

汇添富价值成长均衡投资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：招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。

基金托管人招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 02 月 05 日（基金合同生效日）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 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 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	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§ 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 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59
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	59

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金	
基金简称	汇添富价值成长均衡投资混合	
基金主代码	011271	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 02 月 05 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	4,196,844,629.22	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富价值成长均衡投资混合 A	汇添富价值成长均衡投资混合 C
下属分级基金的交易代码	011271	011272
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	4,141,145,161.89	55,699,467.33

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金遵循“价值与成长并重”的理念，采用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资方法，通过行业的相对均衡配置和精选具备持续性竞争优势、具有良好成长性兼具较高内在价值的股票，在科学严格管理风险的前提下，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票精选策略、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、融资投资策略、国债期货投资策略。
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）*15%+中债综合指数收益率*25%
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。 本基金还可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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
		张燕
		0755-83199084
		yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	400-888-9918	95555
传真	021-28932998	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	李文	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 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02月05日(基金合同生效日) - 2021年06月30日)	
	汇添富价值成长均衡投资混合 A	汇添富价值成长均衡投资混合 C
本期已实现收益	-58,716,381.40	-822,271.71
本期利润	93,940,834.77	1,232,882.01
加权平均基金份额本期利润	0.0217	0.0220
本期加权平均净值利润率	2.28%	2.31%
本期基金份额净值增长率	2.30%	2.05%
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	-53,119,629.22	-842,539.19
期末可供分配基金份额利润	-0.0128	-0.0151
期末基金资产净值	4,236,338,936.67	56,843,979.70

期末基金份额净值	1.0230	1.0205
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	2.30%	2.05%

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。

4、本基金的《基金合同》生效日为 2021 年 02 月 05 日，至本报告期末未满半年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2021 年 06 月 30 日数据，特此说明。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富价值成长均衡投资混合 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.04%	1.08%	-1.17%	0.56%	3.21%	0.52%
过去三个月	12.39%	1.15%	2.26%	0.67%	10.13%	0.48%
自基金合同生效日起至今	2.30%	1.17%	-2.58%	0.89%	4.88%	0.28%
汇添富价值成长均衡投资混合 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.99%	1.08%	-1.17%	0.56%	3.16%	0.52%
过去三个月	12.22%	1.15%	2.26%	0.67%	9.96%	0.48%
自基金	2.05%	1.17%	-2.58%	0.89%	4.63%	0.28%

合同生效 日起 至今						
------------------	--	--	--	--	--	--

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

汇添富价值成长均衡投资混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富价值成长均衡投资混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本《基金合同》生效之日为 2021 年 02 月 05 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

§ 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		
顾耀强	本基金的基金经理，增强收益部总监	2021 年 02 月 05 日		17	国籍:中国。 学历:清华大学管理学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，现任增强收益部总监。2009 年 12 月 22 日至今任汇添富策略回报混合型证券投资基金的

				<p>基金经理。</p> <p>2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 8 月 24 日至今任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月 20 日至今任汇添富沪深 300 基本面增强指数型证券投资基金的基金经</p>
--	--	--	--	---

					理。2021 年 2 月 5 日至今任汇添富价值成长均衡投资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 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。

4.3 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中的公平交易模块进行操作,实现事前和事中公平交易的管控。

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

步判断是否存在重大利益输送的可能性。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场大幅震荡。春节前后受流动性转向预期影响，核心资产先是系统性上涨又随后暴跌。二季度市场逐步稳定，但出现显著分化。一些相对稀缺、空间大、增速快的细分行业如新能源、半导体、CXO、次高端白酒等受到投资者的追捧表现强劲。此外，经济复苏预期及疫情反复导致的供求错配等推动部分上游资源价格上行，相关行业亦有较好表现。

