

汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	52
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	52
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细	53
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	73
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	75
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	75

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	76
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	76
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	76
7.11 投资组合报告附注.....	76
§ 8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	77
§ 9 开放式基金份额变动	77
§ 10 重大事件揭示	78
10.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
10.4 基金投资策略的改变.....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
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.....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
10.8 其他重大事件.....	81
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
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.....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§ 12 备查文件目录	82
12.1 备查文件目录.....	82
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	83

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	汇添富全球互联混合（QDII）
基金主代码	001668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 01 月 25 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	990,952,967.11
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球移动互联主题相关公司的股票，通过对投资对象的精选和组合管理，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金资产配置策略及股票投资策略适用于境内市场投资、境外市场投资及港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票的投资。本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析全球经济形势、经济结构特征、地区及产业竞争优势以及股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选出全球移动互联主题相关公司中商业模式清晰、竞争优势明显、具有长期持续增长模式且估值水平相对合理的上市公司，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。本基金的投资策略还包括：债券投资、衍生品投资。
业绩比较基准	人民币计价的中证海外中国互联网指数收益率*50%+中证移动互联网指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为主要投资于全球移动互联主题相关公司股票混合型基金的，属于证券投资基金中高预期风险高预期收益的品种，其预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人		基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司		中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799

电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李文	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外资产托管人	
名称	中文	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	Brown Brothers Harriman & Co.
注册地址	140 Broadway New York	
办公地址	140 Broadway New York	
邮政编码	NY 10005	

注：本基金无境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日 - 2021年06月30日)
本期已实现收益	34,939,292.67
本期利润	67,054,890.28
加权平均基金份额本期利润	0.0710
本期加权平均净值利润率	2.41%
本期基金份额净值增长率	4.29%
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	383,832,907.72

期末可供分配基金份额利润	0.3873
期末基金资产净值	2,985,385,183.15
期末基金份额净值	3.013
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	201.30%

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。

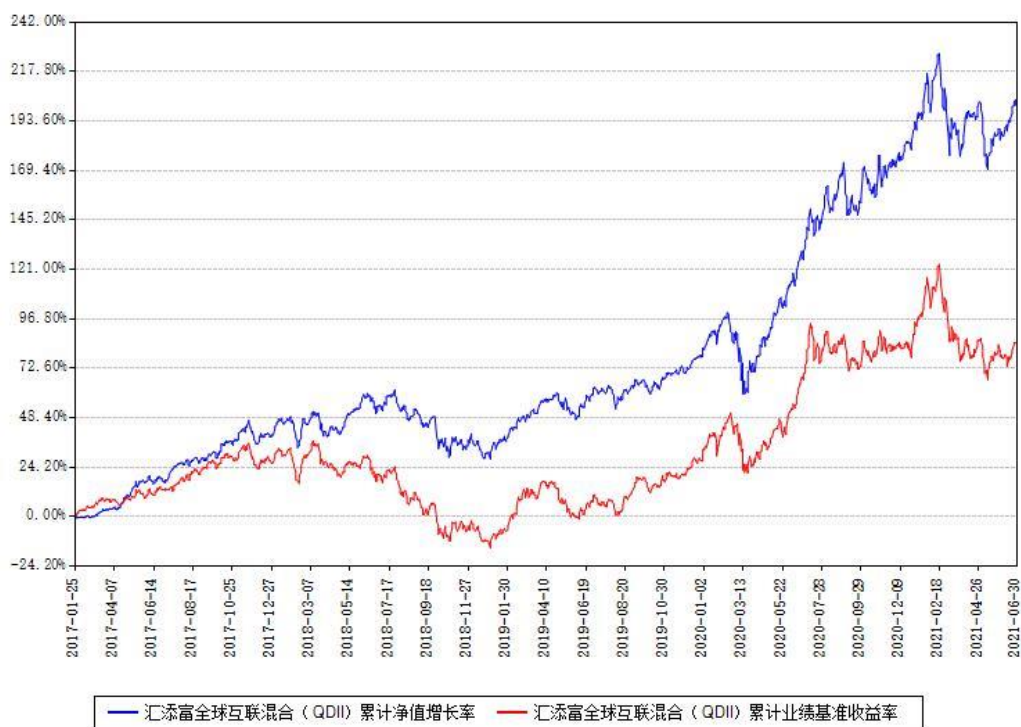
3.2 基金净值表现

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	4.80%	0.87%	2.36%	1.13%	2.44%	-0.26%
过去三个月	5.31%	1.11%	3.41%	1.33%	1.90%	-0.22%
过去六个月	4.29%	1.49%	-2.10%	1.68%	6.39%	-0.19%
过去一年	31.11%	1.44%	9.00%	1.60%	22.11%	-0.16%
过去三年	95.52%	1.37%	53.40%	1.62%	42.12%	-0.25%
自基金合同生效日起至今	201.30%	1.23%	85.30%	1.45%	116.00%	-0.22%

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

汇添富全球互联混合（QDII）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01月25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		
沈若雨	本基金的基金经理助理	2020 年 06 月 18 日		9	国籍:中国。学历:复旦大学微电子学学士，悉尼大学数量金融硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2011 年 11 月至 2013 年 9 月任申银万国证券研究所分析师，2013 年 10 月至 2015 年 3 月任富国基金分析师，2015 年 4 月至 2020 年 4 月任易方达基金研究部高级研究员。2020 年 5 月至今任汇添富基金管理股份有限公司研究部高级行业分析师。2020 年 6 月 18 日至今任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2020 年 6 月 18 日至今任汇添富移动互联股票型证券投资基金的基金经理助理。2021 年 1 月

					12 日至今任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
杨璿	本基金的基金经理	2017 年 01 月 25 日		11	<p>国籍:中国。学历:清华大学工程学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。</p> <p>从业经历:2010 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 2010 年 8 月至 2017 年 1 月担任公司的 TMT 行业分析师。2017 年 1 月 25 日至今任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月 21 日至今任汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 7 月 5 日至今任汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。</p> <p>2019 年 1 月 18 日至 2020 年 12 月 22 日任汇添富移动互联股票型证券投资基金的基金经理。2020 年 5 月 25 日至今任汇添富优质成长混合型证券投资基金的基金经</p>

					理。2020 年 11 月 18 日至今任汇添富数字生活主题六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 24 日至今任汇添富数字未来混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

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

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,本基金管理人对满足限价条件且对同一证券

有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统内的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

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

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

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，经过了年初延续去年的趋势性上涨、春节后的快速下跌，此后全球股指开始呈现一路向上的态势。新冠疫情在全球各地进展不一，中国大陆作为控制最好的地区，虽有部分省份出现零星病例，但整体非常稳定，为各行业的平稳发展创造了良好的环境。新兴市场疫情快速蔓延，对很多国家的供应链、生产产生了巨大影响；欧美等成熟市场由于疫苗接种的普及，疫情得到了有效的控制，虽然变异毒株使得疫苗的有效性下降，但经济重回正轨的趋势不变。

