

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2022 年 03 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。本年度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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 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。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	19
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	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	23
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	23
§ 5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	24
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	24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	24
§ 6 审计报告	24
6.1 审计报告的基本信息	24
6.2 审计报告的基本内容	24
§ 7 年度财务报表	26
7.1 资产负债表	26
7.2 利润表	27
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	28
7.4 报表附注	30
§ 8 投资组合报告	77
8.1 期末基金资产组合情况	77
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	78
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	79

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	102
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	104
8.6 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.....	104
8.7 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....	104
8.8 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....	105
8.9 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.....	105
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	105
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	105
8.12 投资组合报告附注.....	105
§ 9 基金份额持有人信息	107
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	107
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	107
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	108
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	108
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	108
§ 10 开放式基金份额变动	108
§ 11 重大事件揭示	109
11.1 基金份额持有人大会决议.....	109
11.2 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.....	109
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	109
11.4 基金投资策略的改变.....	109
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	109
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	110
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	110
11.8 其他重大事件.....	111
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	112
12.1 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.....	112
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	112
§ 13 备查文件目录	112
13.1 备查文件目录.....	113
13.2 存放地点	113
13.3 查阅方式	113

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)	
基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF)	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 08 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	307,839,443.93	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额 (份)	202,719,670.47	105,119,773.46

注：A 类份额扩位证券简称：中证 500LOF；C 类份额扩位证券简称：中证 500LOFC。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%

风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95565
传真	021-28932998	0755-82960794
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	深圳市福田区福华一路111号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	深圳市福田区福华一路111号
邮政编码	200010	518000
法定代表人	李文	霍达

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2021年	2020年	2019年
---------------	-------	-------	-------

和 指 标						
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	41,518,266 .69	23,283,677 .95	55,004,243 .66	27,092,274 .50	2,238,237. 86	1,170,338. 70
本期利润	38,618,346 .03	22,231,046 .42	71,868,477 .53	34,957,796 .62	36,945,973 .08	23,140,286 .36
加权平均基金份额本期利润	0.2147	0.2205	0.2544	0.2252	0.1322	0.1376
本期加权平均净值利润率	17.87%	18.53%	26.19%	23.38%	16.47%	17.22%
本期基金	20.61%	20.31%	27.99%	27.66%	27.87%	27.59%

份 额 净 值 增 长 率						
3.1 .2 期 末 数 据 和 指 标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期 末 可 供 分 配 利 润	64,296,842 .87	31,972,194 .71	16,057,309 .50	9,711,147. 01	-47,334,94 8.24	-28,165,36 2.22
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润	0.3172	0.3042	0.0851	0.0776	-0.1467	-0.1509
期 末 基 金 资 产 净 值	267,016,51 3.34	137,091,96 8.17	206,033,07 9.78	135,720,59 0.01	275,222,35 5.14	158,428,37 0.55

期末基金份额净值	1.3172	1.3042	1.0921	1.0840	0.8533	0.8491
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	31.72%	30.42%	9.21%	8.40%	-14.67%	-15.09%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 500 指数 (LOF) A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益	①-③	②-④

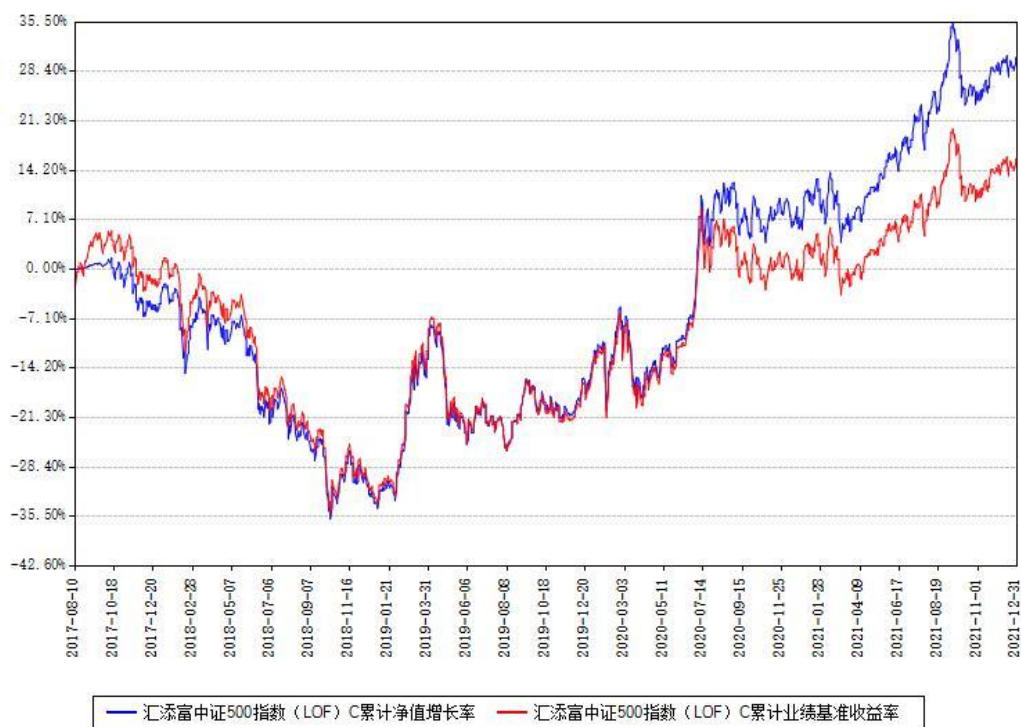
		准差②		率标准差 ④		
过去三 个月	3.40%	0.71%	3.43%	0.72%	-0.03%	-0.01%
过去六 个月	9.78%	0.90%	7.72%	0.91%	2.06%	-0.01%
过去一 年	20.61%	0.92%	14.83%	0.92%	5.78%	0.00%
过去三 年	97.39%	1.29%	72.29%	1.31%	25.10%	-0.02%
自基金 合同生 效日起 至今	31.72%	1.28%	15.88%	1.31%	15.84%	-0.03%
汇添富中证 500 指数 (LOF) C						
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三 个月	3.34%	0.71%	3.43%	0.72%	-0.09%	-0.01%
过去六 个月	9.64%	0.90%	7.72%	0.91%	1.92%	-0.01%
过去一 年	20.31%	0.92%	14.83%	0.92%	5.48%	0.00%
过去三 年	95.97%	1.29%	72.29%	1.31%	23.68%	-0.02%
自基金 合同生 效日起 至今	30.42%	1.28%	15.88%	1.31%	14.54%	-0.03%

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

汇添富中证500指数 (LOF) A 累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数 (LOF) C 累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

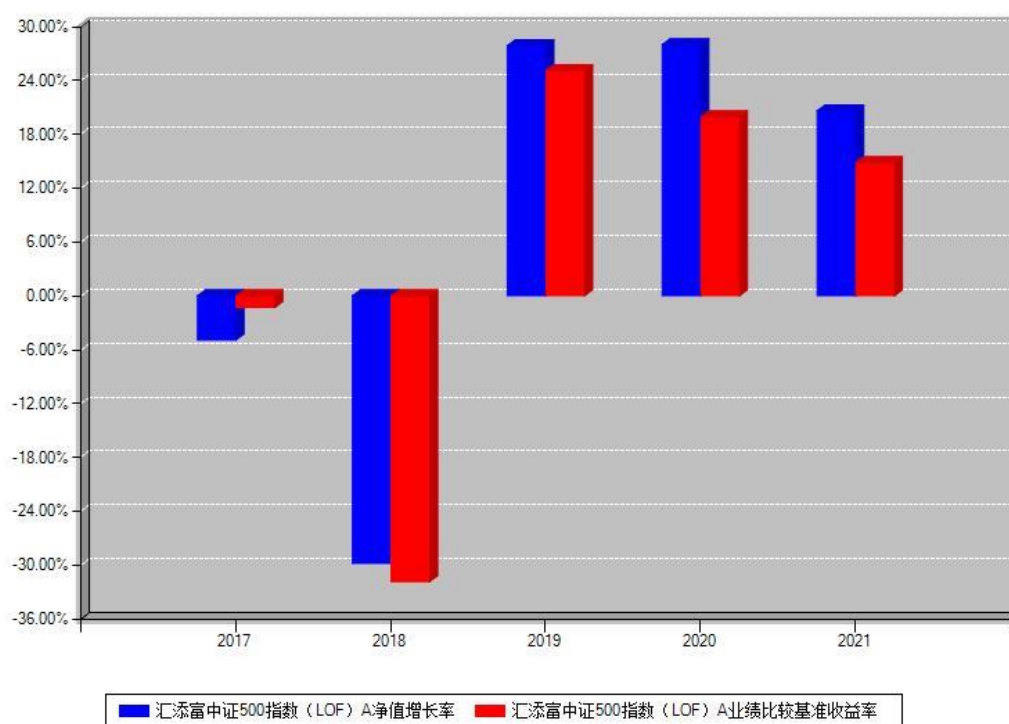


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年08月10日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

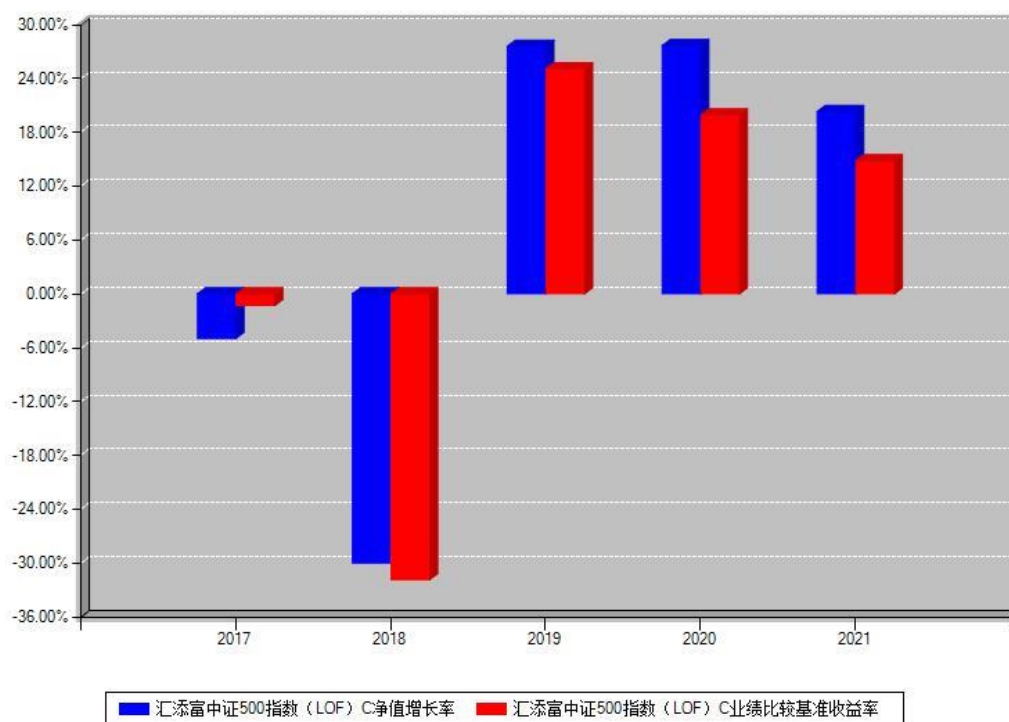
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益

