,907.75	

	物	月 12 日	月 22 日	通 受 限						
688499	利元亨	2021 年 06 月 23 日	2021 年 07 月 01 日	新 股 流 通 受 限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	
300973	立高食品	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 15 日	新 股 流 通 受 限	28.28	115.71	174	4,920.72	20,133.54	
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	
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	
688690	纳微科技	2021 年 06 月 16 日	2021 年 12 月 23 日	新 股 流 通 受 限	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	
300945	曼卡龙	2021 年 02 月 03 日	2021 年 08 月 10 日	新 股 流 通 受 限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	
300995	奇德新材	2021 年 05 月 17	2021 年 11 月 26	新 股 流 通 受	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	

		日	日	限						
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	
301011	华立科技	2021 年 06 月 09 日	2021 年 12 月 17 日	新 股 流 通 受 限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	
688226	威腾电气	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 07 日	新 股 流 通 受 限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	
301021	英诺激光	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新 股 流 通 受 限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	
688630	芯碁微装	2021 年 03 月 25 日	2021 年 10 月 08 日	新 股 流 通 受 限	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	
300986	志特新材	2021 年 04 月 21 日	2021 年 11 月 01 日	新 股 流 通 受 限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	
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	2021	2021	新	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	

	瑞生物	年 02 月 02 日	年 08 月 09 日	股 流 通 受 限						
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	
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	
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	1,010	6,938.70	12,190.70	
688345	博力威	2021 年 06 月 03 日	2021 年 12 月 13 日	新 股 流 通 受 限	25.91	55.53	1,499	38,839.09	83,239.47	
300948	冠中生态	2021 年 02 月 18 日	2021 年 08 月 25 日	新 股 流 通 受 限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	
605162	新中港	2021 年 06 月	2021 年 07 月	新 股 流 通	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	

		月 29 日	月 07 日	通 受 限						
301007	德 迈 仕	2021 年 06 月 04 日	2021 年 12 月 16 日	新 股 流 通 受 限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	
605287	德 才 股 份	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新 股 流 通 受 限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	
300972	万 辰 生 物	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 19 日	新 股 流 通 受 限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	
300982	苏 文 电 能	2021 年 04 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新 股 流 通 受 限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	
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	
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	2021 年 10 月 27	新 股 流 通 受	48.59	90.39	138	6,705.42	12,473.82	

		日	日	限						
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	
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	
688087	英科再生	2021年06月30日	2022年01月10日	新股流通受限	21.96	21.96	1,950	42,822.00	42,822.00	
300930	屹通新材	2021年01月13日	2021年07月21日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	
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
123117	健帆转债	2021年06月23日	2021年07月12日	新债流通受限	100.00	100.00	75	7,500.00	7,500.00	
113050	南银转债	2021年06月16日	2021年07月01日	新债流通受限	100.00	100.00	1,410	141,000.00	141,000.00	
127038	国微转债	2021年06月10日	2021年07月14日	新债流通受限	100.00	100.00	153	15,300.00	15,300.00	
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	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：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。）。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年06月16日	重大资产重组	5.59	2021年07月06日	6.15	52,300	476,983.62	292,357.00	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 06月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	22,740,829.16	-	-	-	-	-	22,740,829.16
结算备付金	4,372,317.09	-	-	-	-	-	4,372,317.09
存出保证金	118,051.80	-	-	-	-	1,668,254.40	1,786,306.20
交易性金融资产	-	-	189,605.03	-	-	331,162,067.75	331,351,672.78
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	6,084.11	6,084.11
应收申购款	175,190.63	-	-	-	-	394,103.05	569,293.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	465,541.36	465,541.36
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-

资产							
资产总计	27,406,388.68	-	189,605.03	-	-	333,696,050.67	361,292,044.38
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	560,389.25	560,389.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	134,794.46	134,794.46
应付托管费	-	-	-	-	-	26,958.90	26,958.90
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,704.24	21,704.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	109,499.66	109,499.66
应交税费	-	-	-	-	-	17,128.17	17,128.17
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	113,731.55	113,731.55
负债总计	-	-	-	-	-	984,206.23	984,206.23
利率敏感度缺口	27,406,388.68	-	189,605.03	-	-	332,711,844.44	360,307,838.15