由于 2020 年疫情的影响，全球供应链普遍较为谨慎，对需求快速恢复的预期不足，导致产能扩张与供应链备货都非常有限。在今年全球普遍流动性宽松、美国刺激政策力度较大的背景下，需求端快速恢复，供给端出现显著压力，加上新兴市场的疫情蔓延，中国的供应链与品牌开始承接需求转移，我们观察到很多行业的龙头企业的全球份额得以快速提升。

但与此同时，由于阶段性的供需失衡，大宗商品价格快速上涨，带动整个产业链条的成

本上涨，加上集装箱海运等供给极度紧张，导致通胀压力不断上升、进出口贸易不够顺畅，也带来了一些负面影响。

对于全球移动互联网面对的科技领域，我们分三条主线来进行论述。

1. 移动互联网板块，数字娱乐、数字广告、电子商务等需求旺盛，但中国互联网企业面临阶段性政策压力较大、部分企业处于投入周期，上半年表现远远落后于大市，是本只基金的最主要拖累；

2. 数字化软硬件板块，在疫情的催化下，行业发展进一步加速，但估值亦处于较高水平，表现居中；

3. 半导体板块，由于上述的阶段性供需失衡严重，很多企业的交货周期不断拉长、产品价格上涨，带来了较强的盈利向上周期，是表现最好的板块。

回顾上半年，我们减持了部分政策风险较高的子板块，增持了半导体板块与海外互联网部分个股。我们仍然看好在数字化浪潮的大背景下，那些提供基础软硬件、核心芯片、具备定价权的互联网龙头企业。国内的高压政策会影响小部分企业的正常运营与商业逻辑，但从海外的经验来看，并不会对大部分龙头企业的定价权、行业地位产生根本性的影响。

4.5.2 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 4.29%。同期业绩比较基准收益率为-2.10%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年国内经济走势趋弱。消费、出口、投资三驾马车中，消费在去年高基数的基础上放缓，加上疫情对大众阶层的消费能力有明显负面影响；出口亦面临下半年极高的基数；地产投资下行，基建与制造业投资可能是主要支柱。总体经济展望不容乐观，但在全球流动性较为宽松的背景下，预计市场仍会有结构性机会，我们认为机会可能集中于新兴消费/新兴品牌、国产替代、数字化转型、高端制造、新能源等。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责

研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会

计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富全球移动互联灵活配置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	265,395,382.02	206,948,375.39
结算备付金		18,326,296.22	328,694.81
存出保证金		697,819.62	1,059,478.00
交易性金融资产	6.4.7.2	2,725,409,172.59	2,047,209,845.56
其中：股票投资		2,725,196,609.46	2,046,853,272.82
基金投资		212,563.13	356,572.74
债券投资		-	-
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		48,972,591.66	-
应收利息	6.4.7.5	18,832.72	12,918.52
应收股利		403,345.88	302,556.96
应收申购款		11,451,888.23	41,138,823.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,070,675,328.94	2,297,000,692.43
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		-	69,246,833.33
应付赎回款		79,746,277.74	41,262,708.22
应付管理人报酬		4,349,595.63	3,012,060.81
应付托管费		845,754.72	585,678.48
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	159,629.22	50,594.83
应交税费		-	12,773.12
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	188,888.48	248,430.56
负债合计		85,290,145.79	114,419,079.35
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	990,952,967.11	755,580,083.20
未分配利润	6.4.7.1 0	1,994,432,216.04	1,427,001,529.88
所有者权益合计		2,985,385,183.15	2,182,581,613.08
负债和所有者权益总计		3,070,675,328.94	2,297,000,692.43

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.013 元，基金份额总额 990,952,967.11 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		100,011,507.55	166,218,054.28
1. 利息收入		212,783.34	88,566.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	212,783.34	88,430.79
债券利息收入		-	135.96
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）		65,125,772.24	4,444,829.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	60,461,716.41	2,327,505.83
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	21,875.35
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	4,664,055.83	2,095,448.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	32,115,597.61	160,615,625.04
4. 汇兑收益（损失以“-”号填		-1,297,277.13	-540,789.53

列)			
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	3,854,631.49	1,609,822.79
减：二、费用		32,956,617.27	6,439,754.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,893,541.83	4,918,223.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,840,410.90	956,321.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	3,063,382.26	441,483.30
5. 利息支出		0.18	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.51
7. 其他费用	6.4.7.21	159,282.10	123,725.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		67,054,890.28	159,778,299.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		67,054,890.28	159,778,299.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富全球移动互联灵活配置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）	755,580,083.20	1,427,001,529.88	2,182,581,613.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,054,890.28	67,054,890.28
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）	235,372,883.91	500,375,795.88	735,748,679.79
其中：1. 基金申购款	696,603,534.12	1,397,300,558.78	2,093,904,092.90
2. 基金赎回款	-461,230,650.21	-896,924,762.90	-1,358,155,413.11
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）	990,952,967.11	1,994,432,216.04	2,985,385,183.15
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）	202,721,503.92	159,002,716.93	361,724,220.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	159,778,299.70	159,778,299.70
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）	216,568,083.74	225,483,449.59	442,051,533.33
其中：1. 基金申购款	424,971,173.79	414,233,354.14	839,204,527.93
2. 基金赎回款	-208,403,090.05	-188,749,904.55	-397,152,994.60
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）	419,289,587.66	544,264,466.22	963,554,053.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

基金管理人负责人

李骁

主管会计工作负责人

雷青松

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富全球移动互联灵活配置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(2015(1478 号文《关于准予汇添富

全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的准予注册，并获中国证券监督管理委员会机构部函[2016]2979 号文《关于汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》准予延期募集，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2017 年 1 月 25 日生效，首次设立募集规模为 268,156,205.81 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）。

本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（以下无特别说明，均包括 exchange traded fund, ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品、结构性投资产品；本基金还可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票（包含中小板、创业板、其他依法上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金；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）。

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

本基金主要投资于全球移动互联主题相关公司的股票，通过对投资对象的精选和组合管理，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金业绩比较基准为： $50\% \times$ 人民币计价的中证海外中国互联网指数收益率 $+50\% \times$ 中证移动互联网指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证

券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》

的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

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

6.4.6.1 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
活期存款	265,395,382.02
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	265,395,382.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票	2,131,073,212.2 2	2,725,196,609.4 6	594,123,397.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	境外 OTC 市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	6,936,479.55	212,563.13	-6,723,916.42
其他	-	-	-
合计	2,138,009,691.7 7	2,725,409,172.5 9	587,399,480.82

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	17,955.11
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	846.91
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	30.70
合计	18,832.72

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	159,629.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	159,629.22

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	84,750.13
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	188,888.48

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	755,580,083.20	755,580,083.20
本期申购	696,603,534.12	696,603,534.12
本期赎回（以“-”号填列）	-461,230,650.21	-461,230,650.21
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	990,952,967.11	990,952,967.11