本基金在建仓初期误判市场节奏偏快，在春节后优质公司的系统性下跌中阶段性回撤较大。二季度我们立足基本面研究，积极在消费、医药、科技、制造周期等领域中挖掘优质公司调整投资组合，净值有所恢复。我们会继续坚持自下而上优选个股，风格资产相对均衡的投资组合管理策略，力争为投资者获取相对稳健的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 2.30%;C 类基金份额净值增长率为 2.05%。同期业绩比较基准收益率为-2.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，本基金管理人维持对市场谨慎乐观的观点。影响市场的关键因素仍然是疫情进展及地缘博弈：全球疫情的控制节奏会影响经济复苏进程和流动性预期，而大国关系则影响市场风险溢价。但自下而上来看，越来越多由优秀企业家领导的、竞争力日益增强，且持续增长前景确定的上市公司是我们对市场乐观的基础。考虑到市场风格分化愈加极致，下

半年的波动率有可能仍然较大。

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对应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;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各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;A类基金份额和C类基金份额之间由于收取费用的不同,将导致在可供分配利润上有所不同;本基金同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：汇添富价值成长均衡投资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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	427,268,320.56
结算备付金		4,838,408.49
存出保证金		4,497,179.10
交易性金融资产	6.4.7.2	3,836,595,189.16
其中：股票投资		3,836,595,189.16
基金投资		-
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		89,292,744.73
应收利息	6.4.7.5	52,307.44
应收股利		2,469,748.29
应收申购款		385,156.38
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		4,365,399,054.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30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		36,596,461.27
应付赎回款		24,578,658.89
应付管理人报酬		5,281,876.42
应付托管费		880,312.73
应付销售服务费		27,865.08
应付交易费用	6.4.7.7	4,719,599.54
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	131,363.85
负债合计		72,216,137.78
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	4,196,844,629.22
未分配利润	6.4.7.10	96,338,287.15
所有者权益合计		4,293,182,916.37
负债和所有者权益总计		4,365,399,054.15

注：1、报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,196,844,629.22 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.0230 元，基金份额总额 4,141,145,161.89 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.0205 元，基金份额总额 55,699,467.33 份。

2、本基金合同于 2021 年 02 月 05 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2021 年 06 月 30 日数据，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 02 月 05 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 02 月 05 日（基金合 同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
一、收入		140,239,641.09
1. 利息收入		3,459,404.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,435,923.78
债券利息收入		686.93
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,022,794.01
证券出借收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,569,437.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-38,662,733.07
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	1,430,278.72
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	18,663,016.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	154,712,369.89
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	637,303.96
减：二、费用		45,065,924.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,910,784.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,151,797.50
3. 销售服务费		127,404.46
4. 交易费用	6.4.7.20	15,783,651.58
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		2.49
7. 其他费用	6.4.7.21	92,283.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		95,173,716.78
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		95,173,716.78

注：本基金合同于 2021 年 02 月 05 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 05 日（基金合同生效日）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）	4,412,390,980.93	-	4,412,390,980.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	95,173,716.78	95,173,716.78
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）	-215,546,351.71	1,164,570.37	-214,381,781.34
其中：1. 基金申购款	32,011,453.17	-1,071,039.46	30,940,413.71
2. 基金赎回款	-247,557,804.88	2,235,609.83	-245,322,195.05
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）	4,196,844,629.22	96,338,287.15	4,293,182,916.37

注：本基金合同于 2021 年 02 月 05 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

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：

财务报表由下列负责人签署：

张暉

李骁

雷青松

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

汇添富价值成长均衡投资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[2020]3674 号文《关于准予汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司于 2021 年 2 月 1 日至 2021 年 2 月 3 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2021）验字第 60466941_B33 号验资报告

后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 2 月 5 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 4,412,136,659.50 元，在募集期内产生的利息为人民币 254,321.43 元，以上实收基金（本息）共计人民币 4,412,390,980.93 元，折合 4,412,390,980.93 份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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、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）。本基金还可根据法律法规参与融资。本基金遵循“价值与成长并重”的理念，采用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资方法，通过行业的相对均衡配置和精选具备持续性竞争优势、具有良好成长性兼具较高内在价值的股票，在科学严格管理风险的前提下，力争实现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）×15%+中债综合指数收益率×25%。