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	16,653,988.26	-	-	-	-	-	16,653,988.26
结算备付金	4,228,020.73	-	-	-	-	-	4,228,020.73
存出保证金	339,214.59	-	-	-	-	1,679,140.80	2,018,355.39
交易性金融资产	-	-	178,000.00	-	-	240,291,401.73	240,469,401.73
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	5,227.74	5,227.74
应收申购款	250,041.92	-	-	-	-	307,714.36	557,756.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,676,700.66	2,676,700.66
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	21,471,265.50	-	178,000.00	-	-	244,960,185.29	266,609,450.79
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	2,231,040.91	2,231,040.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	109,638.41	109,638.41
应付托管费	-	-	-	-	-	21,927.67	21,927.67
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	19,136.10	19,136.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	116,045.32	116,045.32
应交税费	-	-	-	-	-	38,889.64	38,889.64
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	213,583.41	213,583.41
负债总计	-	-	-	-	-	2,750,261.46	2,750,261.46
利率敏感度缺口	21,471,265.50	-	178,000.00	-	-	242,209,923.83	263,859,189.33

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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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	331,162,067.75	91.91	240,291,401.73	91.07
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	189,605.03	0.05	178,000.00	0.07
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	331,351,672.78	91.96	240,469,401.73	91.14

注：本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的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
	沪深 300 指数下跌 5%	-17, 182, 650. 50	-12, 525, 692. 23
	沪深 300 指数上涨 5%	17, 182, 650. 50	12, 525, 692. 23

注: 本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析, 反映了在其他变量不变的假设下, 证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时, 将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	331, 162, 067. 75	91. 66
	其中: 股票	331, 162, 067. 75	91. 66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	189, 605. 03	0. 05
	其中: 债券	189, 605. 03	0. 05
	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	27, 113, 146. 25	7. 50
8	其他资产	2, 827, 225. 35	0. 78

9	合计	361,292,044.38	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	3,475,497.34	0.96
B	采矿业	7,084,204.44	1.97
C	制造业	183,719,557.56	50.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,868,383.00	1.63
E	建筑业	4,016,525.48	1.11
F	批发和零售业	2,376,989.45	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	9,466,636.53	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,822,858.46	3.00
J	金融业	77,041,549.23	21.38
K	房地产业	6,065,272.00	1.68
L	租赁和商务服务业	5,898,702.70	1.64
M	科学研究和技术服务业	4,701,560.59	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	599,543.00	0.17
Q	卫生和社会工作	7,107,546.43	1.97
R	文化、体育和娱乐业	1,376,833.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	329,621,659.21	91.48

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,320,435.43	0.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	78,981.90	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,845.32	0.01
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	35,742.75	0.01
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	1,540,408.54	0.43

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	9,900	20,361,330.00	5.65
2	601318	中国平安	168,400	10,824,752.00	3.00
3	600036	招商银行	194,100	10,518,279.00	2.92
4	000858	五粮液	30,747	9,159,223.83	2.54
5	601012	隆基股份	65,130	5,786,149.20	1.61
6	000333	美的集团	77,100	5,502,627.00	1.53
7	002415	海康威视	73,200	4,721,400.00	1.31
8	600276	恒瑞医药	69,440	4,719,836.80	1.31
9	601166	兴业银行	223,900	4,601,145.00	1.28
10	601888	中国中免	14,699	4,411,169.90	1.22
11	603259	药明康德	27,601	4,322,040.59	1.20
12	300059	东方财富	129,220	4,237,123.80	1.18
13	000651	格力电器	74,800	3,897,080.00	1.08
14	600900	长江电力	177,400	3,661,536.00	1.02
15	002594	比亚迪	14,102	3,539,602.00	0.98
16	600887	伊利股份	95,934	3,533,249.22	0.98
17	002475	立讯精密	74,790	3,440,340.00	0.95
18	000001	平安银行	151,400	3,424,668.00	0.95
19	600030	中信证券	133,100	3,319,514.00	0.92
20	000725	京东方A	530,300	3,309,072.00	0.92
21	300015	爱尔眼科	42,697	3,030,633.06	0.84
22	601398	工商银行	544,000	2,812,480.00	0.78