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	262,102,212.39	1,164,899,317.49	1,427,001,529.88
本期利润	34,939,292.67	32,115,597.61	67,054,890.28
本期基金份额交易产生的变动数	86,791,402.66	413,584,393.22	500,375,795.88
其中：基金申购款	258,593,765.24	1,138,706,793.54	1,397,300,558.78
基金赎回款	-171,802,362.58	-725,122,400.32	-896,924,762.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	383,832,907.72	1,610,599,308.32	1,994,432,216.04

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	204,825.00
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	5,789.90
其他	2,168.44
合计	212,783.34

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	902,045,538.72
减：卖出股票成本总额	841,583,822.31
买卖股票差价收入	60,461,716.41

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

注：本基金本报告期无债券投资收益。

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	4,664,055.83
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,664,055.83

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	32,115,597.61
——股票投资	32,259,607.22
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-144,009.61
——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	32,115,597.61

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	3,854,631.49
替代损益	-
其他	-

合计	3,854,631.49
----	--------------

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	3,063,382.26
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
合计	3,063,382.26

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	-
银行费用	162.00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	54,981.75
合计	159,282.10

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Harriman & Co.) (“布朗兄弟”)	基金境外托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司

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	586,053,904.84	24.60	212,270,918.76	33.46

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	129,695.20	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	518,931.98	21.77	159,629.22	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 (%)
东方证券	183,755.32	65.97	109,924.90	100.00

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	24,893,541.83	4,918,223.91
其中：支付销售机构的客户维护费	5,629,317.93	1,090,156.38

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,840,410.90	956,321.31

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 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

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
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	13,975,456.74	-
报告期间申购/买入总份额	8,298,216.42	-
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	22,273,673.16	-
报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例（%）	2.25	-

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

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 (%)
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	1,994,510.74	0.20	-	-
汇添富资本管理有限公司	15,432,638.68	1.56	9,393,361.52	1.24

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	227,591,667.35	204,081.48	49,919,122.82	66,033.52
布朗兄弟	37,803,714.67	743.52	31,913,803.85	12,323.26

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。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
300996	普联软件	2021年05月26日	2021年12月03日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	
300955	嘉亨家化	2021年03月16日	2021年09月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	
688665	四方光电	2021年02月02日	2021年08月09日	新股流通受限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	
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	
3009	贝泰妮	202	202	新	47.3	251.	853	40,372.49	214,921.88	

57		1 年 03 月 18 日	1 年 09 月 27 日	股 流 通 受 限	3	96				
6887 00	东威科 技	202 1 年 06 月 07 日	202 1 年 12 月 15 日	新 股 流 通 受 限	9.41	38.4 6	3,049	28,691.09	117,264.54	
3009 45	曼卡龙	202 1 年 02 月 03 日	202 1 年 08 月 10 日	新 股 流 通 受 限	4.56	18.8 8	474	2,161.44	8,949.12	
3009 50	德固特	202 1 年 02 月 24 日	202 1 年 09 月 03 日	新 股 流 通 受 限	8.41	39.1 3	219	1,841.79	8,569.47	
3009 92	泰福泵 业	202 1 年 05 月 17 日	202 1 年 11 月 25 日	新 股 流 通 受 限	9.36	20.3 2	200	1,872.00	4,064.00	
3010 13	利和兴	202 1 年 06 月 21 日	202 1 年 12 月 29 日	新 股 流 通 受 限	8.72	27.1 1	471	4,107.12	12,768.81	
3010 17	漱玉平 民	202 1 年	202 1 年	新 股 流	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	

		06 月 23 日	07 月 05 日	通 受 限						
3010 17	漱玉平 民	202 1 年 06 月 23 日	202 2 年 01 月 05 日	新 股 流 通 受 限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	
3010 10	晶雪节 能	202 1 年 06 月 09 日	202 1 年 12 月 20 日	新 股 流 通 受 限	7.83	17.6 1	218	1,706.94	3,838.98	
3006 14	百川畅 银	202 1 年 05 月 18 日	202 1 年 11 月 25 日	新 股 流 通 受 限	9.19	40.3 8	329	3,023.51	13,285.02	
3010 18	申菱环 境	202 1 年 06 月 28 日	202 1 年 07 月 07 日	新 股 流 通 受 限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	
6883 16	青云科 技	202 1 年 03 月 05 日	202 1 年 09 月 16 日	新 股 流 通 受 限	63.7 0	65.0 0	1,428	90,963.60	92,820.00	
6884 99	利元亨	202 1 年 06 月	202 1 年 07 月	新 股 流 通 受	38.8 5	38.8 5	2,149	83,488.65	83,488.65	

		23 日	01 日	限						
3009 73	立高食 品	202 1 年 04 月 08 日	202 1 年 10 月 15 日	新 股 流 通 受 限	28.2 8	115. 71	360	10,180.80	41,655.60	
6882 16	气派科 技	202 1 年 06 月 15 日	202 1 年 12 月 23 日	新 股 流 通 受 限	14.8 2	47.6 4	2,000	29,640.00	95,280.00	
3010 18	申菱环 境	202 1 年 06 月 28 日	202 2 年 01 月 07 日	新 股 流 通 受 限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	
6883 55	明志科 技	202 1 年 04 月 30 日	202 1 年 11 月 12 日	新 股 流 通 受 限	17.6 5	23.8 0	2,710	47,831.50	64,498.00	
3010 16	雷尔伟	202 1 年 06 月 23 日	202 1 年 12 月 30 日	新 股 流 通 受 限	13.7 5	32.9 8	275	3,781.25	9,069.50	
3009 95	奇德新 材	202 1 年 05 月 17 日	202 1 年 11 月 26 日	新 股 流 通 受 限	14.7 2	23.3 2	191	2,811.52	4,454.12	

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	2021年07月07日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06
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
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
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
605287	德才股份	2021	2021	新股	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44

		年 06 月 28 日	年 07 月 06 日	流 通 受 限						
3009 93	玉马遮阳	202 1 年 05 月 17 日	202 1 年 11 月 24 日	新 股 流 通 受 限	12.1 0	19.2 9	410	4,961.00	7,908.90	
3010 07	德迈仕	202 1 年 06 月 04 日	202 1 年 12 月 16 日	新 股 流 通 受 限	5.29	14.4 4	303	1,602.87	4,375.32	
3009 71	博亚精工	202 1 年 04 月 07 日	202 1 年 10 月 15 日	新 股 流 通 受 限	18.2 4	28.2 9	245	4,468.80	6,931.05	
3009 97	欢乐家	202 1 年 05 月 26 日	202 1 年 12 月 02 日	新 股 流 通 受 限	4.94	13.0 5	928	4,584.32	12,110.40	
3009 29	华骐环保	202 1 年 01 月 12 日	202 1 年 07 月 21 日	新 股 流 通 受 限	13.8 7	29.5 5	183	2,538.21	5,407.65	
3009 68	格林精密	202 1 年 04	202 1 年 10	新 股 流 通	6.87	12.0 7	1,162	7,982.94	14,025.34	