率的比较

汇添富中证500指数 (LOF) A 每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数 (LOF) C 每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2017 年 08 月 10 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

§ 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。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、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2021 年，汇添富基金荣获“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2021 年，汇添富基金新成立 58 只公募基金，包括 31 只混合型基金，21 只股票型基金，6 只债券型基金。2021 年底，公司公募基金产品总数达 226 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2021 年，汇添富基金继续坚持重度垂直兼顾开放的互联网金融平台战略，在不断夯实自有平台基础建设、全方位提升平台架构及安全系统的基础上，持续提升自有平台创新能力。从投资的生命周期各阶段出发，通过“渐进式”的创新和打磨，创造差异化的竞争优势。业内开创性地打造基于社区的大社交板块，涵盖视频、直播、资讯等各个维度，为客户架设可链接的投资及资讯服务桥梁；推出包括资产分析、基金转购、亲情宝等在内的多个重磅功能，全方面提升客户体验。汇添富基金于年内取得投顾资格，展业后着力打造全自研的投顾体系，引导客户升级，上线一个月以来升级金额超十亿元，为公司业务拓展打下坚实的基础。全年自有平台精准营销体系初见成效，实现了客户数、活跃度、保有量的齐头并进，力争形成长

期增长的良性循环。对外合作上,进一步加深与多家互联网巨头的深度战略合作,继续大力开拓新型互联网销售及服务模式,实现与平台的合作共赢。

2021 年,汇添富基金持续推进大机构战略,机构业务规模保持较好的增长势头。公司深受专业机构投资者信任:与银行理财公司合作深入,为银行理财净值化转型提供综合解决方案;获得所有大型银行及保险委外专户组合,且保险委托管理规模同业领先。养老金业务方面,公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格,也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务规模、受托管理组合账户数量持续增加。

2021 年,公司以具有长久生命力、高辨识度的多策略产品体系为基础,通过“前瞻性”、“多层次”、“体系化”、“全方位”的渠道服务和投资者教育,积极利用银行以及券商线上化数字营销工具,力争切实做好客户触达、深入织好连接网络、扎实做好客户服务。全年合计开展超 4000 余场“价值投资添富行”线上、线下系列活动。持续大力开展目标收益定投、走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列客户活动,营销培训活动覆盖至银行和券商的网点、营业部。

2021 年,汇添富基金持续提升客户服务能力,全方位优化客户服务体系,为公司各项销售业务提供全方位支持。同时,持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设,丰富服务渠道,提升客户体验。

2021 年,香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式继续深化,并发挥显著成效,国际业务总资产管理规模稳步进步,QDII 及港股通项下公募基金业绩优秀,“港股通”类委外专户管理规模继续保持领先,海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2021 年,香港子公司在加强母公司投研一体化基础上,港股投资及海外债券投资业绩持续优异,汇添富中港策略基金获得晨星五星评级;根据彭博统计,基金在最近三年、五年同类港股基金中业绩分别列第三、第一位。

2021 年,汇添富基金全力助推“共同富裕”,深耕“河流·孩子”项目支持中西部乡村教育发展,投身农业升级、旅游扶持、人才培育等项目赋能乡村全面振兴;同时,在河南、山西灾情发生后第一时间支援灾区抢险防汛、重建家园。在乡村教育发展方面,汇添富连续第十四年开展“河流·孩子”公益助学计划,项目组在做好疫情防护的同时积极邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”提供公益服务,并顺利开展第十四届“河流·孩子”2021 乡村优秀青年教师培训,邀请不同领域的专家为来沪的 88 名乡村青年教师和校长们讲授多元化课程。截至目前,“河流·孩子”项目先后援建 10 所“添富小学”,培训乡村教师、校长超 1,400 人次,受益学生超 10,000 名,累计组织 80 多场“添富之爱”

公益行, 1,000 多人次志愿者提供公益服务 3 万多小时。在乡村产业振兴方面, 汇添富先后在汾西县开展建档立卡贫困学生资助项目, 支持内蒙古兴和县开展乡村旅游扶贫项目和返乡青年创业发展特色种植业项目, 捐助云南省普洱市孟连县芒信镇海东村开展“千户万头”肉牛养殖场示范产业项目基础设施建设, 为推动当地产业脱贫而不懈努力。在应急救援方面, 2021 年 7 月, 汇添富第一时间捐赠 300 万元人民币紧急驰援河南特大水灾, 全力支持鹤壁、新乡等灾区抢险救灾工作; 2021 年 10 月, 汇添富再次迅速展开山西水灾支援工作, 紧急筹措了 6000 多件总价值 100 万元的救援物资和生活物资, 连夜送至山西省临汾市、晋中市、运城城市 14 个汛情重灾县的最前线; 同时向孝义市捐赠 100 万元, 帮助受灾地区群众尽快恢复正常生活, 以及灾区灾后重建、生产恢复、防疫消杀等工作。

2022 年, 汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则, 进一步加强风险管理能力, 提升客户服务水平, 推动业务稳步发展, 为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

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		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2017 年 08 月 10 日		15	国籍: 中国。学历: 中国科学技术大学管理学博士。从业资格: 证券投资基金从业资格。从业经历: 曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理, 现任指数与量化投资部副总监

				<p>监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇</p>
--	--	--	--	---

				<p>添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019</p>
--	--	--	--	---

					<p>年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系,覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老保险组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合;涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:(1)在研究分析环节,公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统,规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程,使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。(2)在投资决策环节,公司建立健全投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限,合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。另外,公司还建立机制要求公募投资组合经理与资产管理计划投资组合经理互相隔离,且不能互相授权投资事宜。(3)在交易执行环节,本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门,实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易,内部制定了相应的交易管理规则,保证各投资组合获得公平的交易执行机会;对于银行间市场的现券、回购等场外交易,交易部在交易市场开展独立、公平的询价,确保交易得到公平执行;对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配,确保公平对待各投资组合。(4)在日常监控环节,公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式,对投资交易全过程实施监督,对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。(5)在报告分析环节,公司按季

度和年度编制公平交易分析报告,对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估,并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统中的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,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平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上,本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 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,本基金管理人管理的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 29 次,投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控,事后对交易时点、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

回顾 2021 年,上半年国内经济持续保持较高的景气度,企业经营状况改善,大宗商品价格整体上涨,PPI 上行,部分周期性行业维持高度景气,整体通胀压力不大,货币政策逐步常态化;下半年国内经济增速有所放缓,房地产等传统经济呈下行趋势,部分周期性行业从景气高点边际下行,稳增长及逆周期调节政策陆续出台。

政策方面,推进碳中和、增进社会平等、促进产业升级成为主基调。房地产、互联网、

教育监管政策频出，新能源、碳中和支持力度加码，高端制造和硬科技获得政策支持，专精特新相关主题成为市场关注热点。

行业角度，高端制造、新能源、信息技术等新兴产业维持高景气；同时，原材料价格上涨，叠加“碳中和”背景下的落后产能淘汰预期，周期性行业出现估值修复，股价显著上涨。风格角度，以中证 500、中证 1000 为代表的中小盘指数整体优于沪深 300 等大盘指数。在大市值、高机构共识特征的“核心资产”内部，高质量、高壁垒、高盈利稳定性的“茅指数”逐步让位于高科技、高景气、高成长的“宁组合”；中小市值内，低估值表现更好，小盘价值风格收益显著。

选股逻辑角度，投资的快逻辑整体优于慢逻辑。投资者对公司质地、竞争壁垒和盈利稳定性的要求有所弱化。跟随基本面边际变化的基本面动量类因子在上半年表现较好，侧重市场博弈的交易类因子全年表现较好，估值和低波动等逆向类因子整体有效但存在一定波动。市场有效性继续提升，在大中盘股票中获取超额收益的难度进一步提升。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 20.61%；C 类基金份额净值增长率为 20.31%。同期业绩比较基准收益率为 14.83%。

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 2022 年，市场整体震荡的可能性较大。不利因素包括：国内经济面临需求收缩、供给冲击、预期转弱的“三重压力”；美联储进入加息、缩表周期，影响新兴市场的外部流动性；赚钱效应减弱影响投资者行为，增量资金整体风险偏好可能有所降低。有利因素包括：国内不断强化的稳增长政策以及丰富的政策储备和政策空间；国内经济保持韧性，疫情对经济的影响可能持续减弱；除少数板块外，当前 A 股的整体估值水平合理，和其他市场相比处于相对较低的位置。

风格角度，大盘价值风格整体受益于稳增长，从基本面和估值角度下行风险较低，同时，大盘价值可能接力去年占优的小盘价值风格，加之当前市场边际增量资金风险偏好较低，安全性较高的资产可能相对受益。同时，市值下沉的趋势仍然持续，小盘股去年整体 Beta 强于大盘股，小盘股内部获取超额收益的空间也更为显著，今年小盘股的 Beta 性机会可能相对弱化。

行业角度，行业整体的持续性的 Beta 机会可能弱于过去两年。目前，以新能源、半导

体等行业为代表的高景气赛道成为市场共识,吸引大量资金,投资者对行业成长的速度和确定性有较高的预期,当前市场对不同赛道的定价也较为合理,高成长赛道高估值,低成长赛道低估值,站在年底来看,均衡配置的必要性较大。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面:

1、持续提升合规法务管理

深入践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化,持续宣导“正直”、“客户第一”的公司价值观,不断强化公司合规文化体系建设;持续完善各项制度和流程,制定多项合规审核标准,形成多项合规管理指引,对重点业务流程实施关键风险把控,有效保障各项业务规范开展;积极为各部门提供全面的合规咨询与法务支持,加强一线合规执行;独立开展事后合规检查监督,查漏补缺、防微杜渐;严格执行合规考核问责机制,认真组织和落实合规培训,不断提升全体员工的合规执业意识及合规履职能力。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前,加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性,为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外,本基金管理人坚持制度先行,通过制定或修订各项投资管理制度,为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中,管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等,有效保障投资交易行为合规。同时,通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示,完善日常投资合规风险监控体系。

事后,风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示,有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、加强稽核内审工作

通过开展日常风险排查,以及对重点业务开展专项稽核检查,尽早发现业务中存在的合规问题和风险隐患,并采取防范措施,督促责任部门落实整改;对风险事件和差错事件开展稽核审查,加强问责力度,促进业务合法合规开展;实施关键岗位离任审查,督促人员勤勉尽责、合规展业;配合监管检查与会计师事务所审计工作,通过问题反馈、实施整改,进一

步完善公司内部控制管理机制。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 60466941_B87 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐

	<p>述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据</p>

	<p>获取的审计证据, 就可能导致对汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	许培菁 韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
审计报告日期	2022 年 03 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	23,719,024.89	20,888,653.49
结算备付金		8,101,772.97	5,773,821.61
存出保证金		1,666,597.68	1,599,428.82
交易性金融资产	7.4.7.2	371,264,731.69	316,153,731.61
其中: 股票投资		371,126,184.49	315,194,074.37
基金投资		-	-
债券投资		138,547.20	959,657.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	20,747.72	34,362.26
应收股利		-	-
应收申购款		2,151,364.56	1,550,344.45

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		406,924,239.51	346,000,342.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,184,614.79	3,651,193.19
应付管理人报酬		167,256.94	154,233.88
应付托管费		33,451.36	30,846.79
应付销售服务费		28,730.40	28,348.81
应付交易费用	7.4.7.7	134,081.69	163,030.99
应交税费		47,920.79	2.67
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	219,702.03	219,016.12
负债合计		2,815,758.00	4,246,672.45
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	307,839,443.93	313,853,303.79
未分配利润	7.4.7.10	96,269,037.58	27,900,366.00
所有者权益合计		404,108,481.51	341,753,669.79
负债和所有者权益总计		406,924,239.51	346,000,342.24

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 307,839,443.93 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.3172 元，基金份额总额 202,719,670.47 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.3042 元，基金份额总额 105,119,773.46 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年01月01日 至2020年12月31 日
一、收入		64,369,976.46	111,525,683.16
1. 利息收入		780,743.86	1,125,666.99

其中：存款利息收入	7.4.7.11	315,942.70	503,281.40
债券利息收入		173,671.21	15,619.08
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		291,129.95	606,766.51
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		67,480,043.67	85,554,062.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	61,167,183.75	78,602,187.91
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	156,929.26	189,523.84
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	2,317,436.89	2,262,272.25
股利收益	7.4.7.17	3,838,493.77	4,500,078.86
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-3,952,552.19	24,729,755.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	61,741.12	116,197.32
减：二、费用		3,520,584.01	4,699,409.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,682,440.32	2,120,783.87
2. 托管费	7.4.10.2.2	336,488.00	424,156.76
3. 销售服务费		299,806.59	374,998.23
4. 交易费用	7.4.7.20	916,369.91	1,473,260.38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		8,343.21	8,334.12
7. 其他费用	7.4.7.21	277,135.98	297,875.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		60,849,392.45	106,826,274.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		60,849,392.45	106,826,274.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 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)	313,853,303.79	27,900,366.00	341,753,669.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	60,849,392.45	60,849,392.45
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)	-6,013,859.86	7,519,279.13	1,505,419.27
其中:1.基金申购款	764,833,755.35	154,633,782.13	919,467,537.48
2.基金赎回款	-770,847,615.21	-147,114,503.00	-917,962,118.21
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)	307,839,443.93	96,269,037.58	404,108,481.51
项目	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年12月31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)	509,151,036.15	-75,500,310.46	433,650,725.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	106,826,274.15	106,826,274.15
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)	-195,297,732.36	-3,425,597.69	-198,723,330.05
其中:1.基金申购款	888,266,690.09	-33,725,949.64	854,540,740.45
2.基金赎回款	-1,083,564,422.45	30,300,351.95	-1,053,264,070.50
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)	313,853,303.79	27,900,366.00	341,753,669.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2017]770 号文《关于准予汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 注册的批复》准予注册, 由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人向社会公开募集。基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效, 首次设立募集规模为 735,804,689.63 份基金份额。本基金为上市契约型开放式 (LOF), 存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标, 基金还可投资于其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(分离交易可转债)、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生工具(包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金进行被动式指数化投资, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为: 中证 500 指数收益率 $\times 95\%$ +银行人民币活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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;

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主要包括股票投资和债券投资等;

(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。

7.4.4.4 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的股票和债券，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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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）”。

7.4.4.9 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) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例 (2011 年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定 (2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定, 凡缴纳消费税、增值税、营业

税的单位和个人, 都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	23,719,024.89	20,888,653.49
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	23,719,024.89	20,888,653.49

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	339,236,025.45	371,126,184.49	31,890,159.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	132,176.00	138,547.20
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	132,176.00	138,547.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	339,368,201.45	371,264,731.69	31,896,530.24
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	279,419,150.28	315,194,074.37	35,774,924.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	827,778.90	959,657.24
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	827,778.90	959,657.24
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	280,246,929.18	316,153,731.61	35,906,802.43

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	9,846,080.00	-	-	-
（股指期货投资）	9,846,080.00			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,846,080.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,778,200.00	-	-	-
（股指期货投资）	8,778,200.00			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,778,200.00	-	-	-

注：本期末 2021 年 12 月 31 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IC2206	7	9,846,080.00	10,006,920.00	160,840.00
总额合计：			160,840.00	
减：可抵销期货暂收款			160,840.00	
股指期货投资净额：			0.00	

上年度末 2020 年 12 月 31 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IC2101	7.00	8,778,200.00	8,881,320.00	103,120.00
总额合计：			103,120.00	
减：可抵销期货暂收款			103,120.00	
股指期货投资净额：			0.00	

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	10,169.36	8,658.62
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,975.61	1,418.64
应收债券利息	1,811.16	3,939.87
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	6,759.14	20,256.80
其他	32.45	88.33
合计	20,747.72	34,362.26

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	134,081.69	163,030.99
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	134,081.69	163,030.99

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	8.76
应付证券出借违约金	-	-

应付审计费	80,000.00	80,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	19,702.03	19,007.36
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	219,702.03	219,016.12

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	188,653,666.27	188,653,666.27
本期申购	275,699,420.58	275,699,420.58
本期赎回 (以“-”号填列)	-261,633,416.38	-261,633,416.38
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	202,719,670.47	202,719,670.47
汇添富中证 500 指数 (LOF) C		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	125,199,637.52	125,199,637.52
本期申购	489,134,334.77	489,134,334.77
本期赎回 (以“-”号填列)	-509,214,198.83	-509,214,198.83
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	105,119,773.46	105,119,773.46
-----	----------------	----------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,057,309.50	1,322,104.01	17,379,413.51
本期利润	41,518,266.69	-2,899,920.66	38,618,346.03
本期基金份额交易产生的变动数	8,209,787.72	89,295.61	8,299,083.33
其中：基金申购款	57,659,736.10	728,274.56	58,388,010.66
基金赎回款	-49,449,948.38	-638,978.95	-50,088,927.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,785,363.91	-1,488,521.04	64,296,842.87
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,711,147.01	809,805.48	10,520,952.49
本期利润	23,283,677.95	-1,052,631.53	22,231,046.42
本期基金份额交易产生的变动数	-205,774.03	-574,030.17	-779,804.20
其中：基金申购款	97,895,422.77	-1,649,651.30	96,245,771.47
基金赎回款	-98,101,196.80	1,075,621.13	-97,025,575.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,789,050.93	-816,856.22	31,972,194.71

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	199,616.57	420,355.92
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	105,391.36	71,884.27

其他	10,934.77	11,041.21
合计	315,942.70	503,281.40

注：“其他”为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	310,436,392.81	532,932,356.21
减：卖出股票成本总额	249,269,209.06	454,330,168.30
买卖股票差价收入	61,167,183.75	78,602,187.91

7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
出借证券现金清偿总额	-	-
减：出借证券成本总额	-	-
减：应收证券出借利息	-	-
证券出借差价收入	-	-

7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,048,159.54	11,125,345.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,653,436.90	10,824,171.30
减：应收利息总额	237,793.38	111,650.28
买卖债券差价收入	156,929.26	189,523.84

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	2,317,436.89	2,262,272.25
外汇远期投资收益	-	-
外汇期货投资收益	-	-
国债期货投资收益	-	-

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,838,493.77	4,500,078.86
其中：证券出借权益补偿收入	141,706.72	652,770.52
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,838,493.77	4,500,078.86

7.4.7.18 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-4,010,272.19	24,888,538.21
——股票投资	-3,884,765.05	24,756,659.87
——债券投资	-125,507.14	131,878.34
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	57,720.00	-158,782.22
——权证投资	-	-
——期货投资	57,720.00	-158,782.22
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	-3,952,552.19	24,729,755.99

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	61,741.12	116,197.32
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	61,741.12	116,197.32

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	916,369.91	1,473,260.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	916,369.91	1,473,260.38

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	9,838.41	13,044.19
指数使用费	67,297.57	84,831.46
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	277,135.98	297,875.65

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金发起人
招商证券股份有限公司 (“招商证券”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
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
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 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 (%)
招商证券	607,953,137.49	100.00	850,602,638.90	100.00