23	000568	泸州老窖	11,701	2,760,733.94	0.77
24	600031	三一重工	94,100	2,735,487.00	0.76
25	600309	万华化学	24,527	2,669,028.14	0.74
26	603288	海天味业	19,870	2,562,236.50	0.71
27	603501	韦尔股份	7,800	2,511,600.00	0.70
28	000002	万科A	105,200	2,504,812.00	0.70
29	002714	牧原股份	40,657	2,472,758.74	0.69
30	600809	山西汾酒	5,300	2,374,400.00	0.66
31	300122	智飞生物	12,600	2,352,798.00	0.65
32	601919	中远海控	72,300	2,208,042.00	0.61
33	002142	宁波银行	56,301	2,194,049.97	0.61
34	601899	紫金矿业	218,200	2,114,358.00	0.59
35	601328	交通银行	426,300	2,088,870.00	0.58
36	600436	片仔癀	4,600	2,062,180.00	0.57
37	002304	洋河股份	9,703	2,010,461.60	0.56
38	002352	顺丰控股	28,500	1,929,450.00	0.54
39	002230	科大讯飞	27,900	1,885,482.00	0.52
40	300014	亿纬锂能	17,700	1,839,561.00	0.51
41	600000	浦发银行	182,600	1,826,000.00	0.51
42	300124	汇川技术	24,400	1,811,944.00	0.50
43	002812	恩捷股份	7,700	1,802,570.00	0.50
44	600438	通威股份	40,900	1,769,743.00	0.49
45	000661	长春高新	4,500	1,741,500.00	0.48
46	300274	阳光电源	15,000	1,725,900.00	0.48
47	000100	TCL科技	221,100	1,691,415.00	0.47
48	601816	京沪高铁	307,800	1,628,262.00	0.45
49	000063	中兴通讯	48,001	1,595,073.23	0.44
50	002241	歌尔股份	37,101	1,585,696.74	0.44
51	300347	泰格医药	8,200	1,585,060.00	0.44
52	603986	兆易创新	8,288	1,557,315.20	0.43
53	002271	东方雨虹	27,950	1,546,194.00	0.43
54	601601	中国太保	53,300	1,544,101.00	0.43
55	600585	海螺水泥	37,401	1,535,311.05	0.43
56	300142	沃森生物	24,800	1,530,160.00	0.42
57	601668	中国建筑	325,280	1,512,552.00	0.42
58	002460	赣锋锂业	12,451	1,507,691.59	0.42
59	600690	海尔智家	58,001	1,502,805.91	0.42
60	002027	分众传媒	158,080	1,487,532.80	0.41
61	603799	华友钴业	12,900	1,473,180.00	0.41
62	600016	民生银行	331,220	1,460,680.20	0.41
63	600763	通策医疗	3,500	1,438,500.00	0.40
64	601288	农业银行	449,070	1,360,682.10	0.38
65	600196	复星医药	18,601	1,341,690.13	0.37