		月 06 日	月 15 日	受 限						
3009 48	冠中生态	202 1 年 02 月 18 日	202 1 年 08 月 25 日	新股 流 通 受 限	8.67	27.4 2	324	2,808.00	8,884.08	1
6051 62	新中港	202 1 年 06 月 29 日	202 1 年 07 月 07 日	新股 流 通 受 限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	
3010 21	英诺激光	202 1 年 06 月 28 日	202 2 年 01 月 06 日	新股 流 通 受 限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	
3009 82	苏文电能	202 1 年 04 月 19 日	202 1 年 10 月 27 日	新股 流 通 受 限	15.8 3	45.2 9	317	5,018.11	14,356.93	
3009 43	春晖智控	202 1 年 02 月 03 日	202 1 年 08 月 10 日	新股 流 通 受 限	9.79	23.0 1	255	2,496.45	5,867.55	
3009 72	万辰生物	202 1 年 04 月 08	202 1 年 10 月 19	新股 流 通 受 限	7.19	12.6 5	430	3,091.70	5,439.50	

		日	日							
3010 12	扬电科技	2021 年 06 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股 流 通 受 限	8.05	24.2 6	170	1,368.50	4,124.20	
3009 81	中红医疗	2021 年 04 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股 流 通 受 限	48.5 9	90.3 9	601	29,202.59	54,324.39	
3010 15	百洋医药	2021 年 06 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流 通 受 限	7.64	38.8 3	462	3,529.68	17,939.46	
6880 87	英科再生	2021 年 06 月 30 日	2021 年 07 月 09 日	新股 流 通 受 限	21.9 6	21.9 6	2,469	54,219.24	54,219.24	
3009 30	屹通新材	2021 年 01 月 13 日	2021 年 07 月 21 日	新股 流 通 受 限	13.1 1	24.4 8	322	4,221.42	7,882.56	
3009 42	易瑞生物	2021 年 02 月 02 日	2021 年 08 月 09 日	新股 流 通 受 限	5.31	28.5 2	443	2,352.33	12,634.36	
3009	华利集	202	202	新	33.2	87.5	925	30,728.50	80,937.50	

79	团	1 年 04 月 15 日	1 年 10 月 26 日	股 流 通 受 限	2	0				
3009 58	建工修 复	202 1 年 03 月 18 日	202 1 年 09 月 29 日	新 股 流 通 受 限	8.53	27.2 2	300	2,559.00	8,166.00	
6880 83	中望软 件	202 1 年 03 月 04 日	202 1 年 09 月 13 日	新 股 流 通 受 限	150. 50	524. 08	1,837	276,468.50	962,734.96	
3009 62	中金辐 照	202 1 年 03 月 29 日	202 1 年 10 月 11 日	新 股 流 通 受 限	3.40	16.3 7	576	1,958.40	9,429.12	
3009 67	晓鸣股 份	202 1 年 04 月 02 日	202 1 年 10 月 13 日	新 股 流 通 受 限	4.54	11.5 4	507	2,301.78	5,850.78	
2150 HK	NAYUKI HOLDIN GS LTD	202 1 年 06 月 30 日	202 1 年 12 月 30 日	新 股 配 售 流 通 受 限	16.4 8	13.5 0	4,311,0 00	71,024,518 .22	58,218,582 .36	2
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券	证券名	成	可	流	认购	期末	数量(单	期末成本总	期末估值总	备

代码	称	功 认 购 日	流 通 日	通 受 限 类 型	价 格	估 值 单 价	位：张)	额	额	注
					-	-	-	-	-	

注：1、本基金持有的流通受限股票“冠中生态”（证券代码：300948）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 108 股（根据冠中生态 2020 年年度权益分派实施公告，冠中生态以公司现有总股本 93,340,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 0.80 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股，除权除息日为 2021 年 6 月 4 日。）。)

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且同一基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	265,395,382.02	-	-	-	-	-	265,395,382.02
结算备付金	18,326,296.22	-	-	-	-	-	18,326,296.22
存出保证金	697,819.62	-	-	-	-	-	697,819.62
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,725,409,172.59	2,725,409,172.59
应收股利	-	-	-	-	-	403,345.88	403,345.88
应收利息	-	-	-	-	-	18,832.72	18,832.72
应收申购款	-	-	-	-	-	11,451,888.23	11,451,888.23
衍生金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	48,972,591.66	48,972,591.66
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	284,419,497.86	-	-	-	-	2,786,255,831.08	3,070,675,328.94
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	79,746,277.74	79,746,277.74
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	4,349,595.63	4,349,595.63
应付 托管 费	-	-	-	-	-	845,754.72	845,754.72
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	159,629.22	159,629.22
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	188,888.48	188,888.48
负债总计	-	-	-	-	-	85,290,145.79	85,290,145.79
利率敏感度缺口	284,419,497.86	-	-	-	-	2,700,965,685.29	2,985,385,183.15
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	206,948,375.39	-	-	-	-	-	206,948,375.39
结算备付金	328,694.81	-	-	-	-	-	328,694.81
存出保证金	1,059,478.00	-	-	-	-	-	1,059,478.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,047,209,845.56	2,047,209,845.56
应收股利	-	-	-	-	-	302,556.96	302,556.96
应收利息	-	-	-	-	-	12,918.52	12,918.52
应收申购款	-	-	-	-	-	41,138,823.19	41,138,823.19
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	208,336,548.20	-	-	-	-	2,088,664,144.23	2,297,000,692.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	41,262,708.22	41,262,708.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,012,060.81	3,012,060.81
应付托管费	-	-	-	-	-	585,678.48	585,678.48
应付证券清算款	-	-	-	-	-	69,246,833.33	69,246,833.33
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	50,594.83	50,594.83
应交税费	-	-	-	-	-	12,773.12	12,773.12
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	248,430.56	248,430.56
负债总计	-	-	-	-	-	114,419,079.35	114,419,079.35

利率敏感程度缺口	208,336,548.20	-	-	-	-	1,974,245,064.88	2,182,581,613.08
----------	----------------	---	---	---	---	------------------	------------------

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：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	37,246,767.04	558,354.68	-	37,805,121.72
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,981,031,022.83	367,322,642.94	-	2,348,353,665.77
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	313,158.39	90,187.49	-	403,345.88
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	2,018,590,948.26	367,971,185.11	-	2,386,562,133.37
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	2,018,590,948.26	367,971,185.11	-	2,386,562,133.37
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	93,774,640.94	2,416,862.25	-	96,191,503.19
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,349,049,663.78	355,875,975.51	-	1,704,925,639.29
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	214,595.48	87,961.48	-	302,556.96
应收申	-	-	-	-

