

汇添富悦享定期开放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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 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 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 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 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 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 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 49 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 49 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 49 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 50 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 53 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 55 |
| 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 | 55 |
| 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 | 55 |
| 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 | 55 |
| 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 | 55 |

| | |
|--|----|
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 55 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 55 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 55 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 56 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 56 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 56 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 57 |
| 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..... | 57 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 57 |
| § 10 重大事件揭示 | 58 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 58 |
| 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..... | 58 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 58 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 58 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 58 |
| 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..... | 58 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 58 |
| 10.8 其他重大事件..... | 61 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 62 |
| 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..... | 62 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 63 |
| § 12 备查文件目录 | 63 |
| 12.1 备查文件目录..... | 63 |
| 12.2 存放地点 | 63 |
| 12.3 查阅方式 | 63 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---------------|--------------------|
| 基金名称 | 汇添富悦享定期开放混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 添富悦享定开混合 |
| 场内简称 | 添富悦享 |
| 基金主代码 | 501063 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 01 月 31 日 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额（份） | 225,370,613.28 |
| 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 | 2019 年 07 月 01 日 |

注：本基金扩位证券简称为添富悦享。

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，精选优质个股，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 | 本基金为混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘股票市场中行业背景良好、商业模式清晰、公司治理优良、竞争优势突出且估值相对合理的上市公司。本基金封闭期的投资策略主要包括：资产配置策略、个股精选策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、权证投资策略、融资投资策略、国债期货投资策略。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。同时，结合市场流动性特点，本基金将提前合理安排组合流动性，统筹考虑投资者申购赎回特征和客户大额资金流向特征，以确定本基金在不同投资品种的配置比例，确保开放期内流动性充裕。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*20%+中债综合财富指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带 |

| | |
|--|---------|
| | 来的特有风险。 |
|--|---------|

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 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 | 021-60637111 |
| 传真 | 021-28932998 | 021-60635778 |
| 注册地址 | 上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室 | 北京市西城区金融大街25号 |
| 办公地址 | 上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | 李文 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》 |
| 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) |
|---------------|--------------------------------|
| 本期已实现收益 | 121,009,238.06 |
| 本期利润 | 53,026,755.03 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1428 |
| 本期加权平均净值利润率 | 12.12% |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.80% |
| 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 | 28,858,308.63 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1280 |
| 期末基金资产净值 | 254,228,921.91 |

| | |
|--------------|-------------------|
| 期末基金份额净值 | 1.1280 |
| 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 | 43.32% |

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -4.11% | 0.55% | -1.10% | 0.58% | -3.01% | -0.03% |
| 过去三个月 | 1.23% | 0.77% | 2.40% | 0.70% | -1.17% | 0.07% |
| 过去六个月 | -1.80% | 1.36% | 1.75% | 0.94% | -3.55% | 0.42% |
| 过去一年 | 20.58% | 1.23% | 17.52% | 0.94% | 3.06% | 0.29% |
| 自基金合同生效日起至今 | 43.32% | 0.99% | 39.47% | 0.98% | 3.85% | 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

添富悦享定开混合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（2019年01月31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，公司注册资本金为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 | | |
| 赵鹏飞 | 本基金的基金经理 | 2019 年 01 月 31 日 | | 13 | 国籍:中国。学历:北京大学经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任职于日信证券、光大证券和太平洋资产，担任高级投资经理等岗位。2015 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2016 年 6 月 3 日至今任汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 20 日至今任汇添富中国高端制造股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月 27 日至今任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月 29 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>理。2017 年 9 月 29 日至 2019 年 9 月 17 日任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2018 年 3 月 19 日至 2019 年 9 月 17 日任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月 23 日至 2021 年 1 月 11 日任汇添富智能制造股票型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 31 日至今任汇添富悦享定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2019 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。2019 年 9 月 4 日至今任汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 5 月 22 日至今任汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 23 日至今任汇添富稳健收益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 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

2021 年上半年 A 股市场经历很大的风格转化。春节之前市场延续了去年的风格，医药消费为代表的核心资产继续提升估值，春节之后市场风格巨变，高估值的核心资产大幅调整，周期股短暂反弹之后，二季度市场选择行业景气度最高的新能源汽车、光伏和半导体行业。行业来看，涨幅居前的是电气设备、钢铁、化工等，表现落后的是家电、军工、房地产等。上半年经济相对平稳，消费数据相对较弱，消费股经历过几年上涨估值较高，因此表现较差。但是市场流动性较好，因此投资者追求行业空间大，景气度高的赛道股。