66	600048	保利地产	111,300	1,340,052.00	0.37
67	600703	三安光电	41,601	1,333,312.05	0.37
68	600919	江苏银行	182,260	1,294,046.00	0.36
69	000338	潍柴动力	72,400	1,293,788.00	0.36
70	601688	华泰证券	80,500	1,271,900.00	0.35
71	601229	上海银行	154,700	1,268,540.00	0.35
72	002129	中环股份	32,700	1,262,220.00	0.35
73	600050	中国联通	291,000	1,257,120.00	0.35
74	600660	福耀玻璃	21,801	1,217,585.85	0.34
75	600104	上汽集团	54,800	1,203,956.00	0.33
76	601211	国泰君安	70,200	1,203,228.00	0.33
77	600570	恒生电子	12,464	1,162,268.00	0.32
78	601766	中国中车	190,800	1,160,064.00	0.32
79	600837	海通证券	100,500	1,155,750.00	0.32
80	601169	北京银行	230,000	1,120,100.00	0.31
81	688111	金山办公	2,800	1,105,440.00	0.31
82	600999	招商证券	57,890	1,101,067.80	0.31
83	002311	海大集团	13,000	1,060,800.00	0.29
84	600019	宝钢股份	138,700	1,059,668.00	0.29
85	002371	北方华创	3,800	1,054,044.00	0.29
86	002410	广联达	14,800	1,009,360.00	0.28
87	601988	中国银行	327,009	1,007,187.72	0.28
88	601088	中国神华	51,401	1,003,347.52	0.28
89	300498	温氏股份	69,780	1,002,738.60	0.28
90	002049	紫光国微	6,500	1,002,235.00	0.28
91	600406	国电南瑞	42,580	989,559.20	0.27
92	601818	光大银行	256,900	971,082.00	0.27
93	300601	康泰生物	6,400	953,600.00	0.26
94	600745	闻泰科技	9,600	930,240.00	0.26
95	000538	云南白药	7,908	915,113.76	0.25
96	600028	中国石化	208,803	910,381.08	0.25
97	000625	长安汽车	33,900	890,892.00	0.25
98	601628	中国人寿	25,938	879,038.82	0.24
99	600893	航发动力	16,400	872,316.00	0.24
100	300450	先导智能	14,300	860,002.00	0.24
101	002821	凯莱英	2,300	856,980.00	0.24
102	601658	邮储银行	169,800	852,396.00	0.24
103	300595	欧普康视	8,100	838,755.00	0.23
104	600588	用友网络	25,002	831,566.52	0.23
105	601390	中国中铁	158,500	830,540.00	0.23
106	600346	恒力石化	31,560	828,134.40	0.23
107	601009	南京银行	78,700	827,924.00	0.23
108	601633	长城汽车	18,700	815,133.00	0.23

109	601377	兴业证券	83,800	809,508.00	0.22
110	002493	荣盛石化	46,500	803,055.00	0.22
111	601857	中国石油	150,600	796,674.00	0.22
112	688036	传音控股	3,600	754,200.00	0.21
113	300413	芒果超媒	10,920	749,112.00	0.21
114	601225	陕西煤业	62,500	740,625.00	0.21
115	600132	重庆啤酒	3,700	732,415.00	0.20
116	600584	长电科技	19,200	723,456.00	0.20
117	002601	龙鳞佰利	20,900	722,722.00	0.20
118	300408	三环集团	16,900	716,898.00	0.20
119	600426	华鲁恒升	23,100	714,945.00	0.20
120	002001	新和成	24,400	699,792.00	0.19
121	601939	建设银行	104,890	697,518.50	0.19
122	000895	双汇发展	21,800	693,240.00	0.19
123	600009	上海机场	14,400	693,072.00	0.19
124	601100	恒立液压	7,992	686,672.64	0.19
125	002179	中航光电	8,660	684,313.20	0.19
126	300433	蓝思科技	23,250	683,782.50	0.19
127	600926	杭州银行	46,300	682,925.00	0.19
128	600111	北方稀土	32,900	681,030.00	0.19
129	688012	中微公司	4,100	680,272.00	0.19
130	603882	金域医学	4,200	671,034.00	0.19
131	002050	三花智控	27,724	664,821.52	0.18
132	600958	东方证券	66,200	661,338.00	0.18
133	000166	申万宏源	139,900	654,732.00	0.18
134	002841	视源股份	5,200	646,308.00	0.18
135	300003	乐普医疗	19,900	639,188.00	0.18
136	000963	华东医药	13,845	637,008.45	0.18
137	600741	华域汽车	23,800	625,226.00	0.17
138	002007	华兰生物	16,974	622,606.32	0.17
139	000786	北新建材	15,700	616,225.00	0.17
140	600600	青岛啤酒	5,300	612,945.00	0.17
141	000157	中联重科	66,300	612,612.00	0.17
142	601006	大秦铁路	92,300	607,334.00	0.17
143	002607	中公教育	28,700	599,543.00	0.17
144	601901	方正证券	63,800	597,168.00	0.17
145	601336	新华保险	13,000	596,830.00	0.17
146	600015	华夏银行	96,300	596,097.00	0.17
147	603806	福斯特	5,600	588,728.00	0.16
148	002236	大华股份	27,900	588,690.00	0.16
149	601989	中国重工	141,900	584,628.00	0.16
150	600143	金发科技	27,800	579,908.00	0.16
151	601138	工业富联	46,500	577,065.00	0.16