购款				
其他资产	-	-	-	-
资产总计	1,443,038,900.20	358,380,799.24	-	1,801,419,699.44
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	23,097,625.70	-	-	23,097,625.70
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	23,097,625.70	-	-	23,097,625.70

资产负债 表外 汇风险 敞口净 额	1, 419, 941, 274. 50	358, 380, 799. 24	-	1, 778, 322, 073. 74
-------------------------------	----------------------	-------------------	---	----------------------

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
	美元相对人民币升值 5%	100, 929, 547. 41	70, 997, 063. 73
	美元相对人民币贬值 5%	-100, 929, 547. 41	-70, 997, 063. 73
	港币相对人民币升值 5%	18, 398, 559. 26	17, 919, 039. 96
	港币相对人民币贬值 5%	-18, 398, 559. 26	-17, 919, 039. 96

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2, 725, 196, 609. 46	91. 28	2, 046, 853, 272. 82	93. 78
交易性金融资产—基金投资	212, 563. 13	0. 01	356, 572. 74	0. 02
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	2,725,409,172.59	91.29	2,047,209,845.56	93.80

注：本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%；投资于全球移动互联主题相关公司股票及存托凭证的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	中证海外中国互联网指数(人民币)上涨 5%	89,062,515.49	80,364,447.17
	中证海外中国互联网指数(人民币)下跌 5%	-89,062,515.49	-80,364,447.17

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	2,725,196,609.46	88.75
	其中：普通股	2,251,451,898.72	73.32
	存托凭证	473,744,710.74	15.43
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	212,563.13	0.01
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	283,721,678.24	9.24
8	其他各项资产	61,544,478.11	2.00
9	合计	3,070,675,328.94	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 232,947,555.82 元，占期末净值比例为 7.80%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	1,980,818,459.70	66.35
中国	377,055,506.82	12.63
中国香港	367,322,642.94	12.30
合计	2,725,196,609.46	91.28

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

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	111,760.98	0.00
20 工业	34,211,188.73	1.15

25 可选消费	645,957,216.58	21.64
30 日常消费	65,847,413.76	2.21
35 医疗保健	1,139,250.53	0.04
40 金融	37,056,778.99	1.24
45 信息技术	1,803,372,781.94	60.41
50 电信服务	110,218,230.91	3.69
55 公用事业	18,428.04	0.00
60 房地产	27,263,559.00	0.91
合计	2,725,196,609.46	91.28

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	87,450	153,041,093 .32	5.13
2	AMAZON COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	5,915	131,453,644 .60	4.40
3	Facebook Inc		FB US	纳斯达克交易所	美国	44,550	100,070,053 .08	3.35
4	Tencent Holdings	腾讯控股	700	香港交易所	中	190,100	92,376,190.	3.09

	Ltd	有限公司	HK	港 联 合 交 易 所	国 香 港		27	
5	Alphabet Inc.	谷歌 (Alphabet)	GOOGL US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	5,770	91,017,177. 73	3.05
6	Adobe Inc	奥多比公 司	ADBE US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	23,350	88,339,890. 71	2.96
7	Meituan	美团	3690 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	289,400	77,153,586. 22	2.58
8	SALESFORCE.COM, INC.	赛富时公 司	CRM US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	46,900	74,008,604. 61	2.48
9	Sea Ltd		SE US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	41,400	73,441,259. 24	2.46
10	ServiceNow, Inc.		NOW US	纽 约 证	美 国	17,750	63,015,126. 20	2.11

				券交易所				
11	JD.com, Inc.	京东集团 股份有限公司	JD US	纳斯达克 交易所	美国	117,500	60,580,718. 27	2.03
12	VISA INC.	VISA 公司	V US	纽约证 券交易 所	美国	38,950	58,833,997. 67	1.97
13	SQUARE, INC.		SQ US	纽约证 券交易 所	美国	37,100	58,431,475. 30	1.96
14	Nayuki Holdings Limited	奈雪的茶 控股有限 公司	2150 HK	香港联 合交易 所	中国 香港	4,311,0 00	58,218,582. 36	1.95
15	Pinterest, Inc.		PINS US	纽约证 券交易 所	美国	113,500	57,887,825. 58	1.94
16	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co., Ltd.	杭州海康 威视数字 技术股份 有限公司	00241 5	深圳证 券交	中国	893,800	57,650,100. 00	1.93

				易所				
17	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	台湾积体电路制造股份有限公司	TSM US	纽约证券交易所	美国	73,200	56,821,179.09	1.90
18	Bilibili Inc.	哔哩哔哩股份有限公司	BILI US	纳斯达克交易所	美国	70,500	55,490,450.17	1.86
19	NVIDIA CORP	英伟达公司	NVDA US	纳斯达克交易所	美国	10,650	55,046,932.01	1.84
20	PayPal Holdings, Inc.		PYPL US	纳斯达克交易所	美国	28,200	53,100,316.53	1.78
21	Maxscend Microelectronics Company Limited	江苏卓胜微电子股份有限公司	300782	深圳证券交易所	中国	96,408	51,819,300.00	1.74
22	Pinduoduo Inc.	拼多多	PDD US	纳斯达克交易所	美国	60,600	49,726,051.26	1.67

23	Focus Media Information Technology Co., Ltd.	分众传媒信息技术股份有限公司	002027	深圳证券交易所	中国	5,111,600	48,100,156.00	1.61
24	Kweichow Moutai Co., Ltd.	贵州茅台酒股份有限公司	600519	上海证券交易所	中国	18,700	38,460,290.00	1.29
25	ADVANCED MICRO DEVICES INC	美国超威半导体公司	AMD US	纳斯达克交易所	美国	61,100	37,075,308.49	1.24
26	Futu Holdings Ltd	富途控股有限公司	FUTU US	纳斯达克交易所	美国	32,000	37,022,057.89	1.24
27	NetEase, Inc	网易公司	NTES US	纳斯达克交易所	美国	49,250	36,667,931.36	1.23
28	NXP Semiconductors N. V.	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克交易所	美国	27,450	36,480,275.14	1.22
29	ZTO Express (Cayman) Inc.	中通快递(开曼)有	ZTO US	纽约	美国	172,000	33,723,014.02	1.13

		限公司		证 券 交 易 所				
30	Keysight Technologies, Inc.	是德科技 公司	KEYS US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	33,300	33,216,884. 57	1.11
31	Wayfair Inc.		W US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	16,200	33,040,194. 37	1.11
32	Will Semiconductor Co., Ltd. Shanghai	上海韦尔 半导体股 份有限公 司	60350 1	上 海 证 券 交 易 所	中 国	98,500	31,717,000. 00	1.06
33	DoorDash Inc		DASH US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	27,400	31,565,611. 94	1.06
34	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co., Ltd.	常州星宇 车灯股份 有限公司	60179 9	上 海 证 券 交 易 所	中 国	137,156	30,958,852. 32	1.04
35	FISERV INC	费哲金融 服务公司	FISV US	纳 斯 达 克	美 国	43,600	30,106,675. 88	1.01