我们上半年组合调整幅度较大。增加了新能源汽车、半导体、光伏、军工、家电等硬科技相关领域，降低食品、金融和消费电子领域。我们之前的选股基于高质量证券原则，本次调整组合我们提高了行业景气度的权重，增加一些商业模式相对没那么优秀但是景气度很好的个股。从组合管理来看，我们依然维持行业相对均衡，个股相对集中。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-1.80%。同期业绩比较基准收益率为 1.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年我们会关注四个因素：一个是疫情背景下消费是否持续低迷？一个是地产产业链承压对经济的拖累会有多大？一个是中美关系未来的走向？一个是货币政策是否存在收紧的可能？我们对宏观经济相对谨慎，尽量回避强周期行业。对于泡沫过大的赛道股我们也会理性分析，不会盲目乐观。

整体而言，我们依然会专注于寻找各种结构性机会，我们会努力寻找各个产业链的优质公司。我们看好几个方向：（1）不断实现国产替代的高端制造领域各个细分行业。国内高端制造当前的比较优势非常突出，强大的工程师红利和企业家红利使得我们制造业成本低、响应速度快，在全球竞争中不断抢占海外厂家的份额。高端制造领域非常广泛，比如医药行业

的医疗器械和 CDMO，消费电子、机械和半导体等领域。(2) 消费升级是我们一直关注的领域。消费行业天生商业模式好，品牌壁垒强，因此估值回归合理区间时我们会考虑做长期布局。(3) 互联网行业。互联网行业当前面临各种政策压力，我们也认同互联网企业不能野蛮无序扩张，但是互联网行业天生具备马太效应，商业模式好，因此估值回归合理区间时我们会考虑长期布局。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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。

4.8 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：汇添富悦享定期开放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 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 97,377,655.85 | 167,096,488.39 |
| 结算备付金 | | 67,555.45 | 1,790,685.40 |
| 存出保证金 | | 350,569.33 | 404,436.25 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 156,938,148.89 | 928,576,115.66 |
| 其中：股票投资 | | 156,938,148.89 | 928,521,555.44 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 54,560.22 |
| 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 | | - | 10,289,378.50 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 9,643.57 | 46,043.52 |
| 应收股利 | | 51,600.00 | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 254,795,173.09 | 1,108,203,147.72 |
| 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 | | 13.91 | 64.37 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 319,532.85 | 1,690,341.44 |
| 应付托管费 | | 53,255.48 | 281,723.58 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 89,310.59 | 1,557,171.16 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 104,138.35 | 210,000.00 |
| 负债合计 | | 566,251.18 | 3,739,300.55 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 225,370,613.28 | 961,499,770.60 |
| 未分配利润 | 6.4.7.1 0 | 28,858,308.63 | 142,964,076.57 |
| 所有者权益合计 | | 254,228,921.91 | 1,104,463,847.17 |
| 负债和所有者权益总计 | | 254,795,173.09 | 1,108,203,147.72 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1280 元，基金份额总额 225,370,613.28 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富悦享定期开放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 | 上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 |
|-----|-----|------------------------|------------------------------|
|-----|-----|------------------------|------------------------------|