152	600176	中国巨石	37,075	575,033.25	0.16
153	603993	洛阳钼业	111,200	573,792.00	0.16
154	000768	中航西飞	21,500	565,020.00	0.16
155	601877	正泰电器	16,800	560,784.00	0.16
156	600352	浙江龙盛	40,501	556,483.74	0.15
157	600010	包钢股份	359,000	556,450.00	0.15
158	600547	山东黄金	28,422	546,270.84	0.15
159	600760	中航沈飞	9,040	545,112.00	0.15
160	300529	健帆生物	6,300	544,068.00	0.15
161	002008	大族激光	13,301	537,227.39	0.15
162	601600	中国铝业	100,700	533,710.00	0.15
163	001979	招商蛇口	48,700	533,265.00	0.15
164	601186	中国铁建	71,500	531,245.00	0.15
165	603369	今世缘	9,800	530,768.00	0.15
166	601788	光大证券	29,400	525,966.00	0.15
167	000876	新希望	35,500	520,785.00	0.14
168	002202	金风科技	42,440	516,070.40	0.14
169	601916	浙商银行	129,600	514,512.00	0.14
170	688169	石头科技	400	504,400.00	0.14
171	002555	三七互娱	20,601	494,836.02	0.14
172	000938	紫光股份	22,533	493,022.04	0.14
173	003816	中国广核	181,600	484,872.00	0.13
174	603899	晨光文具	5,700	481,992.00	0.13
175	002736	国信证券	44,500	478,375.00	0.13
176	601066	中信建投	15,200	477,736.00	0.13
177	601799	星宇股份	2,100	474,012.00	0.13
178	000069	华侨城 A	63,700	473,928.00	0.13
179	600109	国金证券	37,200	472,068.00	0.13
180	300136	信维通信	15,200	469,376.00	0.13
181	000425	徐工机械	73,500	468,195.00	0.13
182	600989	宝丰能源	34,100	466,488.00	0.13
183	600150	中国船舶	28,000	462,280.00	0.13
184	603160	汇顶科技	3,500	453,705.00	0.13
185	601669	中国电建	117,200	453,564.00	0.13
186	603659	璞泰来	3,300	450,780.00	0.13
187	000977	浪潮信息	16,000	450,080.00	0.12
188	600795	国电电力	183,400	445,662.00	0.12
189	688008	澜起科技	7,043	439,342.34	0.12
190	000783	长江证券	59,700	437,004.00	0.12
191	603019	中科曙光	15,820	436,790.20	0.12
192	600079	人福医药	15,400	435,358.00	0.12
193	601238	广汽集团	33,600	435,120.00	0.12
194	000596	古井贡酒	1,800	431,100.00	0.12