7.4.10.1.2 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券成

		交总额的比例 (%)		交总额的比例 (%)
招商证券	17,752,362.92	100.00	21,164,915.73	100.00

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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 12 月 31 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 (%)
招商证券	528,702.12	100.00	134,081.69	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 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 (%)
招商证券	783,189.43	100.00	163,030.99	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,682,440.32	2,120,783.87
其中：支付销售机构的客户维护费	467,665.03	490,375.20

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	336,488.00	424,156.76

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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付指令,基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	48,301.83	48,301.83
招商证券股份有限公司	-	301.34	301.34
东方证券股份有限公司	-	14,869.56	14,869.56
合计	-	63,472.73	63,472.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计

汇添富基金管理股份有限公司	-	70,569.67	70,569.67
招商证券股份有限公司	-	159.86	159.86
东方证券股份有限公司	-	37,904.05	37,904.05
合计	-	108,633.58	108,633.58

注：本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务费年费率为 0.25%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

单位：人民币元

本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	-	-	-	-
上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证	912,292,186.00	606,766.51	42,551,125.00	20,256.80

券				
---	--	--	--	--

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	10,002,700.27
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	10,002,700.27
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%)	-	-
汇添富中证 500 指数 (LOF) C		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%)	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.5.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。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。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年01月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	
300774	倍杰特	2021年07月26日	2022年02月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	
300814	中	2021	2022	新	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	

	富 电 路	年 08 月 04 日	年 02 月 14 日	股 流 通 受 限						
300854	中 兰 环 保	2021 年 09 月 08 日	2022 年 03 月 16 日	新 股 流 通 受 限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	
300994	久 祺 股 份	2021 年 08 月 02 日	2022 年 02 月 14 日	新 股 流 通 受 限	11.90	45.45	407	4,843.30	18,498.15	
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	23.80	555	4,917.30	13,209.00	
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	26.06	782	6,482.78	20,378.92	
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	41.43	290	2,743.40	12,014.70	
301025	读 客 文 化	2021 年 07 月 06 日	2022 年 01 月 24 日	新 股 流 通 受 限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	
301026	浩 通 科	2021 年 07 月	2022 年 01 月	新 股 流 通	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	

	技	月	月	通						
		08	17	受						
		日	日	限						
301027	华蓝集团	2021年07月08日	2022年01月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	
301032	新柴股份	2021年07月15日	2022年01月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	
301033	迈普医学	2021年07月15日	2022年01月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	
301036	双乐股份	2021年07月21日	2022年02月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	
301037	保立佳	2021年07月21日	2022年02月07日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	
301038	深水规院	2021年07月22日	2022年02月07日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	
301039	中集车辆	2021年07月01日	2022年01月10日	新股流通受限	6.96	12.51	1,115	7,760.40	13,948.65	

		日	日	限						
301041	金百泽	2021年08月02日	2022年02月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	
301046	能辉科技	2021年08月10日	2022年02月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	
301048	金鹰重工	2021年08月11日	2022年02月28日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	
301049	超越科技	2021年08月17日	2022年02月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	
301052	果麦文化	2021年08月23日	2022年02月28日	新股流通受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	
301053	远信工业	2021年08月25日	2022年03月01日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	
301055	张小泉	2021年08月26日	2022年03月07日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	
301057	汇	2021	2022	新	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	

	隆新材	年 08 月 31 日	年 03 月 09 日	股 流 通 受 限						
301058	中粮工科	2021 年 09 月 01 日	2022 年 03 月 09 日	新 股 流 通 受 限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	
301062	上海艾录	2021 年 09 月 07 日	2022 年 03 月 14 日	新 股 流 通 受 限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	
301063	海锅股份	2021 年 09 月 09 日	2022 年 03 月 24 日	新 股 流 通 受 限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	
301068	大地海洋	2021 年 09 月 16 日	2022 年 03 月 28 日	新 股 流 通 受 限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	
301069	凯盛新材	2021 年 09 月 16 日	2022 年 03 月 28 日	新 股 流 通 受 限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	
301072	中捷精工	2021 年 09 月 22 日	2022 年 03 月 29 日	新 股 流 通 受 限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	
301073	君亭酒	2021 年 09 月	2022 年 03 月	新 股 流 通	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	

	店	月 22 日	月 30 日	通 受 限						
301078	孩子王	2021 年 09 月 30 日	2022 年 04 月 14 日	新 股 流 通 受 限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	
301079	邵阳液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 04 月 19 日	新 股 流 通 受 限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	
301092	争光股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 05 月 05 日	新 股 流 通 受 限	36.31	35.52	274	9,948.94	9,732.48	
301093	华兰股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 05 月 05 日	新 股 流 通 受 限	58.08	49.85	197	11,441.76	9,820.45	
301098	金埔园林	2021 年 11 月 04 日	2022 年 05 月 12 日	新 股 流 通 受 限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 11 日	新 股 流 通 受 限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	
688167	炬光科技	2021 年 12 月 17	2022 年 06 月 24	新 股 流 通 受	78.69	176.67	978	76,958.82	172,783.26	

688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年01月06日	新股流通受限	41.98	41.98	3,244	136,183.12	136,183.12	
688509	正元地信	2021年07月22日	2022年02月07日	新股流通受限	1.97	6.17	15,433	30,403.01	95,221.61	
688553	汇宇制药	2021年10月14日	2022年04月26日	新股流通受限	38.87	32.11	2,499	97,136.13	80,242.89	
688707	振华新材	2021年09月06日	2022年03月14日	新股流通受限	11.75	47.16	7,127	83,742.25	336,109.32	
688711	宏微科技	2021年08月25日	2022年03月01日	新股流通受限	27.51	116.52	1,572	43,245.72	183,169.44	
7.4.12.1.2 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
					-	-	-	-	-	
7.4.12.1.3 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	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

				类型						
					-	-	-	-	-	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	广东宏大	2021年12月20日	重大事项停牌	30.12	2022年01月04日	31.00	23,000	751,843.76	692,760.00	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日		期末估值单价	数量(单位：张)	期末估值总额
1	000723	美锦能源	2022年01月04日	2022年01月06日	16.23	40,400	655,692.00
2	601615	明阳智能	2022年01月04日	2022年01月04日	26.10	23,900	623,790.00

3	601117	中国化学	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 06 日	12.00	48,000	576,000.00
4	002185	华天科技	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 06 日	12.71	35,200	447,392.00
5	600141	兴发集团	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	37.88	11,800	446,984.00
6	300058	蓝色光标	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 06 日	10.73	39,300	421,689.00
7	600418	江淮汽车	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 10 日	17.40	23,600	410,640.00
8	002080	中材科技	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	34.02	10,200	347,004.00
9	000807	云铝股份	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 06 日	11.17	29,600	330,632.00
10	000039	中集集团	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	17.16	18,700	320,892.00
11	600522	中天科技	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	16.96	18,700	317,152.00
12	601016	节能风电	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 06 日	6.51	47,500	309,225.00
13	601198	东兴证券	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 06 日	11.63	25,400	295,402.00

14	300383	光环新网	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 11 日	14.84	19,300	286,412.00
15	688521	芯原股份	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	77.36	3,700	286,232.00
16	002056	横店东磁	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	18.87	13,500	254,745.00
17	002131	利欧股份	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	2.46	103,300	254,118.00
18	000887	中鼎股份	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 06 日	21.81	11,600	252,996.00
19	002603	以岭药业	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	19.60	12,700	248,920.00
20	600875	东方电气	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	21.42	11,500	246,330.00
21	603077	和邦生物	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	3.41	70,400	240,064.00
22	002002	鸿达兴业	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 06 日	6.06	39,500	239,370.00
23	002065	东华软件	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 06 日	7.80	30,300	236,340.00
24	000027	深圳能源	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	8.10	29,000	234,900.00

25	002203	海亮股份	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	12.43	18,000	223,740.00
26	601872	招商轮船	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 06 日	4.10	51,100	209,510.00
27	600863	内蒙华电	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 06 日	3.94	51,600	203,304.00
28	601866	中远海发	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 06 日	3.25	59,300	192,725.00
29	600498	烽火通信	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	17.98	10,400	186,992.00
30	600718	东软集团	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	13.56	13,200	178,992.00
31	002128	电投能源	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	14.85	11,900	176,715.00
32	002174	游族网络	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 06 日	15.24	11,200	170,688.00
33	000983	山西焦煤	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	8.27	20,000	165,400.00
34	002127	南极电商	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	6.90	23,400	161,460.00
35	600021	上海电力	2022 年 01 月 10 日	-	2022 年 01 月 10 日	12.82	12,300	157,686.00

36	601456	国联证券	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	13.97	10,900	152,273.00
37	002506	协鑫集成	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	3.80	39,800	151,240.00
38	002434	万里扬	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	14.74	10,200	150,348.00
39	300166	东方国信	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 06 日	10.80	12,200	131,760.00
40	688321	微芯生物	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	35.01	3,700	129,537.00
41	000559	万向钱潮	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	6.37	20,200	128,674.00
42	002110	三钢闽光	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	6.80	18,700	127,160.00
43	000883	湖北能源	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	5.24	23,200	121,568.00
44	601611	中国核建	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	9.97	12,100	120,637.00
45	000089	深圳机场	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	7.32	15,600	114,192.00
46	002408	齐翔腾达	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	10.50	10,700	112,350.00

47	688289	圣湘生物	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	59.00	1,800	106,200.00
48	601860	紫金银行	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	3.35	27,900	93,465.00
49	002701	奥瑞金	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	7.00	13,100	91,700.00
50	601992	金隅集团	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	2.84	31,800	90,312.00
51	000540	中天金融	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	2.64	32,100	84,744.00
52	600707	彩虹股份	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	6.82	12,200	83,204.00
53	600297	广汇汽车	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	2.67	31,000	82,770.00
54	600567	山鹰国际	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	3.29	24,700	81,263.00
55	300869	康泰医学	2022 年 01 月 06 日	-	2022 年 01 月 06 日	40.55	1,800	72,990.00
56	600811	东方集团	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	3.01	22,900	68,929.00
57	600959	江苏有线	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	3.29	20,400	67,116.00