| | | 至 2021 年 06 月 30 日 | 2020 年 06 月 30 日 |
|----------------------------|------------|----------------------|-----------------------|
| 一、收入 | | 59,514,140.40 | 112,109,246.30 |
| 1. 利息收入 | | 206,543.74 | 1,414,572.31 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 206,528.79 | 1,276,018.73 |
| 债券利息收入 | | 14.95 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 138,553.58 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 126,694,718.36 | 11,273,235.22 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 126,002,827.42 | 6,959,191.07 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | 7,072.80 | - |
| 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 | 684,818.14 | 4,314,044.15 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | -67,982,483.03 | 99,421,438.77 |
| 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 | 595,361.33 | - |
| 减：二、费用 | | 6,487,385.37 | 11,032,673.26 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 3,223,310.71 | 7,707,304.36 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 537,218.52 | 1,284,550.67 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.20 | 2,618,757.12 | 1,932,571.11 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.21 | 108,099.02 | 108,247.12 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 53,026,755.03 | 101,076,573.04 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 53,026,755.03 | 101,076,573.04 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富悦享定期开放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) | 961,499,770.60 | 142,964,076.57 | 1,104,463,847.17 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 53,026,755.03 | 53,026,755.03 |
| 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) | -736,129,157.32 | -167,132,522.97 | -903,261,680.29 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,474,073.31 | 335,291.35 | 1,809,364.66 |
| 2. 基金赎回款 | -737,603,230.63 | -167,467,814.32 | -905,071,044.95 |
| 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) | 225,370,613.28 | 28,858,308.63 | 254,228,921.91 |
| 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) | 961,499,770.60 | 80,251,355.95 | 1,041,751,126.55 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 101,076,573.04 | 101,076,573.04 |
| 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) | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | 961,499,770.60 | 181,327,928.99 | 1,142,827,699.59 |

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>张晖</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

汇添富悦享定期开放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]1013号文《关于准予汇添富悦享定期开放混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人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 2019 年 1 月 31 日生效，首次设立募集规模为 961,499,770.60 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货、股票期权、国债期货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，精选优质个股，为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合财富指数收益率×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

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。

6.4.6.6 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 | 97,377,655.85 |
| 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 | 97,377,655.85 |

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 | 157,546,987.04 | 156,938,148.89 | -608,838.15 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 其他 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 157,546,987.04 | 156,938,148.89 | -608,838.15 |

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 | 9,455.37 |
| 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 | 30.40 |
| 应收债券利息 | - |
| 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 | 157.80 |
| 合计 | 9,643.57 |

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 | 89,310.59 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 89,310.59 |

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 | 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 | 104,138.35 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 961,499,770.60 | 961,499,770.60 |
| 本期申购 | 1,474,073.31 | 1,474,073.31 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -737,603,230.63 | -737,603,230.63 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 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 | 225,370,613.28 | 225,370,613.28 |

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

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | 75,590,431.69 | 67,373,644.88 | 142,964,076.57 |
| 本期利润 | 121,009,238.06 | -67,982,483.03 | 53,026,755.03 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -125,276,829.60 | -41,855,693.37 | -167,132,522.97 |
| 其中：基金申购款 | 248,317.57 | 86,973.78 | 335,291.35 |
| 基金赎回款 | -125,525,147.17 | -41,942,667.15 | -167,467,814.32 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 71,322,840.15 | -42,464,531.52 | 28,858,308.63 |

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 | 176,859.80 |
| 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 | 22,140.81 |
| 其他 | 7,528.18 |
| 合计 | 206,528.79 |

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 | 1,125,775,498.80 |
| 减：卖出股票成本总额 | 999,772,671.38 |
| 买卖股票差价收入 | 126,002,827.42 |

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 | 49,993.30 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 42,900.00 |
| 减：应收利息总额 | 20.50 |
| 买卖债券差价收入 | 7,072.80 |

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 | 684,818.14 |
| 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 | 684,818.14 |

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 | -67,982,483.03 |
| ——股票投资 | -67,970,822.81 |
| ——债券投资 | -11,660.22 |
| ——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 | -67,982,483.03 |

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 | 595,361.33 |
| 替代损益 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 595,361.33 |

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 | 2,618,757.12 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 2,618,757.12 |

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 | 360.00 |
| 银行费用 | 3,600.67 |
| 指数使用费 | - |
| 持有人大会-公证费 | - |
| 持有人大会-律师费 | - |
| 开户费 | - |
| 上市费 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 108,099.02 |

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 |
| 中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”) | 基金托管人, 基金代销机构 |
| 东方证券股份有限公司 (“东方证券”) | 基金管理人的股东, 基金代销机构 |
| 上海上报资产管理有限公司 | 基金管理人的股东 |

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 | 236,368,580.27 | 16.66 | 203,534,837.84 | 16.01 |

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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 | 占当期回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 (%) |
| 东方证券 | - | - | 250,000,000.00 | 45.45 |

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 | 218,924.49 | 17.22 | - | - |
| 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 | 186,743.70 | 16.41 | 102,174.48 | 17.87 |