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 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2021 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止, 或该收取金融资产现金流量的权利已转移, 且符合金融资产转移的终止确认条件的, 金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的, 该金融负债或其一部分将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的, 终止确认该金融资产; 保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的, 不终止确认该金融资产; 本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的, 分别下列情况处理: 放弃了对该金融资产控制的, 终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债; 未放弃对该金融资产控制的, 按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产, 并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资, 股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益, 卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账, 其中所包含的债券应收利息单独核算, 不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券, 根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后, 按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益, 卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益, 卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认;

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益, 股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转;

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不

应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(9) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(13) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 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各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于收取费用的不同，将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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	427,268,320.56
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	427,268,320.56

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	3,681,882,819.27	3,836,595,189.16	154,712,369.89
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	3,681,882,819.27	3,836,595,189.16	154,712,369.89

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	38,585.11
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	12,747.50
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	974.83
合计	52,307.44

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	4,719,599.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,719,599.54

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	60,575.75
应付证券出借违约金	-
应付审计费	39,818.58
应付信息披露费	30,969.52
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	131,363.85

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富价值成长均衡投资混合 A		
项目	本期 2021 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	4,356,652,046.04	4,356,652,046.04
本期申购	28,116,314.80	28,116,314.80
本期赎回（以“-”号填列）	-243,623,198.95	-243,623,198.95
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	4,141,145,161.89	4,141,145,161.89
汇添富价值成长均衡投资混合 C		
项目	本期 2021 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	55,738,934.89	55,738,934.89
本期申购	3,895,138.37	3,895,138.37
本期赎回（以“-”号填列）	-3,934,605.93	-3,934,605.93
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	55,699,467.33	55,699,467.33

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

2、本基金合同于 2021 年 02 月 05 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 4,412,136,659.50 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 254,321.43 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 4,412,390,980.93 元，折合 4,412,390,980.93 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富价值成长均衡投资混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-58,716,381.40	152,657,216.17	93,940,834.77
本期基金份额交易产生的变动数	5,596,752.18	-4,343,812.17	1,252,940.01
其中：基金申购款	-939,673.08	6,091.13	-933,581.95
基金赎回款	6,536,425.26	-4,349,903.30	2,186,521.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-53,119,629.22	148,313,404.00	95,193,774.78
汇添富价值成长均衡投资混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-822,271.71	2,055,153.72	1,232,882.01
本期基金份额交易产生的变动数	-20,267.48	-68,102.16	-88,369.64
其中：基金申购款	-134,114.98	-3,342.53	-137,457.51
基金赎回款	113,847.50	-64,759.63	49,087.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-842,539.19	1,987,051.56	1,144,512.37

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年02月05日（基金合同生效日）至2021年06月30日
活期存款利息收入	2,032,156.75
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	372,876.07
其他	30,890.96

合计	2,435,923.78
----	--------------

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02月05日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出股票成交总额	3,264,897,440.87
减：卖出股票成本总额	3,303,560,173.94
买卖股票差价收入	-38,662,733.07

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02月05日（基金合同生效日）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	5,099,686.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,668,700.00
减：应收利息总额	707.61
买卖债券差价收入	1,430,278.72

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02月05日（基金合同生效日）至2021年06月30日

股票投资产生的股利收益	18,663,016.87
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	18,663,016.87

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02月05日（基金合同生效日）至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	154,712,369.89
——股票投资	154,712,369.89
——债券投资	-
——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	154,712,369.89

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年02月05日（基金合同生效日）至2021年06月30日
基金赎回费收入	637,303.96
替代损益	-
其他	-
合计	637,303.96

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年02月05日（基金合同生效日）至2021年06月30日
交易所市场交易费用	15,783,651.58
银行间市场交易费用	-
合计	15,783,651.58

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
审计费用	39,818.58
信息披露费	30,969.52
证券出借违约金	-
账户维护费	1,500.00
银行费用	19,995.26
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	92,283.36

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

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 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	2,960,397,670.62	28.90

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 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
东方证券	5,099,686.33	100.00

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 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
东方证券	8,000,000,000.00	69.57

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期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 02 月 05 日（基金合同生效日）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	2,598,710.75	29.57	783,074.30	16.59

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 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	24,910,784.92
其中：支付销售机构的客户维护费	12,408,197.20

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，逐日累计至每月月末，按月支付经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,151,797.50