195	002624	完美世界	18,000	430,380.00	0.12
196	002384	东山精密	20,500	427,220.00	0.12
197	300677	英科医疗	3,400	424,320.00	0.12
198	601838	成都银行	33,400	422,176.00	0.12
199	300558	贝达药业	3,900	422,136.00	0.12
200	600183	生益科技	18,000	421,380.00	0.12
201	600085	同仁堂	10,302	420,836.70	0.12
202	600886	国投电力	43,700	419,957.00	0.12
203	600029	南方航空	69,697	419,575.94	0.12
204	601985	中国核电	81,300	411,378.00	0.11
205	000703	恒逸石化	34,400	411,080.00	0.11
206	601108	财通证券	39,100	410,159.00	0.11
207	002414	高德红外	14,820	408,735.60	0.11
208	300144	宋城演艺	24,300	408,240.00	0.11
209	002600	领益智造	44,200	406,198.00	0.11
210	603833	欧派家居	2,840	403,166.40	0.11
211	601555	东吴证券	48,210	402,071.40	0.11
212	000066	中国长城	27,500	401,500.00	0.11
213	601360	三六零	32,800	400,488.00	0.11
214	002252	上海莱士	52,100	390,229.00	0.11
215	603517	绝味食品	4,600	387,734.00	0.11
216	601077	渝农商行	96,600	385,434.00	0.11
217	600522	中天科技	38,400	384,000.00	0.11
218	002938	鹏鼎控股	10,700	383,916.00	0.11
219	300033	同花顺	3,400	383,452.00	0.11
220	601607	上海医药	18,100	382,453.00	0.11
221	002044	美年健康	41,967	382,319.37	0.11
222	002602	世纪华通	59,166	379,845.72	0.11
223	300676	华大基因	3,200	379,520.00	0.11
224	000728	国元证券	47,460	378,256.20	0.10
225	688396	华润微	4,100	373,182.00	0.10
226	600872	中炬高新	8,800	369,776.00	0.10
227	601111	中国国航	47,202	367,231.56	0.10
228	600161	天坛生物	10,700	366,475.00	0.10
229	600362	江西铜业	16,302	364,838.76	0.10
230	600332	白云山	10,703	362,296.55	0.10
231	600115	中国东航	70,400	357,632.00	0.10
232	600383	金地集团	34,900	357,376.00	0.10
233	601800	中国交建	54,901	355,758.48	0.10
234	600845	宝信软件	6,880	350,192.00	0.10
235	000860	顺鑫农业	8,300	350,094.00	0.10
236	002508	老板电器	7,402	344,193.00	0.10
237	300628	亿联网络	4,100	343,580.00	0.10

238	600061	国投资本	39,896	338,717.04	0.09
239	601727	上海电气	79,800	338,352.00	0.09
240	002916	深南电路	3,020	335,612.60	0.09
241	601618	中国中冶	111,700	332,866.00	0.09
242	601162	天风证券	67,390	327,515.40	0.09
243	000708	中信特钢	15,600	325,104.00	0.09
244	601021	春秋航空	5,700	324,330.00	0.09
245	600705	中航资本	83,600	323,532.00	0.09
246	601878	浙商证券	24,200	316,536.00	0.09
247	603939	益丰药房	5,600	314,104.00	0.09
248	600606	绿地控股	56,500	307,925.00	0.09
249	601990	南京证券	28,500	299,820.00	0.08
250	002456	欧菲光	33,400	296,592.00	0.08
251	002157	正邦科技	24,800	296,360.00	0.08
252	002463	沪电股份	18,900	292,383.00	0.08
253	002024	苏宁易购	52,300	292,357.00	0.08
254	600011	华能国际	68,400	288,648.00	0.08
255	600521	华海药业	13,600	283,968.00	0.08
256	601933	永辉超市	60,000	283,800.00	0.08
257	000656	金科股份	49,000	283,710.00	0.08
258	600655	豫园股份	24,000	278,160.00	0.08
259	688363	华熙生物	1,000	277,860.00	0.08
260	600118	中国卫星	9,301	272,147.26	0.08
261	601216	君正集团	53,200	270,788.00	0.08
262	603392	万泰生物	1,040	269,547.20	0.07
263	600848	上海临港	14,760	264,204.00	0.07
264	600489	中金黄金	30,600	263,772.00	0.07
265	601696	中银证券	12,800	263,552.00	0.07
266	600018	上港集团	53,600	255,672.00	0.07
267	002558	巨人网络	18,800	250,040.00	0.07
268	002120	韵达股份	18,271	247,206.63	0.07
269	601998	中信银行	48,100	245,310.00	0.07
270	603195	公牛集团	1,200	242,400.00	0.07
271	601872	招商轮船	49,920	230,630.40	0.06
272	002673	西部证券	27,902	230,191.50	0.06
273	601319	中国人保	38,800	230,084.00	0.06
274	688009	中国通号	40,121	228,288.49	0.06
275	603338	浙江鼎力	3,800	223,022.00	0.06
276	688126	沪硅产业	7,600	221,768.00	0.06
277	002739	万达电影	13,900	219,481.00	0.06
278	601881	中国银河	19,901	214,532.78	0.06
279	603658	安图生物	2,640	200,032.80	0.06
280	600233	圆通速递	19,800	198,198.00	0.06