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 | 3,223,310.71 | 7,707,304.36 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 982,638.23 | 3,214,091.46 |

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

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 | 537,218.52 | 1,284,550.67 |

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

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

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 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 (%) |
| 上海上报资产管理有限公司 | 49,001,205.00 | 21.74 | 49,001,205.00 | 5.10 |

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 |
| 建设银行 | 97,377,655.85 | 176,859.80 | 27,549,752.21 | 1,260,728.65 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。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 |
| 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 | |
| 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 | |
| 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 | |
| 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 | |
| 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 | 136 | 6,436.88 | 34,266.56 | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|--|
| 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 | |
| 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 | 157 | 2,595.21 | 7,232.99 | |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年05月17日 | 2021年11月26日 | 新股流通受限 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | |
| 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 | 162 | 4,581.36 | 18,745.02 | |
| 688260 | 昀冢科技 | 2021年03月25日 | 2021年10月08日 | 新股流通受限 | 9.63 | 16.41 | 2,990 | 28,793.70 | 49,065.90 | |
| 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 | |
| 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 | |
| 300942 | 易瑞 | 2021年02 | 2021年08 | 新股 | 5.31 | 28.52 | 443 | 2,352.33 | 12,634.36 | |

| | 生物 | 月 02 日 | 月 09 日 | 流通受限 | | | | | | |
|--------|------|------------------|------------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|
| 688659 | 元琛科技 | 2021 年 03 月 24 日 | 2021 年 10 月 08 日 | 新股流通受限 | 6.50 | 10.46 | 3,671 | 23,861.50 | 38,398.66 | |
| 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 | |
| 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 | |
| 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 | |
| 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 | |
| 300981 | 中红医疗 | 2021 年 04 月 19 日 | 2021 年 10 月 27 日 | 新股流通 | 48.59 | 90.39 | 129 | 6,268.11 | 11,660.31 | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-------------|--------|-------|-------|-------|----------|-----------|--|
| | | | | 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 | |
| 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 | |
| 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 | |
| 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 | |
| 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 | 930 | 6,389.10 | 11,225.10 | |
| 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：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

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于约定开放日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 | 97,377,655.85 | - | - | - | - | - | 97,377,655.85 |
| 结算备付金 | 67,555.45 | - | - | - | - | - | 67,555.45 |

| | | | | | | | |
|---------|------------|---|---|---|---|----------------|----------------|
| 存出保证金 | 350,569.33 | - | - | - | - | - | 350,569.33 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 156,938,148.89 | 156,938,148.89 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 51,600.00 | 51,600.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 9,643.57 | 9,643.57 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|----------|---------------|---|---|---|---|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 97,795,780.63 | - | - | - | - | 156,999,392.46 | 254,795,173.09 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 319,532.85 | 319,532.85 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 53,255.48 | 53,255.48 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 13.91 | 13.91 |
| 卖出回购金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|---------|---------------|------|--------|------|------|----------------|----------------|
| 款 | | | | | | | |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 89,310.59 | 89,310.59 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 104,138.35 | 104,138.35 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 566,251.18 | 566,251.18 |
| 利率敏感度缺口 | 97,795,780.63 | - | - | - | - | 156,433,141.28 | 254,228,921.91 |
| 上年度 | 1个月以内 | 1-3个 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| 末 202 0年 12 月 31 日 | | 月 | | | 上 | | |
|--------------------------------------|----------------|---|-----------|---|---|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 167,096,488.39 | - | - | - | - | - | 167,096,488.39 |
| 结算备付金 | 1,790,685.40 | - | - | - | - | - | 1,790,685.40 |
| 存出保证金 | 404,436.25 | - | - | - | - | - | 404,436.25 |
| 交易性金融资产 | - | - | 54,560.22 | - | - | 928,521,555.44 | 928,576,115.66 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 46,043.52 | 46,043.52 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 衍 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|----------|----------------|---|-----------|---|---|----------------|------------------|
| 生金融资产 | | | | | | | |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 10,289,378.50 | 10,289,378.50 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 169,291,610.04 | - | 54,560.22 | - | - | 938,856,977.46 | 1,108,203,147.72 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,690,341.44 | 1,690,341.44 |
| 应付 | - | - | - | - | - | 281,723.58 | 281,723.58 |