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，逐日累计至每月月末，按月支付经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富价值成长均衡投资混合 A	汇添富价值成长均衡投资混合 C	合计

汇添富基金管理股份有限公司	-	10,910.05	10,910.05
招商银行股份有限公司	-	116,219.16	116,219.16
合计	-	127,129.21	127,129.21

本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费, C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.6%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.6% 年费率计提。

计算方法如下:

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 经基金管理人与基金托管人双方核对无误后, 基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构, 再由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注: 本基金本报告期末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: 本基金本报告期末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: 本基金本报告期末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末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

注: 本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

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 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	427,268,320.56	2,032,156.75

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
688601	力芯微	2021年06月18日	2021年12月28日	新股流通受限	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	
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	360	10,180.80	41,655.60	
300982	苏文电	2021年04月19日	2021年10月27日	新股流	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	

	能	日	日	通						
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	
301015	百洋医药	2021年06月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	
300968	格林精密	2021年04月06日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2021年07月05日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	
688499	利元亨	2021年06月23日	2021年07月01日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	
301016	雷尔伟	2021年06月23日	2021年12月30日	新股流通受	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	

				限						
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	
301018	申菱环境	2021年06月28日	2022年01月07日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	
688685	迈信林	2021年04月30日	2021年11月15日	新股流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	
300614	百川畅银	2021年05月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	
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	
301018	申菱环境	2021年06月28日	2021年07月07日	新股流通受限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	
688690	纳微科技	2021年06月16日	2021年12月23日	新股流通受限	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	
301010	晶	2021	2021	新	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	

	雪 节 能	年 06 月 09 日	年 12 月 20 日	股 流 通 受 限						
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	
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	
300957	贝 泰 妮	2021 年 03 月 18 日	2021 年 09 月 27 日	新 股 流 通 受 限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	
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	
301007	德 迈 仕	2021 年 06 月 04 日	2021 年 12 月 16 日	新 股 流 通 受 限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	
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	
300971	博 亚 精	2021 年 04 月 07	2021 年 10 月 15	新 股 流	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	

	工	日	日	通						
301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	
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	
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	
300979	华利集团	2021年04月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	
300981	中红医疗	2021年04月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	
300997	欢乐家	2021年05月26日	2021年12月02日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	
688345	博力威	2021年06月03日	2021年12月13日	新股流通受	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96	

				限						
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	
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	
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	
688087	英科再生	2021年06月30日	2022年01月10日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	
301012	扬电科技	2021年06月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	
688575	亚辉龙	2021年05月10日	2021年11月17日	新股流通受限	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15	
688226	威腾电气	2021年06月28日	2022年01月07日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	
300993	玉	2021	2021	新	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	

	马遮阳	年05月17日	年11月24日	股 流 通 受 限						
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	
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	
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	
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
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

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	427,268,320.56	-	-	-	-	-	427,268,320.56

存款							
结算 备付 金	4,838,408.49	-	-	-	-	-	4,838,408.49
存出 保证 金	4,497,179.10	-	-	-	-	-	4,497,179.10
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	3,836,595,189.16	3,836,595,189.16
应收 股利	-	-	-	-	-	2,469,748.29	2,469,748.29
应收 利息	-	-	-	-	-	52,307.44	52,307.44
应收 申购 款	-	-	-	-	-	385,156.38	385,156.38
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	89,292,744.73	89,292,744.73
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	436,603,908.15	-	-	-	-	3,928,795,146.00	4,365,399,054.15
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	24,578,658.89	24,578,658.89
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	5,281,876.42	5,281,876.42
应付 托管 费	-	-	-	-	-	880,312.73	880,312.73

应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	36,596,461.27	36,596,461.27
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	27,865.08	27,865.08
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	4,719,599.54	4,719,599.54
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	131,363.85	131,363.85
负债 总计	-	-	-	-	-	72,216,137.78	72,216,137.78
利率 敏感 度缺 口	436,603,908.15	-	-	-	-	3,856,579,008.22	4,293,182,916.37