58	600026	中远海能	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	5.92	10,600	62,752.00
59	601718	际华集团	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	2.98	20,100	59,898.00
60	600120	浙江东方	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	4.42	13,300	58,786.00
61	000959	首钢股份	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	5.73	10,200	58,446.00
62	000758	中色股份	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	5.46	10,500	57,330.00
63	600823	世茂股份	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	3.28	17,200	56,416.00
64	601975	招商南油	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	2.01	26,400	53,064.00
65	600126	杭钢股份	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	5.13	10,300	52,839.00
66	600266	城建发展	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	4.50	10,400	46,800.00
67	600717	天津港	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	4.19	11,000	46,090.00
68	600339	中油工程	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	3.08	12,700	39,116.00

69	000046	泛海控股	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	1.88	15,700	29,516.00
70	600466	蓝光发展	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	2.04	11,400	23,256.00
71	300418	昆仑万维	2022 年 01 月 04 日	-	2022 年 01 月 04 日	23.15	1,000	23,150.00
合计	-	-	-	-	-	-	1,577,300	13,340,024.00

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

本基金所持证券均在证券交易所上市; 因此, 除在附注 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及部分应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本 期 末	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
-------------	--------	--------	-------------	--------------	------------------	-----	----

2021 年 12 月 31 日					上		
资产							
银行存款	23,719,024.89	-	-	-	-	-	23,719,024.89
结算备付金	8,101,772.97	-	-	-	-	-	8,101,772.97
存出保证金	65,490.48	-	-	-	-	1,601,107.20	1,666,597.68
交易性金融资产	-	-	138,547.20	-	-	371,126,184.49	371,264,731.69
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	20,747.72	20,747.72
应收申购款	186,673.78	-	-	-	-	1,964,690.78	2,151,364.56
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	32,072,962.12	-	138,547.20	-	-	374,712,730.19	406,924,239.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,184,614.79	2,184,614.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	167,256.94	167,256.94
应付托	-	-	-	-	-	33,451.36	33,451.36

管 费							
应 付 证 券 清 算 款	-	-	-	-	-	-	-
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	28,730.40	28,730.40
应 付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	134,081.69	134,081.69
应 交 税 费	-	-	-	-	-	47,920.79	47,920.79
应 付 利 息	-	-	-	-	-	-	-
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
其	-	-	-	-	-	219,702.03	219,702.03

他 负 债							
负 债 总 计	-	-	-	-	-	2,815,758.00	2,815,758.00
利 率 敏 感 度 缺 口	32,072,962.1 2	-	138,547.2 0	-	-	371,896,972.1 9	404,108,481.5 1
上 年 度 末 202 0 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	20,888,653.4 9	-	-	-	-	-	20,888,653.49
结 算 备 付 金	5,773,821.61	-	-	-	-	-	5,773,821.61
存 出 保 证 金	178,417.62	-	-	-	-	1,421,011.20	1,599,428.82
交 易 性 金	95,115.00	85,727.0 1	778,815.2 3	-	-	315,194,074.3 7	316,153,731.6 1

融资产							
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	34,362.26	34,362.26
应收申购款	64,786.96	-	-	-	-	1,485,557.49	1,550,344.45
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	27,000,794.68	85,727.01	778,815.23	-	-	318,135,005.32	346,000,342.24

计							
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,651,193.19	3,651,193.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	154,233.88	154,233.88
应付托管费	-	-	-	-	-	30,846.79	30,846.79
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	28,348.81	28,348.81
应	-	-	-	-	-	163,030.99	163,030.99

付交易费用							
应交税费	-	-	-	-	-	2.67	2.67
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	219,016.12	219,016.12
负债总计	-	-	-	-	-	4,246,672.45	4,246,672.45
利率敏感度缺口	27,000,794.68	85,727.01	778,815.23	-	-	313,888,332.87	341,753,669.79

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；

	4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	83.96	494.37
	基准利率增加 25 个基点	-83.84	-493.06

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票、债券，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	371,126,184.49	91.84	315,194,074.37	92.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	138,547.20	0.03	959,657.24	0.28
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	371,264,731.69	91.87	316,153,731.61	92.51

本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股

和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	中证小盘 500 指数上涨 5%	19,072,019.74	15,774,520.37
	中证小盘 500 指数下跌 5%	-19,072,019.74	-15,774,520.37

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为人民币 369,041,738.67 元，属于第二层次的余额为人民币 1,019,930.05 元，属于第三层次的余额为人民币 1,203,062.97 元（于 2020 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为

人民币 313,346,530.28 元,属于第二层次的余额为人民币 761,496.24 元,属于第三层次的余额为人民币 2,045,705.09 元)。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值期末余额为人民币 1,203,062.97 元,期初余额为人民币 2,045,705.09 元,本期减少人民币 842,642.12 元。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号-金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号-套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除上述事项外,截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	371,126,184.49	91.20

	其中：股票	371,126,184.49	91.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	138,547.20	0.03
	其中：债券	138,547.20	0.03
	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	31,820,797.86	7.82
8	其他各项资产	3,838,709.96	0.94
9	合计	406,924,239.51	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 13,340,024.00 元，占期末基金资产净值比例 3.30%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,152,386.00	1.03
B	采矿业	14,444,248.84	3.57
C	制造业	225,301,295.41	55.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,855,693.91	2.93
E	建筑业	7,114,322.76	1.76
F	批发和零售业	10,429,563.20	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	8,806,878.70	2.18
H	住宿和餐饮业	2,209,283.60	0.55
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,887,687.26	7.89
J	金融业	26,933,646.84	6.66
K	房地产业	8,775,667.20	2.17
L	租赁和商务服务业	4,191,141.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	1,314,413.00	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	3,226,149.21	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	772,143.57	0.19
R	文化、体育和娱乐业	4,841,530.00	1.20
S	综合	2,705,869.20	0.67
	合计	368,961,919.70	91.30

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,504,899.70	0.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	89,684.59	0.02
F	批发和零售业	36,294.54	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	136,183.12	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	220,301.87	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	74,546.85	0.02
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	97,746.12	0.02
S	综合	-	-
	合计	2,164,264.79	0.54

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002340	格林美	255,500	2,644,425.00	0.65
2	600522	中天科技	140,500	2,382,880.00	0.59
3	000733	振华科技	19,000	2,361,320.00	0.58
4	000723	美锦能源	136,200	2,210,526.00	0.55
5	601615	明阳智	82,900	2,163,690.00	0.54

		能			
6	600399	抚顺特钢	84,300	2,088,111.00	0.52
7	600885	宏发股份	27,641	2,063,124.24	0.51
8	600884	杉杉股份	61,775	2,024,366.75	0.50
9	000009	中国宝安	138,040	1,991,917.20	0.49
10	002384	东山精密	73,000	1,978,300.00	0.49
11	601117	中国化学	162,200	1,946,400.00	0.48
12	002013	中航机电	104,300	1,896,174.00	0.47
13	601555	东吴证券	213,590	1,892,407.40	0.47
14	002385	大北农	176,800	1,854,632.00	0.46
15	300285	国瓷材料	43,000	1,830,510.00	0.45
16	002180	纳思达	37,300	1,781,448.00	0.44
17	002268	卫士通	31,330	1,752,600.20	0.43
18	300088	长信科技	131,200	1,742,336.00	0.43
19	300751	迈为股份	2,700	1,734,210.00	0.43
20	300037	新宙邦	15,200	1,717,600.00	0.43
21	605358	立昂微	14,300	1,716,143.00	0.42
22	600765	中航重机	33,500	1,691,415.00	0.42
23	688099	晶晨股份	12,939	1,684,657.80	0.42
24	600563	法拉电子	7,101	1,650,272.40	0.41
25	688005	容百科技	14,153	1,635,803.74	0.40
26	600298	安琪酵母	26,600	1,605,576.00	0.40
27	002028	思源电气	32,577	1,603,114.17	0.40
28	600256	广汇能源	245,100	1,602,954.00	0.40

29	600862	中航高科	44,601	1,594,931.76	0.39
30	600141	兴发集团	41,340	1,565,959.20	0.39
31	300253	卫宁健康	92,000	1,541,920.00	0.38
32	600487	亨通光电	101,000	1,527,120.00	0.38
33	300363	博腾股份	17,000	1,520,650.00	0.38
34	002185	华天科技	118,800	1,509,948.00	0.37
35	000988	华工科技	53,700	1,496,082.00	0.37
36	603456	九洲药业	26,400	1,485,264.00	0.37
37	601636	旗滨集团	86,000	1,470,600.00	0.36
38	600392	盛和资源	74,760	1,466,791.20	0.36
39	300058	蓝色光标	132,500	1,421,725.00	0.35
40	600754	锦江酒店	24,101	1,412,318.60	0.35
41	600418	江淮汽车	80,600	1,402,440.00	0.35
42	601168	西部矿业	101,900	1,386,859.00	0.34
43	000630	铜陵有色	394,200	1,371,816.00	0.34
44	300699	光威复材	16,200	1,368,576.00	0.34
45	603613	国联股份	12,700	1,365,250.00	0.34
46	603589	口子窖	19,100	1,353,617.00	0.33
47	300223	北京君正	10,100	1,353,400.00	0.33
48	600516	方大炭素	122,000	1,320,040.00	0.33
49	002797	第一创业	179,900	1,316,868.00	0.33
50	000998	隆平高科	56,400	1,311,864.00	0.32

51	603267	鸿远电子	7,300	1,309,912.00	0.32
52	300136	信维通信	51,600	1,306,512.00	0.32
53	002138	顺络电子	34,000	1,298,120.00	0.32
54	601077	渝农商行	330,600	1,272,810.00	0.31
55	600486	扬农化工	9,700	1,272,640.00	0.31
56	300308	中际旭创	29,700	1,262,250.00	0.31
57	600875	东方电气	58,700	1,257,354.00	0.31
58	000728	国元证券	163,100	1,255,870.00	0.31
59	600038	中直股份	15,600	1,252,680.00	0.31
60	300724	捷佳伟创	10,900	1,245,870.00	0.31
61	601689	拓普集团	23,498	1,245,394.00	0.31
62	688536	思瑞浦	1,600	1,228,800.00	0.30
63	600233	圆通速递	73,300	1,222,644.00	0.30
64	002353	杰瑞股份	30,441	1,217,640.00	0.30
65	002212	天融信	63,400	1,215,378.00	0.30
66	002080	中材科技	35,700	1,214,514.00	0.30
67	300146	汤臣倍健	45,000	1,213,200.00	0.30
68	002409	雅克科技	14,900	1,209,433.00	0.30
69	300763	锦浪科技	5,200	1,204,060.00	0.30
70	300474	景嘉微	7,900	1,202,380.00	0.30
71	002223	鱼跃医疗	31,800	1,202,040.00	0.30
72	603893	瑞芯微	8,700	1,191,030.00	0.29
73	000519	中兵红箭	44,600	1,189,482.00	0.29
74	300418	昆仑万	51,200	1,185,280.00	0.29