| | | | | | | | |
|-----------|---|---|---|---|---|--------------|--------------|
| 托管费 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 64.37 | 64.37 |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 1,557,171.16 | 1,557,171.16 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|-----------------------------|--------------------|---|---------------|---|---|--------------------|----------------------|
| 其他 负债 | - | - | - | - | - | 210,000.00 | 210,000.00 |
| 负债 总计 | - | - | - | - | - | 3,739,300.55 | 3,739,300.55 |
| 利率 敏 感 度 缺 口 | 169,291,610.0 4 | - | 54,560.2 2 | - | - | 935,117,676.9 1 | 1,104,463,847.1 7 |

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

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

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 | | | |
|------|----------------------|---------|-------------------|----|
| | 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 |
| 以外币计 | | | | |

| | | | | |
|-----------|---|---------------|---|---------------|
| 价的资产 | | | | |
| 银行存款 | - | - | - | - |
| 结算备付金 | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | 62,959,333.20 | - | 62,959,333.20 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | 51,600.00 | - | 51,600.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产总计 | - | 63,010,933.20 | - | 63,010,933.20 |
| 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 | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 63,010,933.20 | - | 63,010,933.20 |
| | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | | | |
| 项目 | 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 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 银行存款 | - | - | - | - |
| 结算备付金 | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | 150,757,081.72 | - | 150,757,081.72 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产总计 | - | 150,757,081.72 | - | 150,757,081.72 |
| 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 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---------------|---|----------------|---|----------------|
| 应付赎回款 | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 150,757,081.72 | - | 150,757,081.72 |

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 |
| | 港币相对人民币升值 5% | 3,150,546.66 | 7,537,854.09 |
| 港币相对人民币贬值 5% | -3,150,546.66 | -7,537,854.09 | |

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 | 156,938,148.89 | 61.73 | 928,521,555.44 | 84.07 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | 54,560.22 | 0.00 |
| 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 | 156,938,148.89 | 61.73 | 928,576,115.66 | 84.07 |

注：封闭期内，本基金投资于股票资产及存托凭证占基金资产的比例不低于 60%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）；每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，本基金仍需遵守投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%的比例限制，其余的投资比例不受上述比例限制。开放期内，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，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受上述限制，但每个交易日日终扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，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 | -9,893,003.45 | -36,341,307.04 |

| | | | |
|--|--------------------|--------------|---------------|
| | 跌 5% | | |
| | 沪深 300 指数上 涨 5% | 9,893,003.45 | 36,341,307.04 |

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 | 156,938,148.89 | 61.59 |
| | 其中：股票 | 156,938,148.89 | 61.59 |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | — | — |
| | 其中：债券 | — | — |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 4 | 贵金属投资 | — | — |
| 5 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 6 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 97,445,211.30 | 38.24 |
| 8 | 其他资产 | 411,812.90 | 0.16 |
| 9 | 合计 | 254,795,173.09 | 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 62,959,333.20 元，占期末净值比例为 24.76%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 11,290.28 | 0.00 |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | 63,164,645.38 | 24.85 |

| | | | |
|---|------------------|---------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 25,371.37 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 8,949.12 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,515.59 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 6,664,230.40 | 2.62 |
| J | 金融业 | 10,933,531.13 | 4.30 |
| K | 房地产业 | 13,130,674.00 | 5.16 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,130.30 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 22,457.73 | 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 | 93,978,815.69 | 36.97 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|---------------|--------------|
| 10 能源 | - | - |
| 15 原材料 | - | - |
| 20 工业 | - | - |
| 25 可选消费 | - | - |
| 30 日常消费 | 36,944,352.00 | 14.53 |
| 35 医疗保健 | - | - |
| 40 金融 | - | - |
| 45 信息技术 | - | - |
| 50 电信服务 | 19,437,388.80 | 7.65 |
| 55 公用事业 | - | - |
| 60 房地产 | 6,577,592.40 | 2.59 |
| 合计 | 62,959,333.20 | 24.76 |