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	-	1,657,609,000.87	-	1,657,609,000.87
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	-	2,469,748.29	-	2,469,748.29
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	-	1,660,078,749.16	-	1,660,078,749.16
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	-	-	-	-
资产负债表外汇率风险敞口净额	-	1,660,078,749.16	-	1,660,078,749.16

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
	港币相对人民币升值 5%	83,003,937.46
	港币相对人民币贬值 5%	-83,003,937.46

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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	3,836,595,189.16	89.36
交易性金融资产—基金投资	—	—
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	3,836,595,189.16	89.36

注：股票资产占基金资产的比例不低于 60%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；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，本基金保留的现金或投资于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%，其中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
	沪深 300 指数上涨 5%	156,238,086.46
	沪深 300 指数下跌 5%	-156,238,086.46

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	3,836,595,189.16	87.89

	其中：股票	3,836,595,189.16	87.89
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	432,106,729.05	9.90
8	其他资产	96,697,135.94	2.22
9	合计	4,365,399,054.15	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 1,657,609,000.87 元，占期末净值比例为 38.61%。

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	1,766,265,970.77	41.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	67,112.46	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,407.83	0.00
J	金融业	154,734,146.00	3.60
K	房地产业	17,180,000.00	0.40
L	租赁和商务服务业	153,051,000.00	3.56
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,001,971.59	0.37
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	71,613,897.60	1.67
S	综合	-	-
	合计	2,178,986,188.29	50.75

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	141,067,514.88	3.29
20 工业	28,723,401.60	0.67
25 可选消费	544,029,380.68	12.67
30 日常消费	39,066,156.00	0.91
35 医疗保健	395,747,232.96	9.22
40 金融	138,631,184.64	3.23
45 信息技术	100,827,294.00	2.35
50 电信服务	246,854,837.76	5.75
55 公用事业	-	-
60 房地产	22,661,998.35	0.53
合计	1,657,609,000.87	38.61

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	00700	腾讯控股	508,000	246,854,837.76	5.75
2	02269	药明生物	1,880,000	222,601,369.92	5.18
3	600426	华鲁恒升	6,806,654	210,665,941.30	4.91
4	03690	美团-W	700,000	186,618,902.40	4.35
5	000858	五粮液	589,990	175,752,121.10	4.09
6	603501	韦尔股份	518,420	166,931,240.00	3.89
7	601888	中国中免	510,000	153,051,000.00	3.56
8	603799	华友钴业	1,299,996	148,459,543.20	3.46
9	02331	李宁	1,808,500	142,656,621.26	3.32
10	00388	香港交易所	360,000	138,631,184.64	3.23
11	06865	福莱特玻璃	5,013,000	133,478,945.28	3.11

12	300142	沃森生物	2,000,000	123,400,000.00	2.87
13	603369	今世缘	2,189,939	118,607,096.24	2.76
14	600919	江苏银行	15,999,919	113,599,424.90	2.65
15	300124	汇川技术	1,503,751	111,668,549.26	2.60
16	02333	长城汽车	5,000,000	104,426,040.00	2.43
17	300014	亿纬锂能	1,000,000	103,930,000.00	2.42
18	000786	北新建材	2,500,000	98,125,000.00	2.29
19	00968	信义光能	7,000,000	97,619,625.60	2.27
20	300390	天华超净	1,989,960	95,577,778.80	2.23
21	300715	凯伦股份	3,999,991	94,279,787.87	2.20
22	300122	智飞生物	500,000	93,365,000.00	2.17
23	01801	信达生物	1,000,000	75,344,844.00	1.75
24	002918	蒙娜丽莎	2,299,836	72,191,852.04	1.68
25	300144	宋城演艺	4,262,732	71,613,897.60	1.67
26	01691	J S 环球生活	3,588,000	65,233,241.42	1.52
27	002847	盐津铺子	599,865	59,818,537.80	1.39
28	02196	复星医药	1,000,000	52,171,416.00	1.22
29	601166	兴业银行	2,000,000	41,100,000.00	0.96
30	02319	蒙牛乳业	1,000,000	39,066,156.00	0.91
31	002601	龙鳞佰利	999,973	34,579,066.34	0.81
32	09926	康方生物-B	600,000	31,277,887.20	0.73
33	01999	敏华控股	2,000,000	31,053,225.60	0.72