		维			
75	688065	凯赛生物	6,400	1,179,392.00	0.29
76	002673	西部证券	143,300	1,156,431.00	0.29
77	600733	北汽蓝谷	114,700	1,149,294.00	0.28
78	000547	航天发展	68,500	1,143,950.00	0.28
79	600482	中国动力	57,600	1,134,720.00	0.28
80	600705	中航产融	285,400	1,133,038.00	0.28
81	000932	华菱钢铁	221,580	1,132,273.80	0.28
82	000636	风华高科	37,900	1,129,420.00	0.28
83	688208	道通科技	14,215	1,128,671.00	0.28
84	002439	启明星辰	39,500	1,126,935.00	0.28
85	600699	均胜电子	51,100	1,122,667.00	0.28
86	600188	兖矿能源	47,700	1,122,381.00	0.28
87	000039	中集集团	65,340	1,121,234.40	0.28
88	000807	云铝股份	99,800	1,114,766.00	0.28
89	603077	和邦生物	326,700	1,114,047.00	0.28
90	300296	利亚德	108,600	1,113,150.00	0.28
91	000739	普洛药业	31,600	1,108,844.00	0.27
92	002444	巨星科技	36,300	1,107,513.00	0.27
93	688002	睿创微纳	14,078	1,106,108.46	0.27
94	603605	珀莱雅	5,300	1,104,043.00	0.27
95	600529	山东药玻	25,100	1,101,890.00	0.27
96	002465	海格通信	98,500	1,075,620.00	0.27

97	002507	涪陵榨菜	28,200	1,065,960.00	0.26
98	000738	航发控制	35,100	1,062,828.00	0.26
99	600988	赤峰黄金	71,100	1,059,390.00	0.26
100	002030	达安基因	52,495	1,053,049.70	0.26
101	000960	锡业股份	53,400	1,042,902.00	0.26
102	601016	节能风电	160,000	1,041,600.00	0.26
103	600521	华海药业	47,700	1,033,182.00	0.26
104	002273	水晶光电	59,381	1,032,635.59	0.26
105	600637	东方明珠	109,200	1,031,940.00	0.26
106	603290	斯达半导	2,700	1,028,700.00	0.25
107	600549	厦门钨业	45,400	1,027,402.00	0.25
108	600177	雅戈尔	148,200	1,021,098.00	0.25
109	600732	爱旭股份	43,600	1,018,496.00	0.25
110	603444	吉比特	2,400	1,012,440.00	0.25
111	688521	芯原股份	13,023	1,007,459.28	0.25
112	601198	东兴证券	85,700	996,691.00	0.25
113	002078	太阳纸业	86,200	990,438.00	0.25
114	600704	物产中大	166,700	986,864.00	0.24
115	600201	生物股份	60,178	983,910.30	0.24
116	603127	昭衍新药	8,500	981,155.00	0.24
117	002557	洽洽食品	15,900	975,624.00	0.24
118	601128	常熟银行	146,900	971,009.00	0.24
119	600642	申能股	131,400	968,418.00	0.24

		份			
120	002156	通富微电	49,700	965,671.00	0.24
121	300383	光环新网	65,000	964,600.00	0.24
122	002985	北摩高科	8,000	963,680.00	0.24
123	600879	航天电子	116,000	955,840.00	0.24
124	600497	驰宏锌锗	190,500	950,595.00	0.24
125	002299	圣农发展	39,300	949,881.00	0.24
126	600369	西南证券	177,700	940,033.00	0.23
127	300357	我武生物	16,400	939,720.00	0.23
128	600027	华电国际	174,400	933,040.00	0.23
129	000830	鲁西化工	60,993	930,753.18	0.23
130	600160	巨化股份	72,060	930,294.60	0.23
131	600039	四川路桥	76,500	921,060.00	0.23
131	002739	万达电影	59,500	921,060.00	0.23
133	002092	中泰化学	96,500	920,610.00	0.23
134	600372	中航电子	41,000	917,990.00	0.23
135	000623	吉林敖东	49,700	917,959.00	0.23
136	300618	寒锐钴业	11,300	906,034.00	0.22
137	002508	老板电器	25,100	904,102.00	0.22
138	600316	洪都航空	23,001	898,419.06	0.22
139	000983	山西焦煤	108,500	897,295.00	0.22
140	600580	卧龙电驱	49,000	896,210.00	0.22

141	000629	攀钢钒钛	229,600	893,144.00	0.22
142	601997	贵阳银行	136,800	890,568.00	0.22
143	002249	大洋电机	101,200	889,548.00	0.22
144	603198	迎驾贡酒	12,800	888,960.00	0.22
145	002131	利欧股份	359,692	884,842.32	0.22
146	300115	长盈精密	44,520	883,276.80	0.22
147	002373	千方科技	58,900	880,555.00	0.22
148	300017	网宿科技	130,700	874,383.00	0.22
149	002936	郑州银行	275,159	869,502.44	0.22
150	002603	以岭药业	44,360	869,456.00	0.22
151	002422	科伦药业	45,500	861,315.00	0.21
152	600170	上海建工	238,200	857,520.00	0.21
153	000887	中鼎股份	39,300	857,133.00	0.21
154	000050	深天马 A	65,700	855,414.00	0.21
155	000825	太钢不锈	121,500	855,360.00	0.21
156	600118	中国卫星	31,500	855,225.00	0.21
157	300070	碧水源	118,500	852,015.00	0.21
158	603218	日月股份	25,800	850,110.00	0.21
159	000400	许继电气	32,500	848,250.00	0.21
160	600166	福田汽车	246,300	847,272.00	0.21
161	600867	通化东宝	76,700	840,632.00	0.21
162	600859	王府井	31,102	839,754.00	0.21
163	000750	国海证	203,550	836,590.50	0.21

		券			
164	600803	新奥股份	45,500	835,380.00	0.21
165	002191	劲嘉股份	55,200	835,176.00	0.21
166	600153	建发股份	91,700	831,719.00	0.21
167	002506	协鑫集成	218,500	830,300.00	0.21
168	002926	华西证券	84,200	829,370.00	0.21
169	300168	万达信息	63,400	825,468.00	0.20
170	300001	特锐德	33,101	823,221.87	0.20
171	600909	华安证券	151,670	820,534.70	0.20
172	002372	伟星新材	33,680	819,097.60	0.20
173	002266	浙富控股	114,800	817,376.00	0.20
174	000027	深圳能源	100,660	815,346.00	0.20
175	600236	桂冠电力	126,100	809,562.00	0.20
176	603707	健友股份	19,230	807,660.00	0.20
177	002002	鸿达兴业	133,200	807,192.00	0.20
178	600008	首创环保	235,840	804,214.40	0.20
179	600066	宇通客车	72,800	802,256.00	0.20
180	300251	光线传媒	62,400	801,840.00	0.20
181	300009	安科生物	61,076	799,484.84	0.20
182	000513	丽珠集团	19,864	798,731.44	0.20
183	002056	横店东磁	42,300	798,201.00	0.20
184	002065	东华软件	102,300	797,940.00	0.20
185	000997	新大	44,000	797,280.00	0.20

		陆			
186	600258	首旅酒店	30,500	796,965.00	0.20
187	600271	航天信息	59,400	795,366.00	0.20
188	000021	深科技	50,100	793,584.00	0.20
189	002152	广电运通	66,300	788,970.00	0.20
190	002408	齐翔腾达	74,720	784,560.00	0.19
191	600171	上海贝岭	30,500	782,630.00	0.19
192	000975	银泰黄金	89,128	782,543.84	0.19
193	600535	天士力	49,300	781,405.00	0.19
194	002203	海亮股份	62,800	780,604.00	0.19
195	002221	东华能源	61,500	774,285.00	0.19
196	600536	中国软件	15,500	773,915.00	0.19
197	300244	迪安诊断	23,001	772,143.57	0.19
198	000656	金科股份	170,800	765,184.00	0.19
199	603156	养元饮品	26,900	764,229.00	0.19
200	002500	山西证券	115,010	759,066.00	0.19
201	300026	红日药业	96,200	753,246.00	0.19
202	300630	普利制药	13,675	752,672.00	0.19
203	600348	华阳股份	63,500	752,475.00	0.19
204	002572	索菲亚	33,800	750,360.00	0.19
205	300212	易华录	21,180	748,713.00	0.19
206	601005	重庆钢铁	357,600	747,384.00	0.18
207	300024	机器人	66,800	746,156.00	0.18
208	600998	九州通	49,900	734,528.00	0.18
209	603568	伟明环保	20,107	734,508.71	0.18

210	600315	上海家化	18,100	731,421.00	0.18
211	000878	云南铜业	54,400	727,328.00	0.18
212	000012	南玻 A	73,165	726,528.45	0.18
213	601699	潞安环能	64,000	723,840.00	0.18
214	000970	中科三环	44,800	719,040.00	0.18
215	002745	木林森	47,500	718,675.00	0.18
216	300315	掌趣科技	147,600	717,336.00	0.18
217	002127	南极电商	103,800	716,220.00	0.18
218	603712	七一二	16,500	714,450.00	0.18
219	600673	东阳光	80,400	713,952.00	0.18
220	002195	二三四五	305,001	713,702.34	0.18
221	600415	小商品城	146,600	711,010.00	0.18
222	601872	招商轮船	172,300	706,430.00	0.17
223	000537	广宇发展	29,200	703,720.00	0.17
224	002250	联化科技	39,100	702,627.00	0.17
225	600801	华新水泥	36,400	702,520.00	0.17
226	002511	中顺洁柔	41,879	699,798.09	0.17
227	000999	华润三九	20,400	698,496.00	0.17
228	002019	亿帆医药	39,500	695,990.00	0.17
229	300182	捷成股份	109,800	695,034.00	0.17
230	002683	广东宏大	23,000	692,760.00	0.17
231	300463	迈克生物	23,600	688,884.00	0.17
232	000690	宝新能源	116,200	687,904.00	0.17