281	603233	大参林	3,700	189,107.00	0.05
282	600482	中国动力	10,101	175,959.42	0.05
283	601231	环旭电子	10,300	173,143.00	0.05
284	002153	石基信息	7,000	164,570.00	0.05
285	002939	长城证券	14,500	161,385.00	0.04
286	002032	苏泊尔	2,500	159,475.00	0.04
287	000800	一汽解放	14,600	157,972.00	0.04
288	600025	华能水电	27,000	156,330.00	0.04
289	601236	红塔证券	11,500	155,940.00	0.04
290	601808	中海油服	9,400	134,984.00	0.04
291	600918	中泰证券	12,000	129,840.00	0.04
292	002773	康弘药业	5,570	128,834.10	0.04
293	601698	中国卫通	6,900	111,711.00	0.03
294	603087	甘李药业	1,000	106,580.00	0.03
295	600299	安迪苏	6,000	71,760.00	0.02
296	002945	华林证券	4,100	56,662.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.08
2	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.06
3	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.04
4	688076	诺泰生物	2,305	111,907.75	0.03
5	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
6	688345	博力威	1,499	83,239.47	0.02
7	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
8	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
9	688087	英科再生	1,950	42,822.00	0.01
10	300957	贝泰妮	148	37,290.08	0.01
11	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
12	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
13	301015	百洋医药	514	20,859.78	0.01
14	300973	立高食品	174	20,133.54	0.01
15	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
16	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
17	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
18	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
19	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00

20	300981	中红医疗	138	12,473.82	0.00
21	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
22	300968	格林精密	1,010	12,190.70	0.00
23	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
24	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
25	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
26	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
27	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
28	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
29	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
30	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
31	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
32	300996	普联软件	204	8,614.92	0.00
33	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
34	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
35	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
36	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
37	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
38	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
39	300955	嘉亨家化	171	7,877.97	0.00
40	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
41	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
42	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
43	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
44	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
45	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
46	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
47	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
48	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
49	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
50	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
51	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
52	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
53	605488	福莱新材	16	427.04	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	600519	贵州茅台	10,970,748.77	4.16

2	601318	中国平安	5,988,592.00	2.27
3	600036	招商银行	4,937,719.00	1.87
4	000858	五粮液	4,393,311.00	1.67
5	000333	美的集团	3,243,606.00	1.23
6	601166	兴业银行	2,431,608.00	0.92
7	002415	海康威视	2,337,786.58	0.89
8	600276	恒瑞医药	2,330,141.00	0.88
9	601012	隆基股份	2,260,210.10	0.86
10	601888	中国中免	2,194,481.42	0.83
11	000651	格力电器	1,984,249.00	0.75
12	300059	东方财富	1,908,895.00	0.72
13	603259	药明康德	1,868,971.00	0.71
14	600900	长江电力	1,801,740.00	0.68
15	600887	伊利股份	1,763,508.00	0.67
16	002475	立讯精密	1,728,946.00	0.66
17	600031	三一重工	1,720,572.00	0.65
18	600030	中信证券	1,713,093.14	0.65
19	000725	京东方A	1,681,338.00	0.64
20	601816	京沪高铁	1,592,894.00	0.60

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	601318	中国平安	3,350,409.00	1.27
2	600519	贵州茅台	2,896,488.00	1.10
3	600036	招商银行	2,709,399.00	1.03
4	000858	五粮液	2,481,272.00	0.94
5	000333	美的集团	1,943,257.00	0.74
6	601166	兴业银行	1,526,807.00	0.58
7	600276	恒瑞医药	1,360,640.00	0.52
8	601888	中国中免	1,345,555.00	0.51
9	000651	格力电器	1,100,429.00	0.42
10	600031	三一重工	1,091,528.00	0.41
11	002594	比亚迪	1,029,037.00	0.39
12	300059	东方财富	939,045.00	0.36
13	600887	伊利股份	932,092.00	0.35
14	601012	隆基股份	912,563.00	0.35
15	002352	顺丰控股	902,438.00	0.34
16	600030	中信证券	893,050.00	0.34

17	000001	平安银行	890,934.00	0.34
18	002714	牧原股份	856,511.00	0.32
19	000002	万科 A	818,247.00	0.31
20	002475	立讯精密	812,051.00	0.31