34	002984	森麒麟	846,686	30,861,704.70	0.72
35	02338	潍柴动力	2,000,000	28,723,401.60	0.67
36	06049	保利物业	516,800	22,661,998.35	0.53
37	001914	招商积余	1,000,000	17,180,000.00	0.40
38	603568	伟明环保	699,979	15,980,520.57	0.37
39	002568	百润股份	161,020	15,263,085.80	0.36
40	01951	锦欣生殖	880,000	14,351,715.84	0.33
41	09992	泡泡玛特	200,000	12,814,032.00	0.30
42	600298	安琪酵母	199,919	10,871,595.22	0.25
43	03323	中国建材	1,000,000	7,588,569.60	0.18
44	00909	明源云	100,000	3,207,668.40	0.07
45	01773	天立教育	500,000	1,227,318.00	0.03
46	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.01
47	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.01
48	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
49	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.00
50	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.00
51	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.00
52	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
53	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
54	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
55	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
56	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
57	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.00
58	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
59	300973	立高食	360	41,655.60	0.00

		品			
60	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
61	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
62	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
63	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
64	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
65	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
66	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
67	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
68	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
69	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
70	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
71	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
72	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
73	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
74	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
75	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
76	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
77	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
78	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
79	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
80	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
81	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
82	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00

83	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
84	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
85	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
86	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
87	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
88	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
89	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
90	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
91	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
92	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	288,157,087.53	6.71
2	03690	美团-W	281,268,111.09	6.55
3	00388	香港交易所	212,557,437.28	4.95
4	600426	华鲁恒升	207,920,550.55	4.84
5	000858	五粮液	206,335,250.46	4.81
6	601888	中国中免	201,350,307.15	4.69
7	02269	药明生物	198,401,154.06	4.62
8	300142	沃森生物	178,656,490.62	4.16
9	603501	韦尔股份	151,352,711.56	3.53
10	601166	兴业银行	150,745,771.14	3.51
11	600690	海尔智家	150,664,620.70	3.51
12	02333	长城汽车	130,179,982.07	3.03
13	00968	信义光能	128,210,906.16	2.99
14	603799	华友钴业	127,506,845.72	2.97
15	600519	贵州茅台	127,102,545.78	2.96
16	300274	阳光电源	126,872,617.56	2.96
17	300059	东方财富	125,257,873.48	2.92

18	300144	宋城演艺	121,078,397.74	2.82
19	000786	北新建材	119,829,945.00	2.79
20	06969	思摩尔国际	117,525,557.58	2.74
21	603369	今世缘	116,321,559.50	2.71
22	600919	江苏银行	115,922,352.60	2.70
23	02382	舜宇光学科技	114,171,244.64	2.66
24	02331	李宁	108,135,009.68	2.52
25	300014	亿纬锂能	101,646,809.80	2.37
26	06865	福莱特玻璃	99,790,733.79	2.32
27	300715	凯伦股份	99,244,486.60	2.31
28	01772	赣锋锂业	83,658,168.85	1.95
28	002460	赣锋锂业	12,732,043.00	0.30
29	02318	中国平安	96,070,109.26	2.24
30	300124	汇川技术	93,590,418.33	2.18
31	000333	美的集团	91,755,711.44	2.14
32	300122	智飞生物	89,976,926.00	2.10
33	300390	天华超净	89,725,447.80	2.09
34	002847	盐津铺子	86,026,415.87	2.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	144,736,101.40	3.37
2	600690	海尔智家	130,887,369.64	3.05
3	300274	阳光电源	130,336,762.67	3.04
4	02382	舜宇光学科技	112,476,896.54	2.62
5	01772	赣锋锂业	94,775,605.59	2.21
5	002460	赣锋锂业	13,056,117.00	0.30
6	600519	贵州茅台	105,074,768.45	2.45
7	02020	安踏体育	104,754,411.06	2.44
8	02318	中国平安	98,414,501.79	2.29
9	03690	美团-W	95,274,784.15	2.22
10	300760	迈瑞医疗	93,751,670.02	2.18
11	601166	兴业银行	86,836,664.45	2.02
12	06969	思摩尔国际	86,478,120.64	2.01
13	600809	山西汾酒	86,165,851.72	2.01
14	002241	歌尔股份	82,850,285.49	1.93