233	600863	内蒙华电	173,900	685,166.00	0.17
234	002153	石基信息	23,800	684,012.00	0.17
235	600208	新湖中宝	229,200	683,016.00	0.17
236	600970	中材国际	59,700	682,371.00	0.17
237	601866	中远海发	209,700	681,525.00	0.17
238	000060	中金岭南	136,300	669,233.00	0.17
239	600517	国网英大	91,500	667,035.00	0.17
240	688006	杭可科技	6,200	666,996.00	0.17
241	600380	健康元	51,708	663,930.72	0.16
242	601778	晶科科技	77,100	657,663.00	0.16
243	000686	东北证券	74,900	657,622.00	0.16
244	002831	裕同科技	19,480	656,281.20	0.16
245	002505	鹏都农牧	170,700	652,074.00	0.16
246	600839	四川长虹	196,500	650,415.00	0.16
247	600498	烽火通信	36,100	649,078.00	0.16
248	000930	中粮科技	59,700	648,939.00	0.16
249	600155	华创阳安	65,100	648,396.00	0.16
250	002294	信立泰	23,600	644,752.00	0.16
251	300482	万孚生物	16,290	641,500.20	0.16
252	600390	五矿资本	120,500	641,060.00	0.16
253	002939	长城证券	49,500	641,025.00	0.16
254	002701	奥瑞金	91,400	639,800.00	0.16
255	000729	燕京啤酒	75,400	638,638.00	0.16

256	600511	国药股份	20,202	636,969.06	0.16
257	600667	太极实业	78,700	635,896.00	0.16
258	603858	步长制药	30,100	634,809.00	0.16
259	000401	冀东水泥	52,900	632,684.00	0.16
260	600500	中化国际	73,700	630,872.00	0.16
261	601992	金隅集团	222,100	630,764.00	0.16
262	600728	佳都科技	75,400	628,082.00	0.16
263	600718	东软集团	46,100	625,116.00	0.15
264	600895	张江高科	41,300	621,978.00	0.15
265	300376	易事特	61,700	620,085.00	0.15
266	600216	浙江医药	36,200	618,296.00	0.15
267	600158	中体产业	40,800	616,896.00	0.15
268	002382	蓝帆医疗	37,600	612,504.00	0.15
268	002004	华邦健康	84,600	612,504.00	0.15
270	600282	南钢股份	164,600	609,020.00	0.15
271	002128	电投能源	41,000	608,850.00	0.15
272	601179	中国西电	109,700	608,835.00	0.15
273	002532	天山铝业	74,400	606,360.00	0.15
274	002430	杭氧股份	20,200	606,202.00	0.15
275	603225	新凤鸣	40,820	606,177.00	0.15
276	002966	苏州银行	89,200	603,884.00	0.15
277	000598	兴蓉环境	95,400	602,928.00	0.15
278	600764	中国海	14,700	597,702.00	0.15

		防			
279	300072	三聚环 保	75,100	595,543.00	0.15
280	002670	国盛金 控	61,798	593,260.80	0.15
281	002368	太极股 份	21,502	592,165.08	0.15
282	000540	中天金 融	223,800	590,832.00	0.15
283	600985	淮北矿 业	52,800	590,304.00	0.15
284	002595	豪迈科 技	21,200	588,512.00	0.15
285	002174	游族网 络	38,500	586,740.00	0.15
286	600528	中铁工 业	71,300	585,373.00	0.14
287	002396	星网锐 捷	24,600	579,822.00	0.14
288	688188	柏楚电 子	1,500	578,190.00	0.14
289	000581	威孚高 科	26,800	577,272.00	0.14
290	600297	广汇汽 车	216,100	576,987.00	0.14
291	600409	三友化 工	66,200	575,940.00	0.14
292	603866	桃李面 包	20,228	574,475.20	0.14
293	688029	南微医 学	2,700	574,209.00	0.14
294	002048	宁波华 翔	26,500	573,195.00	0.14
295	603638	艾迪精 密	17,920	572,006.40	0.14
296	002958	青农商 行	148,100	571,666.00	0.14
297	002010	传化智 联	65,700	571,590.00	0.14
298	600827	百联股 份	42,800	570,524.00	0.14
299	600755	厦门国 贸	78,900	568,869.00	0.14

300	600567	山鹰国际	172,400	567,196.00	0.14
301	601717	郑煤机	48,900	566,751.00	0.14
302	603885	吉祥航空	31,800	564,450.00	0.14
303	300271	华宇软件	44,400	563,880.00	0.14
304	002925	盈趣科技	16,480	560,814.40	0.14
305	600060	海信视像	41,600	559,520.00	0.14
306	000709	河钢股份	226,700	557,682.00	0.14
307	000778	新兴铸管	127,800	553,374.00	0.14
308	002183	怡亚通	83,400	552,108.00	0.14
309	600598	北大荒	37,900	551,824.00	0.14
310	002075	沙钢股份	94,300	549,769.00	0.14
311	600131	国网信通	25,100	548,435.00	0.14
312	600325	华发股份	90,700	546,014.00	0.14
313	600820	隧道股份	101,400	545,532.00	0.13
314	600967	内蒙一机	45,600	544,920.00	0.13
315	000883	湖北能源	103,500	542,340.00	0.13
316	600737	中粮糖业	57,600	541,440.00	0.13
317	600507	方大特钢	69,349	540,922.20	0.13
318	600782	新钢股份	101,800	537,504.00	0.13
319	601456	国联证券	38,000	530,860.00	0.13
320	600021	上海电力	41,400	530,748.00	0.13
321	600597	光明乳业	36,500	529,980.00	0.13
322	601880	辽港股	305,700	528,861.00	0.13

		份			
323	002690	美亚光电	14,100	528,186.00	0.13
324	603883	老百姓	10,682	527,477.16	0.13
325	600566	济川药业	18,600	527,124.00	0.13
326	600022	山东钢铁	292,500	523,575.00	0.13
327	000990	诚志股份	33,000	522,060.00	0.13
328	600707	彩虹股份	76,200	519,684.00	0.13
329	002281	光迅科技	22,305	519,483.45	0.13
330	002434	万里扬	35,200	518,848.00	0.13
331	000987	越秀金控	59,200	515,040.00	0.13
332	603927	中科软	18,820	514,915.20	0.13
333	600435	北方导航	47,900	511,572.00	0.13
334	601106	中国一重	146,900	511,212.00	0.13
335	600663	陆家嘴	46,900	509,334.00	0.13
336	002124	天邦股份	78,500	505,540.00	0.13
337	601577	长沙银行	64,500	503,745.00	0.12
338	600446	金证股份	35,100	502,632.00	0.12
339	600572	康恩贝	99,400	497,000.00	0.12
340	002390	信邦制药	65,300	484,526.00	0.12
341	601118	海南橡胶	91,200	481,536.00	0.12
342	000898	鞍钢股份	127,900	479,625.00	0.12
343	603650	彤程新材	9,500	478,040.00	0.12
344	000877	天山股份	31,200	477,672.00	0.12
345	600811	东方集团	158,500	477,085.00	0.12
346	603228	景旺电	13,801	476,548.53	0.12

		子			
347	000488	晨鸣纸业	65,400	473,496.00	0.12
348	688088	虹软科技	10,744	473,380.64	0.12
349	002440	闰土股份	49,150	471,348.50	0.12
350	002233	塔牌集团	44,501	470,820.58	0.12
351	600808	马钢股份	127,500	470,475.00	0.12
352	002429	兆驰股份	96,800	470,448.00	0.12
353	600329	中新药业	14,900	468,009.00	0.12
354	600259	广晟有色	9,500	467,780.00	0.12
355	002155	湖南黄金	45,000	466,200.00	0.12
356	300166	东方国信	42,493	458,924.40	0.11
357	688321	微芯生物	13,028	456,110.28	0.11
358	600908	无锡银行	79,900	453,033.00	0.11
359	600037	歌华有线	52,000	451,360.00	0.11
360	601200	上海环境	35,850	451,351.50	0.11
361	000559	万向钱潮	70,500	449,085.00	0.11
362	600373	中文传媒	36,300	448,668.00	0.11
363	002085	万丰奥威	81,600	447,984.00	0.11
364	002416	爱施德	39,181	445,879.78	0.11
365	001914	招商积余	22,000	445,720.00	0.11
366	002110	三钢闽光	65,250	443,700.00	0.11
367	600906	财达证券	34,700	442,772.00	0.11
368	600398	海澜之	68,900	441,649.00	0.11

		家			
369	600167	联美控 股	48,880	440,408.80	0.11
370	601000	唐山港	159,330	438,157.50	0.11
371	600026	中远海 能	74,000	438,080.00	0.11
372	600546	山煤国 际	52,900	434,309.00	0.11
373	002081	金螳 螂	71,100	432,288.00	0.11
374	600064	南京高 科	46,140	430,947.60	0.11
375	601991	大唐发 电	132,800	430,272.00	0.11
376	002705	新宝股 份	17,300	427,310.00	0.11
377	600195	中牧股 份	32,649	426,722.43	0.11
378	000528	柳工	55,160	425,283.60	0.11
379	603000	人民网	29,300	422,506.00	0.10
380	000961	中南建 设	101,800	421,452.00	0.10
381	601718	际华集 团	140,700	419,286.00	0.10
382	002867	周大生	23,500	417,830.00	0.10
383	000685	中山公 用	47,100	416,835.00	0.10
384	002038	双鹭药 业	38,348	414,541.88	0.10
385	601611	中国核 建	41,400	412,758.00	0.10
386	000090	天健集 团	70,248	412,355.76	0.10
387	601608	中信重 工	92,400	412,104.00	0.10
388	000158	常山北 明	59,500	411,740.00	0.10
389	300133	华策影 视	60,700	410,939.00	0.10
390	002387	维信诺	44,200	410,176.00	0.10
391	600120	浙江东 方	92,770	410,043.40	0.10