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|
|----|------|------|-------|---------|-----------|

| | | | | | (%) |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 1 | 02319 | 蒙牛乳业 | 500,000 | 19,533,078.00 | 7.68 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 40,000 | 19,437,388.80 | 7.65 |
| 3 | 00291 | 华润啤酒 | 300,000 | 17,411,274.00 | 6.85 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 8,000 | 16,453,600.00 | 6.47 |
| 5 | 001914 | 招商积余 | 764,300 | 13,130,674.00 | 5.16 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 40,000 | 11,915,600.00 | 4.69 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 199,967 | 10,836,211.73 | 4.26 |
| 8 | 300760 | 迈瑞医疗 | 20,000 | 9,601,000.00 | 3.78 |
| 9 | 002271 | 东方雨虹 | 150,000 | 8,298,000.00 | 3.26 |
| 10 | 002507 | 涪陵榨菜 | 200,000 | 7,532,000.00 | 2.96 |
| 11 | 600588 | 用友网络 | 200,000 | 6,652,000.00 | 2.62 |
| 12 | 06049 | 保利物业 | 150,000 | 6,577,592.40 | 2.59 |
| 13 | 600690 | 海尔智家 | 200,000 | 5,182,000.00 | 2.04 |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 100,000 | 3,683,000.00 | 1.45 |
| 15 | 601665 | 齐鲁银行 | 6,731 | 62,598.30 | 0.02 |
| 16 | 603529 | 爱玛科技 | 962 | 55,911.44 | 0.02 |
| 17 | 688260 | 昀冢科技 | 2,990 | 49,065.90 | 0.02 |
| 18 | 688659 | 元琛科技 | 3,671 | 38,398.66 | 0.02 |
| 19 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.01 |
| 20 | 300957 | 贝泰妮 | 136 | 34,266.56 | 0.01 |
| 21 | 300973 | 立高食品 | 216 | 27,115.02 | 0.01 |
| 22 | 001207 | 联科科 | 682 | 22,581.02 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| | | 技 | | | |
| 23 | 300908 | 仲景食品 | 285 | 16,983.15 | 0.01 |
| 24 | 300909 | 汇创达 | 386 | 16,636.60 | 0.01 |
| 25 | 605196 | 华通线缆 | 1,172 | 16,079.84 | 0.01 |
| 26 | 605300 | 佳禾食品 | 576 | 16,012.80 | 0.01 |
| 27 | 300982 | 苏文电能 | 317 | 14,356.93 | 0.01 |
| 28 | 605180 | 华生科技 | 384 | 14,208.00 | 0.01 |
| 29 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.01 |
| 30 | 300942 | 易瑞生物 | 443 | 12,634.36 | 0.00 |
| 31 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 32 | 300981 | 中红医疗 | 129 | 11,660.31 | 0.00 |
| 33 | 300889 | 爱克股份 | 479 | 11,639.70 | 0.00 |
| 34 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 35 | 300968 | 格林精密 | 930 | 11,225.10 | 0.00 |
| 36 | 605488 | 福莱新材 | 416 | 11,103.04 | 0.00 |
| 37 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 38 | 605259 | 绿田机械 | 295 | 10,516.75 | 0.00 |
| 39 | 300962 | 中金辐照 | 576 | 9,429.12 | 0.00 |
| 40 | 300952 | 恒辉安防 | 340 | 9,207.20 | 0.00 |
| 41 | 300966 | 共同药业 | 286 | 9,020.44 | 0.00 |
| 42 | 300945 | 曼卡龙 | 474 | 8,949.12 | 0.00 |
| 43 | 300948 | 冠中生态 | 324 | 8,884.08 | 0.00 |
| 44 | 300950 | 德固特 | 219 | 8,569.47 | 0.00 |
| 45 | 605162 | 新中 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| | | 港 | | | |
| 46 | 300958 | 建工修复 | 300 | 8,166.00 | 0.00 |
| 47 | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 48 | 300993 | 玉马遮阳 | 410 | 7,908.90 | 0.00 |
| 49 | 300930 | 屹通新材 | 322 | 7,882.56 | 0.00 |
| 50 | 300955 | 嘉亨家化 | 157 | 7,232.99 | 0.00 |
| 51 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 52 | 300991 | 创益通 | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 53 | 300943 | 春晖智控 | 255 | 5,867.55 | 0.00 |
| 54 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 55 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 56 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 57 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 58 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 59 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 60 | 300877 | 金春股份 | 69 | 2,537.13 | 0.00 |
| 61 | 001205 | 盛航股份 | 77 | 2,515.59 | 0.00 |
| 62 | 601156 | 东航物流 | 90 | 2,130.30 | 0.00 |
| 63 | 300865 | 大宏立 | 11 | 330.88 | 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 | 002013 | 中航机电 | 39,128,520.01 | 3.54 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 2 | 600588 | 用友网络 | 36,073,781.00 | 3.27 |
| 3 | 603501 | 韦尔股份 | 31,794,888.00 | 2.88 |
| 4 | 00291 | 华润啤酒 | 29,792,460.16 | 2.70 |
| 5 | 002271 | 东方雨虹 | 24,353,191.50 | 2.20 |
| 6 | 600862 | 中航高科 | 21,584,883.32 | 1.95 |
| 7 | 00700 | 腾讯控股 | 16,739,075.20 | 1.52 |
| 8 | 300616 | 尚品宅配 | 15,307,367.20 | 1.39 |
| 9 | 06049 | 保利物业 | 14,221,368.06 | 1.29 |
| 10 | 001914 | 招商积余 | 14,183,683.00 | 1.28 |
| 11 | 02319 | 蒙牛乳业 | 11,579,646.96 | 1.05 |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 10,129,467.32 | 0.92 |
| 13 | 06969 | 思摩尔国际 | 8,964,989.92 | 0.81 |
| 14 | 002507 | 涪陵榨菜 | 8,918,268.30 | 0.81 |
| 15 | 600690 | 海尔智家 | 6,755,544.68 | 0.61 |
| 16 | 600809 | 山西汾酒 | 3,697,829.00 | 0.33 |
| 17 | 688680 | 海优新材 | 195,482.30 | 0.02 |
| 18 | 688619 | 罗普特 | 113,079.36 | 0.01 |
| 19 | 601963 | 重庆银行 | 80,921.76 | 0.01 |
| 20 | 688083 | 中望软件 | 66,069.50 | 0.01 |