15	000333	美的集团	82,293,996.16	1.92
16	00939	建设银行	81,881,395.80	1.91
17	06185	康希诺生物 - B	80,628,617.02	1.88
18	002027	分众传媒	76,022,749.89	1.77
19	002821	凯莱英	72,859,134.36	1.70
20	00968	信义光能	70,125,329.27	1.63

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	6,985,442,993.21
卖出股票收入（成交）总额	3,264,897,440.87

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、山东华鲁恒升化工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	4,497,179.10
2	应收证券清算款	89,292,744.73
3	应收股利	2,469,748.29
4	应收利息	52,307.44
5	应收申购款	385,156.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,697,135.94

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
汇添富价值成	34,712	119,300.10	2,988,110.36	0.07	4,138,157,051.53	99.93

长 均 衡 投 资 混 合 A						
汇 添 富 价 值 成 长 均 衡 投 资 混 合 C	1,306	42,648.90	0.00	0.00	55,699,467.33	100.00
合 计	36,018	116,520.76	2,988,110.36	0.07	4,193,856,518.86	99.93

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	汇添富价值成长 均衡投资混合 A	497,173.31	0.01
	汇添富价值成长 均衡投资混合 C	10,557.43	0.02
	合计	507,730.74	0.01

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投 资和研究部门负责人持有本 开放式基金	汇添富价值成长均衡投资 混合 A	0
	汇添富价值成长均衡投资 混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放	汇添富价值成长均衡投资	10~50

式基金	混合 A	
	汇添富价值成长均衡投资混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富价值成长均衡投资混合 A	汇添富价值成长均衡投资混合 C
基金合同生效日（2021 年 02 月 05 日）基金份额总额	4,356,652,046.04	55,738,934.89
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	28,116,314.80	3,895,138.37
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	243,623,198.95	3,934,605.93
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,141,145,161.89	55,699,467.33

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2021 年 02 月 05 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。

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	2,960,397,670.62	28.90	2,598,710.75	29.57	
国泰君安	2	1,256,539,550.89	12.26	1,084,887.45	12.34	
天风证券	2	1,107,536,587.95	10.81	960,274.84	10.93	
东方财富	2	1,039,098,723.48	10.14	668,575.05	7.61	
开源证券	2	906,282,240.81	8.85	791,860.37	9.01	
中信建投证券	2	679,765,203.75	6.64	650,758.19	7.40	
东北证券	2	558,936,618.46	5.46	507,749.01	5.78	
国信证券	2	510,618,528.93	4.98	441,948.46	5.03	
安信证券	2	306,550,150.04	2.99	265,699.39	3.02	
广发证券	3	305,035,335.41	2.98	270,653.17	3.08	

国金证券	2	219,219,413.73	2.14	204,156.89	2.32	
中信证券	2	212,170,443.07	2.07	184,083.49	2.09	
申万宏源证券	2	182,873,918.92	1.79	159,841.69	1.82	
北京高华	2	-	-	-	-	
财达证券	2	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
中原证券	2	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	5,099,686.33	100.00	8,000,000,000.00	69.57	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
天风	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	3,500,000,000.00	30.43	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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，同一基金管理人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	汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金发行文件	公司网站, 证券日报	2021 年 01 月 18 日
2	关于汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金线上直销系统认购费率执行标准的公告	公司网站, 证券日报	2021 年 02 月 01 日
3	关于汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金提前结束募集的公告	公司网站, 证券日报	2021 年 02 月 03 日
4	关于汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金募集期认购申请确认比例的公告	公司网站, 证券日报	2021 年 02 月 05 日
5	汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金基金合同生效公告	公司网站, 证券日报	2021 年 02 月 06 日
6	汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	公司网站, 证券日报	2021 年 04 月 23 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富价值成长均衡投资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、报告期内汇添富价值成长均衡投资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