				交易所				
36	DOCUSIGN INC		DOCU US	纳斯达克 交易 所	美国	16,600	29,980,432. 61	1.00
37	CrowdStrike Holdings, Inc.		CRWD US	纳斯达克 交易 所	美国	18,200	29,547,476. 70	0.99
38	AUTODESK INC	欧特克有 限公司	ADSK US	纳斯达克 交易 所	美国	15,650	29,511,254. 92	0.99
39	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技 公司	MU US	纳斯达克 交易 所	美国	51,000	27,997,944. 20	0.94
40	Lam Research Corp	拉姆研究 公司	LRCX US	纳斯达克 交易 所	美国	6,600	27,743,674. 66	0.93
41	Ke Holdings Inc.	贝壳集团	BEKE US	纽约证 券交 易	美国	88,513	27,263,559. 00	0.91

				所				
42	Wuliangye Yibin Co., Ltd	宜宾五粮液股份有限公司	000858	深圳证券交易所	中国	90,300	26,899,467.00	0.90
43	Glodon Company Limited	广联达科技股份有限公司	002410	深圳证券交易所	中国	388,674	26,507,566.80	0.89
44	Zendesk, Inc.		ZENUS	纽约证券交易所	美国	26,500	24,709,947.10	0.83
45	ASML HOLDING NV	阿斯麦公司	ASMLUS	纳斯达克交易所	美国	5,300	23,653,346.07	0.79
46	Xiaomi Corporation	小米集团	1810HK	香港联合交易所	中国香港	1,000,000	22,466,160.00	0.75
47	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴集团控股有限公司	BABAUS	纽约证券交易所	美国	15,100	22,121,824.32	0.74
48	Broadcom Inc.	博通公司	AVGO	纳	美	7,150	22,025,103.	0.74

			US	斯达克交易所	国		70	
49	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	金蝶国际软件集团有限公司	268 HK	香港联合交易所	中国香港	996,000	21,837,606.77	0.73
50	Vipshop Holdings Ltd	唯品会控股有限公司	VIPS US	纽约证券交易所	美国	160,000	20,755,009.28	0.70
51	Nexteer Automotive Group Limited	耐世特汽车系统集团有限公司	1316 HK	香港联合交易所	中国香港	2,299,000	20,659,880.74	0.69
52	Man Wah Holdings Limited	敏华控股有限公司	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	1,306,400	20,283,966.96	0.68
53	ACM Research, Inc.		ACMR US	纳斯达克交易所	美国	29,150	19,249,243.95	0.64
54	Tesla, Inc.	特斯拉	TSLA US	纳斯达克	美国	4,350	19,100,545.37	0.64

				克交易所				
55	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港联合交易所	中国香港	93,300	19,051,153.91	0.64
56	Kuaishou Technology	快手科技	1024 HK	香港联合交易所	中国香港	110,000	17,829,810.24	0.60
57	Qorvo, Inc.		QRVO US	纳斯达克交易所	美国	13,500	17,062,900.63	0.57
58	Goertek Inc.	歌尔股份有限公司	002241	深圳证券交易所	中国	378,100	16,159,994.00	0.54
59	China Automotive Engineering Research Institute Co., Ltd	中国汽车工程研究院股份有限公司	601965	上海证券交易所	中国	920,737	15,910,335.36	0.53
60	NSFOCUS Technologies Group Co., Ltd.	绿盟科技集团股份有限公司	300369	深圳证券交易所	中国	966,783	15,420,188.85	0.52

				易所				
61	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	16,600	14,687,269. 91	0.49
62	Roblox Corp		RBLX US	纽约证券交易所	美国	25,000	14,531,994. 95	0.49
63	AVIC Jonhon Optronic Technology Co.,Ltd.	中航光电 科技股份有限公司	00217 9	深圳证券交易所	中国	172,400	13,623,048. 00	0.46
64	STMICROELECTRONIC S N.V.	意法半导体公司	STM US	纽约证券交易所	美国	51,500	12,103,449. 56	0.41
65	Ming Yuan Cloud Group Holdings Limited	明源云集团 控股有限公司	909 HK	香港联合交易所	中国 香港	350,000	11,226,839. 40	0.38
66	SHOPIFY INC.		SHOP US	纽约证券交易所	美国	1,000	9,438,076.9 0	0.32

67	Fu Shou Yuan International Group Limited	福寿园国际集团有限公司	1448 HK	香港联合交易所	中国香港	986,000	6,218,866.07	0.21
68	Zwsoft Co., Ltd. (Guangzhou)	广州中望龙腾软件股份有限公司	688083	上海证券交易所	中国	1,837	962,734.96	0.03
69	Imeik Technology Development Co., Ltd.	爱美客技术发展股份有限公司	300896	深圳证券交易所	中国	851	671,336.88	0.02
70	Changchun Bcht Biotechnology Co.	长春百克生物科技股份公司	688276	上海证券交易所	中国	3,486	364,565.88	0.01
71	Cubic Sensor and Instrument Co., Ltd	四方光电股份有限公司	688665	上海证券交易所	中国	1,687	218,399.02	0.01
72	Yunnan Botanee Bio-Technology Group Co. LTD	云南贝泰妮生物科技集团股份有限公司	300957	深圳证券交易所	中国	853	214,921.88	0.01
73	Eastroc Beverage (Group) Co., Ltd.	东鹏饮料(集团)股	605499	上海证券交易所	中国	632	158,505.60	0.01

		份有限公司		证券交易所				
74	Full Truck Alliance Co. Ltd.	满帮集团	YMM US	纽约证券交易所	美国	1,000	131,656.84	0.00
75	Kunshan Dongwei Technology Co., Ltd.	昆山东威科技股份有限公司	688700	上海证券交易所	中国	3,049	117,264.54	0.00
76	China Chippacking Technology Co., Ltd.	气派科技股份有限公司	688216	上海证券交易所	中国	2,000	95,280.00	0.00
77	QingCloud Technologies Corp.	北京青云科技股份有限公司	688316	上海证券交易所	中国	1,428	92,820.00	0.00
78	Guangdong Lyric Robot Automation Co., Ltd.	广东利元亨智能装备股份有限公司	688499	上海证券交易所	中国	2,149	83,488.65	0.00
79	Huali Industrial Group Company Limited	中山华利实业集团股份有限公司	300979	深圳证券交易所	中国	925	80,937.50	0.00

				交易所				
80	Guangdong Shenling Environmental Systems Co., Ltd.	广东申菱环境系统股份有限公司	301018	深圳证券交易所	中国	7,811	64,753.19	0.00
81	Suzhou Mingzhi Technology Co., Ltd.	苏州明志科技股份有限公司	688355	上海证券交易所	中国	2,710	64,498.00	0.00
82	Zhonghong Pulin Medical Products Co., Ltd.	中红普林医疗用品股份有限公司	300981	深圳证券交易所	中国	601	54,324.39	0.00
83	Shandong Intco Recycling Resources Co., Ltd.	山东英科环保再生资源股份有限公司	688087	上海证券交易所	中国	2,469	54,219.24	0.00
84	Shu Yu Civilian Pharmacy Corp., Ltd.	漱玉平民大药房连锁股份有限公司	301017	深圳证券交易所	中国	5,550	49,173.00	0.00
85	Ligao Foods Co., Ltd	立高食品股份有限公司	300973	深圳证券交易所	中国	360	41,655.60	0.00