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 | 600036 | 招商银行 | 104,331,909.46 | 9.45 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 82,749,700.77 | 7.49 |
| 3 | 002142 | 宁波银行 | 79,325,569.85 | 7.18 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 69,717,557.26 | 6.31 |
| 5 | 00388 | 香港交易所 | 66,278,306.00 | 6.00 |
| 6 | 002271 | 东方雨虹 | 62,773,953.42 | 5.68 |
| 7 | 600588 | 用友网络 | 54,894,922.87 | 4.97 |
| 8 | 300760 | 迈瑞医疗 | 49,418,662.80 | 4.47 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 46,664,218.76 | 4.23 |
| 10 | 00700 | 腾讯控股 | 36,762,894.64 | 3.33 |
| 11 | 002013 | 中航机电 | 35,213,674.34 | 3.19 |
| 12 | 600862 | 中航高科 | 34,914,488.00 | 3.16 |
| 13 | 002352 | 顺丰控股 | 34,872,944.50 | 3.16 |
| 14 | 001914 | 招商积余 | 34,833,740.10 | 3.15 |
| 15 | 06049 | 保利物业 | 33,961,213.88 | 3.07 |
| 16 | 601888 | 中国中免 | 33,226,035.42 | 3.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 17 | 603259 | 药明康德 | 30,631,026.67 | 2.77 |
| 18 | 603501 | 韦尔股份 | 29,451,254.00 | 2.67 |
| 19 | 002179 | 中航光电 | 28,636,899.08 | 2.59 |
| 20 | 03690 | 美团-W | 24,179,796.97 | 2.19 |

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 | 296,160,087.64 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,125,775,498.80 |