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	176,464,642.21
卖出股票收入（成交）总额	95,679,642.59

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）	189,605.03	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	189,605.03	0.05

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	1,410	141,000.00	0.04
2	127036	三花转债	197	25,805.03	0.01
3	127038	国微转债	153	15,300.00	0.00
4	123117	健帆转债	75	7,500.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2109	IF2109	3.00	4,649,760.00	229,560.00	
IF2112	IF2112	6.00	9,252,360.00	200,520.00	
公允价值变动总额合计					430,080.00
股指期货投资本期收益					967,631.07
股指期货投资本期公允价值变动					-737,040.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,南京银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	1,786,306.20
2	应收证券清算款	465,541.36
3	应收股利	-
4	应收利息	6,084.11
5	应收申购款	569,293.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,827,225.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688690	纳微科技	277,777.53	0.08	新股流通受限
2	688630	芯碁微装	198,452.74	0.06	新股流通受限
3	688601	力芯微	156,952.06	0.04	新股流通受限
4	688076	诺泰生物	111,907.75	0.03	新股流通受限
5	688499	利元亨	83,488.65	0.02	新股流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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 (%)	

汇添富沪深 300 指数 (LOF) A	11,379	13,754.54	34,954,826.65	22.33	121,558,072.53	77.67
汇添富沪深 300 指数 (LOF) C	8,621	8,086.94	13,950,218.05	20.01	55,767,287.22	79.99
合计	20,000	11,311.52	48,905,044.70	21.62	177,325,359.75	78.38

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富沪深 300 指数 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	钱磊	624,604.00	1.47
2	刘建峰	571,800.00	1.35
3	王靖	543,938.00	1.28
4	徐维方	419,900.00	0.99
5	秦毅倩	419,200.00	0.99
6	王超	416,912.00	0.98
7	陈红	371,313.00	0.88
8	刘月田	369,140.00	0.87
9	郑松柏	311,800.00	0.74
10	秦立炯	308,000.00	0.73
汇添富沪深 300 指数 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	徐大伟	500,090.00	6.03
2	成汝翠	259,745.00	3.13
3	何啸	245,500.00	2.96
4	傅晓红	200,054.00	2.41
5	陈小灵	180,080.00	2.17
6	何慧凝	166,700.00	2.01
7	尹向伟	150,000.00	1.81
8	陶丽荣	139,593.00	1.68
9	钱中明	125,200.00	1.51
10	卢绍文	125,000.00	1.51

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

8.3 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	汇添富沪深 300 指数 (LOF) A	482,483.32	0.31
	汇添富沪深 300 指数 (LOF) C	96,077.19	0.14
	合计	578,560.51	0.26

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	汇添富沪深 300 指数 (LOF) A	0
	汇添富沪深 300 指数 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	汇添富沪深 300 指数 (LOF) A	0
	汇添富沪深 300 指数 (LOF) C	0
	合计	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,002,700.27 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 09 月 06 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富沪深 300 指数 (LOF) A	汇添富沪深 300 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 09 月 06 日) 基金份 额总额	215,858,430.00	296,965,046.78
本报告期期初基金份 额总额	113,371,124.29	57,853,138.07
本报告期基金总申购份 额	119,721,946.88	75,807,995.50
减：本报告期基金总赎 回份额	76,580,171.99	63,943,628.30
本报告期基金拆分变动 份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	156,512,899.18	69,717,505.27

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。

报告期内，经基金托管人中国国际金融股份有限公司（简称本公司、公司）研究决定，聘请严格同志为本公司资产托管部负责人，张萱同志不再担任资产托管部负责人职务，公司另有任用。

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 (%)	

中金公司	2	267,736,139.64	100.00	193,747.93	100.00	
------	---	----------------	--------	------------	--------	--

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 (%)
中金公司	427,371.30	100.00	-	-	-	-	-	-

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
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 03 月 31 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金修订的招募说明书、产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 02 日
6	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
7	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沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 募集的文件;
- 2、《汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- 3、《汇添富沪深 300 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、报告期内汇添富沪深 300 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。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 08 月 31 日