				所				
86	Zhejiang Shaoxing Ruifeng Rural Commercial Bank Co., Ltd.	浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司	601528	上海证券交易所	中国	2,230	34,721.10	0.00
87	INNO LASER TECHNOLOGY CO., LTD.	英诺激光科技股份有限公司	301021	深圳证券交易所	中国	2,899	27,424.54	0.00
88	Shandong Link Science and Technology Co., Ltd.	山东联科科技股份有限公司	001207	深圳证券交易所	中国	682	22,581.02	0.00
89	Qingdao Baheal Medical INC.	青岛百洋医药股份有限公司	301015	深圳证券交易所	中国	462	17,939.46	0.00
90	Wetown Electric Group Co., Ltd.	威腾电气集团股份有限公司	688226	上海证券交易所	中国	2,693	17,289.06	0.00
91	Suwen Electric Energy Technology Co., Ltd.	苏文电能科技股份有限公司	300982	深圳证券交易所	中国	317	14,356.93	0.00
92	Guangdong Green	广东格林	30096	深	中	1,162	14,025.34	0.00

	Precision Components Co., Ltd.	精密部件股份有限公司	8	圳证 券交 易所	国			
93	Hunan Valin Wire&Cable Co., Ltd.	湖南华菱线缆股份有限公司	001208	深圳证 券交 易所	中国	1,754	13,558.42	0.00
94	Henan BCCY Environmental Energy Co., Ltd	河南百川畅银环保能源股份有限公司	300614	深圳证 券交 易所	中国	329	13,285.02	0.00
95	Shenzhen Lihexing Co., Ltd	深圳市利和兴股份有限公司	301013	深圳证 券交 易所	中国	471	12,768.81	0.00
96	Shenzhen Bioeasy Biotechnology Co., Ltd.	深圳市易瑞生物技术股份有限公司	300942	深圳证 券交 易所	中国	443	12,634.36	0.00
97	Servyou Software Group Co., Ltd.	税友软件集团股份有限公司	603171	上海证 券交 易所	中国	637	12,230.40	0.00
98	HUANLEJIA Food Group Co., Ltd.	欢乐家食品集团股份有限公	300997	深圳证	中国	928	12,110.40	0.00

		司		券交易所				
99	Sinostar Cable Co., Ltd.	中辰电缆股份有限公司	300933	深圳证券交易所	中国	1,112	11,609.28	0.00
100	Decai Decoration Co., Ltd	德才装饰股份有限公司	605287	上海证券交易所	中国	349	11,014.44	0.00
101	Jahen Household Products Co., Ltd.	嘉亨家化股份有限公司	300955	深圳证券交易所	中国	232	10,688.24	0.00
102	Pansoft Company Limited	普联软件股份有限公司	300996	深圳证券交易所	中国	241	10,177.43	0.00
103	Zhongjin Irradiation Incorporated Company	中金辐照股份有限公司	300962	深圳证券交易所	中国	576	9,429.12	0.00
104	Jiangsu Hanvo Safety Product Co., Ltd.	江苏恒辉安防股份有限公司	300952	深圳证券交易所	中国	340	9,207.20	0.00

				易所				
105	Nanjing Railway New Technology Co., Ltd.	南京雷尔伟新技术股份有限公司	301016	深圳证券交易所	中国	275	9,069.50	0.00
106	Hubei Goto Biopharm Co., Ltd.	湖北共同药业股份有限公司	300966	深圳证券交易所	中国	286	9,020.44	0.00
107	Mclon Jewellery Co., Ltd.	曼卡龙珠宝股份有限公司	300945	深圳证券交易所	中国	474	8,949.12	0.00
108	Qingdao Greensum Ecology Co., Ltd.	青岛冠中生态股份有限公司	300948	深圳证券交易所	中国	324	8,884.08	0.00
109	Doright Co., Ltd.	青岛德固特节能装备股份有限公司	300950	深圳证券交易所	中国	219	8,569.47	0.00
110	Zhejiang Xinzhonggang Thermal Power Co., LTD.	浙江新中港热电股份有限公司	605162	上海证券交易所	中国	1,377	8,358.39	0.00

11 1	BCEG Environmental Remediation Co., Ltd.	北京建工环境修复股份有限公司	300958	深圳证券交易所	中国	300	8,166.00	0.00
11 2	Jiangxi GETO New Materials Corporation Limited	江西志特新材料股份有限公司	300986	深圳证券交易所	中国	264	8,070.48	0.00
11 3	Shandong Yuma Sun-Shading Technology Corp., Ltd.	山东玉马遮阳科技股份有限公司	300993	深圳证券交易所	中国	410	7,908.90	0.00
11 4	Hang Zhou Yitong New Materials Co., Ltd.	杭州屹通新材料股份有限公司	300930	深圳证券交易所	中国	322	7,882.56	0.00
11 5	Xiangyang BOYA Precision Industrial Equipments Co., Ltd.	襄阳博亚精工装备股份有限公司	300971	深圳证券交易所	中国	245	6,931.05	0.00
11 6	Shenzhen Chuangyitong Technology Co., Ltd.	深圳市创益通技术股份有限公司	300991	深圳证券交易所	中国	254	6,733.54	0.00
11 7	Guangzhou Wahlap Technology	广州华立科技股份	301011	深圳	中国	175	5,922.00	0.00

	Corporation Limited	有限公司		证券交易所				
118	Zhejiang Chunhui Intelligent Control Co., Ltd.	浙江春晖智能控制股份有限公司	300943	深圳证券交易所	中国	255	5,867.55	0.00
119	Ningxia Xiaoming Agriculture & Animal Husbandry Co., Ltd.	宁夏晓鸣农牧股份有限公司	300967	深圳证券交易所	中国	507	5,850.78	0.00
120	Fujian Wanchen Biotechnology Co., Ltd.	福建万辰生物科技股份有限公司	300972	深圳证券交易所	中国	430	5,439.50	0.00
121	Anhui Huaqi Environmental Protection&Technology Co.,Ltd.	安徽华骐环保科技股份有限公司	300929	深圳证券交易所	中国	183	5,407.65	0.00
122	Jiangsu Yangdian Science&Technology Co. Ltd.	江苏扬电科技股份有限公司	301012	深圳证券交易所	中国	191	4,854.16	0.00
123	Hangzhou Cogeneration Group Co., Ltd.	杭州热电集团股份有限公司	605011	上海证券交易所	中国	525	4,662.00	0.00