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

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，腾讯控股有限公司、招商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 | 350,569.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 51,600.00 |
| 4 | 应收利息 | 9,643.57 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 411,812.90 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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（%） |
| 3,452 | 65,286.97 | 68,872,077.74 | 30.56 | 156,498,535.54 | 69.44 |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例（%） |
|----|-------------------|--------------|-------------|
| 1 | 泰康人寿保险有限责任公司-万能-个 | 5,350,503.00 | 17.19 |

| | | | |
|----|--|--------------|------|
| | 险万能(乙) | | |
| 2 | 永安国富资产管理 有限公司-永安国 富-钱塘混合投资 私募基金 | 2,399,948.00 | 7.71 |
| 3 | 诚泰融资租赁(上 海)有限公司 | 1,984,306.00 | 6.37 |
| 4 | 上海宁泉资产管 理有限公司-宁泉致 远18号私募证券投 资基金 | 1,086,643.00 | 3.49 |
| 5 | 吴端方 | 992,332.00 | 3.19 |
| 6 | 上海宁泉资产管 理有限公司-宁泉致 远20号私募证券投 资基金 | 870,694.00 | 2.80 |
| 7 | 王洪斌 | 513,856.00 | 1.65 |
| 8 | 毕密珍 | 504,800.00 | 1.62 |
| 9 | 陈强 | 494,093.00 | 1.59 |
| 10 | 中信证券-建设银 行-中信证券鑫盛1 号集合资产管理计 划 | 492,390.00 | 1.58 |

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

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019年01月31日） 基金份额总额 | 961,499,770.60 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 961,499,770.60 |

| | |
|---------------|----------------|
| 本报告期基金总申购份额 | 1,474,073.31 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 737,603,230.63 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 225,370,613.28 |

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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，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 (%) | |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|--------|---|----------------|-------|------------|-------|--|
| 东方证券 | 2 | 236,368,580.27 | 16.66 | 218,924.49 | 17.22 | |
| 华兴证券 | 2 | 232,773,239.92 | 16.40 | 201,768.15 | 15.87 | |
| 申万宏源证券 | 2 | 221,013,462.34 | 15.58 | 203,973.32 | 16.04 | |
| 方正证券 | 2 | 138,608,638.19 | 9.77 | 123,689.03 | 9.73 | |
| 中泰证券 | 2 | 132,027,895.18 | 9.30 | 125,211.66 | 9.85 | |
| 国金证券 | 2 | 105,365,310.05 | 7.43 | 94,592.01 | 7.44 | |
| 中信建投证券 | 4 | 96,016,888.64 | 6.77 | 87,370.55 | 6.87 | |
| 野村东方国际 | 2 | 86,386,517.77 | 6.09 | 72,579.34 | 5.71 | |
| 西部证券 | 2 | 67,734,254.18 | 4.77 | 49,641.36 | 3.90 | |
| 东吴证券 | 2 | 36,686,622.83 | 2.59 | 33,643.83 | 2.65 | |
| 太平洋证券 | 2 | 25,795,042.59 | 1.82 | 23,148.74 | 1.82 | |
| 华泰证券 | 2 | 20,359,337.21 | 1.43 | 18,673.07 | 1.47 | |
| 海通证券 | 2 | 19,864,673.26 | 1.40 | 18,102.90 | 1.42 | |
| 川财证券 | 2 | - | - | - | - | |
| 联讯证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | |
| 中信证券 | 3 | - | - | - | - | |

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 (%) |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华兴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 野村东方国际 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 49,993.30 | 100.00 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|----------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 中信 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
|----------|---|---|---|---|---|---|---|---|

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 2 家证券公司的 3 个交易单元:浙商证券(深交所单元)、中信建投证券(深交所单元,上交所单元)。

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 | 关于汇添富悦享定期开放混合型证券投资基金第一次自由开放期开放申购、赎回和转换业务的公 | 中证报,上交所,公司网站 | 2021 年 01 月 28 日 |

| | | | |
|---|-------------------------------------|---------------------|------------------|
| | 告 | | |
| 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|----------------------------------|---------------|------|------|---------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 2021 年 2 月 18 日至 2021 年 6 月 30 日 | 49,001,205.00 | - | - | 49,001,205.00 | 21.74 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时,少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高,其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时,更容易触发巨额赎回条款,基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后,可能导致基金规模较小,基金持续稳定运作可</p> | | | | | | | |

能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，很可能出现开放期最后一日基金资产净值加上当日净申购的基金份额对应的资产净值减去当日净赎回的基金份额对应的资产净值低于 5000 万元的情形，按照法律法规与《基金合同》的约定，本基金将面临提前终止基金合同的风险。若未触发前述提前终止情形，持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，本基金有可能在运作过程中资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

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悦享定期开放混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富悦享定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富悦享定期开放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、报告期内汇添富悦享定期开放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 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