				交易所				
12 4	Guangdong Kitech New Material Holding Co., Ltd.	广东奇德 新材料股 份有限公 司	30099 5	深圳 证券交 易所	中国	191	4,454.12	0.00
12 5	Dalian Demaishi Precision Technology Co., Ltd.	大连德迈 仕精密科 技股份有 限公司	30100 7	深圳 证券交 易所	中国	303	4,375.32	0.00
12 6	Zhejiang Taifu Pump Co., Ltd	浙江泰福 泵业股份 有限公司	30099 2	深圳 证券交 易所	中国	200	4,064.00	0.00
12 7	Jiangsu Jingxue Insulation Technology Co., Ltd.	江苏晶雪 节能科技 股份有限 公司	30101 0	深圳 证券交 易所	中国	218	3,838.98	0.00

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比 例（%）
1	Alphabet Inc.	GOOGL US	80,004,957.72	3.67
2	Baidu, Inc.	9888 HK	54,122,954.00	2.48
2	Baidu, Inc.	BIDU US	17,510,794.25	0.80
3	Nayuki Holdings	2150 HK	71,024,518.22	3.25

	Limited			
4	TAL Education Group	TAL US	55,636,319.63	2.55
5	MICROSOFT CORP	MSFT US	51,366,967.95	2.35
6	AMAZON COM INC	AMZN US	43,813,559.89	2.01
7	Adobe Inc	ADBE US	42,459,251.03	1.95
8	Focus Media Information Technology Co., Ltd.	002027	41,941,581.00	1.92
9	New Oriental Education & Technology Group Inc.	EDU US	40,692,887.73	1.86
10	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	37,360,453.23	1.71
11	DoorDash Inc	DASH US	37,199,189.53	1.70
12	Kuaishou Technology	1024 HK	36,523,187.75	1.67
13	Will Semiconductor Co., Ltd. Shanghai	603501	36,225,820.81	1.66
14	VISA INC.	V US	34,563,704.39	1.58
15	Facebook Inc	FB US	31,407,771.64	1.44
16	JD.com, Inc.	JD US	31,088,388.40	1.42
17	Maxscend Microelectronics Company Limited	300782	30,626,268.40	1.40
18	SALESFORCE.COM, INC.	CRM US	30,585,448.91	1.40
19	Pinterest, Inc.	PINS US	29,456,082.41	1.35
20	Tencent Holdings Ltd	700 HK	27,358,435.24	1.25

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Baidu, Inc.	9888 HK	54,864,343.80	2.51
1	Baidu, Inc.	BIDU US	15,873,707.89	0.73
2	New Oriental Education & Technology Group Inc.	EDU US	70,557,124.72	3.23
3	TAL Education Group	TAL US	54,144,058.53	2.48
4	APPLE INC	AAPL US	35,513,186.39	1.63
5	SYNOPSYS INC	SNPS US	31,439,292.37	1.44

6	Xiaomi Corporation	1810 HK	29,594,431.87	1.36
7	QUALCOMM INC/DE	QCOM US	25,922,012.31	1.19
8	Changchun High-tech Industry (Group) Co., Ltd.	000661	24,152,120.01	1.11
9	Alibaba Group Holding Limited	BABA US	24,082,287.70	1.10
10	East Money Information Co., Ltd.	300059	22,163,089.65	1.02
11	Zhejiang Cfmoto Power Co., Ltd	603129	21,467,033.00	0.98
12	Hundsun Technologies Inc.	600570	20,483,651.57	0.94
13	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	20,477,710.72	0.94
14	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co., Ltd.	002568	20,111,732.00	0.92
15	Smooore International Holdings Limited	6969 HK	19,122,472.22	0.88
16	Tencent Holdings Ltd	700 HK	19,099,340.30	0.88
17	Pinduoduo Inc.	PDD US	17,794,234.53	0.82
18	Bilibili Inc.	BILI US	15,551,653.96	0.71
19	Kuaishou Technology	1024 HK	15,269,980.41	0.70
20	STMICROELECTRONICS N. V.	STM US	14,509,253.74	0.66

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,487,667,551.73
卖出收入（成交）总额	902,045,538.72

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	PROSHARES ULTRAPRO SHORT QQQ	ETF 型	开放式	ProShares Trust	212,563.13	0.01

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股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。

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	697,819.62
2	应收证券清算款	48,972,591.66
3	应收股利	403,345.88
4	应收利息	18,832.72
5	应收申购款	11,451,888.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,544,478.11

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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（%）
332,517	2,980.16	256,781,726.53	25.91	734,171,240.58	74.09

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	6,530,642.74	0.66

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年01月25日）基金份额总额	268,156,205.81
本报告期期初基金份额总额	755,580,083.20
本报告期基金总申购份额	696,603,534.12
减：本报告期基金总赎回份额	461,230,650.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	990,952,967.11

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额	佣金	占当期佣金总量的比	

			的比例 (%)		例 (%)	
东方证券	2	586,053,904.84	24.60	518,931.98	21.77	
JPMorgan Securities	-	353,063,621.69	14.82	105,919.05	4.44	
Goldman Sachs	-	273,031,004.37	11.46	88,269.93	3.70	
Jefferies International	-	261,760,203.16	10.99	104,913.31	4.40	
Wolfe Research	-	170,713,452.94	7.17	20,986.05	0.88	
Macquarie	-	168,870,280.04	7.09	50,660.96	2.13	
CGS-CIMB Securities (Singapore)	-	109,996,293.51	4.62	27,804.16	1.17	
Huatai Securities (HK)	-	91,608,855.53	3.84	726,712.64	30.49	
Credit Suisse	-	89,794,880.18	3.77	46,095.76	1.93	
Oppenhemier	-	65,178,311.86	2.74	12,693.82	0.53	
CLSA Asia-Pacific Markets	-	64,312,230.44	2.70	592,175.92	24.85	
Sanford C. Bernstein	-	56,698,763.42	2.38	17,009.64	0.71	
Haitong International Securities	-	53,592,054.04	2.25	8,476.74	0.36	
China Merchant Security (HK)	-	23,125,174.67	0.97	18,500.13	0.78	
Morgan Stanley	-	10,695,669.64	0.45	4,622.35	0.19	
CICC Hong Kong Securities	-	4,002,088.77	0.17	38,793.24	1.63	
CCB International Securities	-	64,431.89	0.00	644.32	0.03	
北京高华	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
海通证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
招商证券	1	-	-	-	-	
中金公司	1	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	

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

合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies International	-	-	-	-	-	-	-	-
Wolfe Research	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-	-	-
CGS-CIMB Securities (Singapore)	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Securities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
Oppenhemier	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Asia-Pacific Markets	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchant Security (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC Hong Kong Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 01 月 09 日
2	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 01 月 22 日

3	汇添富基金管理股份有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	公司网站	2021 年 02 月 08 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 03 月 30 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 20 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 21 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 22 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富全球移动互联灵活配置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