392	000959	首钢股份	71,200	407,976.00	0.10
393	601333	广深铁路	180,500	404,320.00	0.10
394	000758	中色股份	73,200	399,672.00	0.10
395	000089	深圳机场	54,300	397,476.00	0.10
396	600582	天地科技	89,200	390,696.00	0.10
397	600376	首开股份	68,700	388,842.00	0.10
398	003022	联泓新科	10,400	378,976.00	0.09
399	000718	苏宁环球	80,300	378,213.00	0.09
400	601598	中国外运	84,400	378,112.00	0.09
401	002242	九阳股份	16,201	375,863.20	0.09
402	600062	华润双鹤	27,900	373,023.00	0.09
403	601975	招商南油	184,600	371,046.00	0.09
404	600126	杭钢股份	72,320	371,001.60	0.09
405	000967	盈峰环境	50,600	370,898.00	0.09
406	600307	酒钢宏兴	167,100	367,620.00	0.09
407	601098	中南传媒	38,300	366,531.00	0.09
408	000402	金融街	64,300	363,938.00	0.09
409	600556	天下秀	29,300	361,855.00	0.09
410	688289	圣湘生物	6,100	359,900.00	0.09
411	001965	招商公路	46,200	354,354.00	0.09
412	601958	金钼股份	51,600	353,460.00	0.09
413	600959	江苏有线	107,100	352,359.00	0.09

414	002458	益生股份	31,100	351,741.00	0.09
415	600643	爱建集团	51,700	349,492.00	0.09
416	000563	陕国投 A	105,320	340,183.60	0.08
417	600056	中国医药	28,700	338,947.00	0.08
418	002399	海普瑞	19,600	335,160.00	0.08
419	003035	南网能源	40,200	333,258.00	0.08
420	002563	森马服饰	42,900	331,617.00	0.08
421	300257	开山股份	20,701	328,731.88	0.08
422	601928	凤凰传媒	40,600	328,454.00	0.08
423	601860	紫金银行	97,300	325,955.00	0.08
424	600266	城建发展	72,380	325,710.00	0.08
425	600901	江苏租赁	63,800	324,742.00	0.08
426	600717	天津港	77,363	324,150.97	0.08
427	603317	天味食品	11,940	320,111.40	0.08
428	600968	海油发展	108,300	317,319.00	0.08
429	000937	冀中能源	56,700	312,417.00	0.08
430	600095	湘财股份	30,800	311,696.00	0.08
431	002244	滨江集团	66,300	308,958.00	0.08
432	002815	崇达技术	18,300	308,355.00	0.08
433	000717	韶钢松山	64,500	306,375.00	0.08
434	600928	西安银行	70,900	304,870.00	0.08
435	300741	华宝股份	6,300	301,455.00	0.07
436	002423	中粮资	36,900	298,890.00	0.07

		本			
437	002468	申通快 递	32,500	295,425.00	0.07
438	600787	中储股 份	47,100	293,904.00	0.07
439	000028	国药一 致	7,901	292,178.98	0.07
440	000062	深圳华 强	16,940	291,876.20	0.07
441	600006	东风汽 车	42,800	291,468.00	0.07
442	002424	贵州百 灵	38,200	290,320.00	0.07
443	600776	东方通 信	25,200	290,052.00	0.07
444	600649	城投控 股	67,800	278,658.00	0.07
445	600623	华谊集 团	30,400	276,640.00	0.07
446	600835	上海机 电	17,204	273,887.68	0.07
447	600339	中油工 程	88,600	272,888.00	0.07
448	600729	重庆百 货	10,401	270,634.02	0.07
449	600648	外高桥	20,300	268,569.00	0.07
450	002375	亚厦股 份	35,800	268,142.00	0.07
451	601139	深圳燃 气	30,300	267,549.00	0.07
452	601969	海南矿 业	22,200	266,622.00	0.07
453	600299	安迪苏	21,500	264,880.00	0.07
454	000031	大悦城	68,500	255,505.00	0.06
455	000156	华数传 媒	29,800	252,108.00	0.06
456	300869	康泰医 学	6,200	251,410.00	0.06
457	600871	石化油 服	110,600	236,684.00	0.06
458	002653	海思科	11,300	230,520.00	0.06
459	000869	张裕 A	7,200	229,392.00	0.06

460	600377	宁沪高速	26,600	229,292.00	0.06
461	600639	浦东金桥	17,700	226,029.00	0.06
462	002302	西部建设	27,700	222,431.00	0.06
463	601228	广州港	66,300	220,779.00	0.05
464	603379	三美股份	9,600	218,688.00	0.05
465	601828	美凯龙	24,800	218,488.00	0.05
466	601869	长飞光纤	6,600	216,084.00	0.05
467	601298	青岛港	37,700	214,513.00	0.05
468	603708	家家悦	12,800	212,992.00	0.05
469	000046	泛海控股	110,000	206,800.00	0.05
470	002948	青岛银行	44,100	204,183.00	0.05
471	001872	招商港口	11,900	201,705.00	0.05
472	600823	世茂股份	60,100	197,128.00	0.05
473	601156	东航物流	9,000	196,920.00	0.05
474	002945	华林证券	14,100	192,606.00	0.05
475	000553	安道麦 A	22,700	191,588.00	0.05
476	603786	科博达	2,300	184,690.00	0.05
477	601568	北元集团	22,600	183,738.00	0.05
478	001203	大中矿业	12,000	180,960.00	0.04
479	603355	莱克电气	5,942	174,219.44	0.04
480	603719	良品铺子	4,100	174,127.00	0.04
481	600350	山东高速	33,500	172,860.00	0.04
482	603056	德邦股份	16,801	171,874.23	0.04
483	600657	信达地产	45,900	171,207.00	0.04
484	603515	欧普照	8,150	169,194.00	0.04

		明			
485	600466	蓝光发展	80,040	163,281.60	0.04
486	601665	齐鲁银行	26,600	148,428.00	0.04
487	600917	重庆燃气	16,902	141,807.78	0.04
488	601003	柳钢股份	26,900	140,418.00	0.03
489	002946	新乳业	8,800	140,272.00	0.03
490	002901	大博医疗	2,500	126,550.00	0.03
491	600956	新天绿能	7,233	124,479.93	0.03
492	600903	贵州燃气	12,400	120,032.00	0.03
493	603868	飞科电器	2,500	108,550.00	0.03
494	601187	厦门银行	15,300	105,570.00	0.03
495	603983	丸美股份	2,700	86,049.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688707	振华新材	7,127	336,109.32	0.08
2	688711	宏微科技	1,572	183,169.44	0.05
3	688167	炬光科技	978	172,783.26	0.04
4	688262	国芯科技	3,244	136,183.12	0.03
5	301092	争光股份	2,731	105,088.65	0.03
6	301093	华兰股份	1,962	101,953.45	0.03
7	688509	正元地信	15,433	95,221.61	0.02
8	301062	上海艾录	5,125	91,870.29	0.02
9	301052	果麦文化	2,520	89,331.48	0.02
10	301098	金埔园林	3,069	84,970.79	0.02
11	688553	汇宇制药	2,499	80,242.89	0.02
12	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.02
13	301072	中捷精工	1,802	67,726.26	0.02

14	301063	海锅股份	1,524	59,268.03	0.01
15	300854	中兰环保	2,026	58,735.01	0.01
16	301053	远信工业	1,544	45,992.00	0.01
17	301079	邵阳液压	1,396	43,352.80	0.01
18	301057	汇隆新材	2,173	42,953.11	0.01
19	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
20	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
21	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
22	300994	久祺股份	407	18,498.15	0.00
23	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
24	301039	中集车辆	1,115	13,948.65	0.00
25	301015	百洋医药	459	13,907.70	0.00
26	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
27	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
28	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
29	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
30	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
31	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
32	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
33	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
34	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
35	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
36	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
37	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
38	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
39	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
40	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
41	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
42	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
43	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
44	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
45	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
46	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
47	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000799	酒鬼酒	3,264,216.00	0.96

2	600522	中天科技	2,507,860.00	0.73
3	000733	振华科技	2,109,249.00	0.62
4	600399	抚顺特钢	1,974,002.69	0.58
5	600089	特变电工	1,953,549.00	0.57
6	002384	东山精密	1,917,171.00	0.56
7	002340	格林美	1,903,569.05	0.56
8	300751	迈为股份	1,899,204.00	0.56
9	601636	旗滨集团	1,875,373.00	0.55
10	605358	立昂微	1,855,540.00	0.54
11	002709	天赐材料	1,829,975.00	0.54
12	601555	东吴证券	1,816,107.80	0.53
13	601868	中国能建	1,789,010.00	0.52
14	300037	新宙邦	1,748,540.00	0.51
15	688005	容百科技	1,736,543.53	0.51
16	300274	阳光电源	1,719,173.92	0.50
17	300253	卫宁健康	1,711,152.00	0.50
18	600298	安琪酵母	1,666,363.00	0.49
19	300363	博腾股份	1,647,514.40	0.48
20	603456	九洲药业	1,583,662.00	0.46

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300274	阳光电源	6,850,471.31	2.00
2	600089	特变电工	6,182,226.05	1.81
3	002709	天赐材料	5,226,889.16	1.53
4	002074	国轩高科	4,633,408.00	1.36
5	300207	欣旺达	3,901,672.00	1.14
6	300012	华测检测	3,796,522.00	1.11
7	600460	士兰微	3,626,902.00	1.06
8	300316	晶盛机电	3,475,706.00	1.02
9	600426	华鲁恒升	3,347,539.14	0.98
10	000799	酒鬼酒	3,247,427.00	0.95
11	601233	桐昆股份	2,997,540.00	0.88
12	603486	科沃斯	2,888,916.40	0.85
13	300496	中科创达	2,874,652.65	0.84
14	600219	南山铝业	2,754,523.00	0.81
15	300595	欧普康视	2,747,396.00	0.80
16	603882	金域医学	2,693,754.00	0.79

17	600132	重庆啤酒	2,564,238.51	0.75
18	600143	金发科技	2,558,707.40	0.75
19	002625	光启技术	2,476,505.62	0.72
20	603806	福斯特	2,209,761.08	0.65

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。

8.4.3 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	309,086,084.23
卖出股票收入（成交）总额	310,436,392.81

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	110,033.00	0.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	28,514.20	0.01
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	138,547.20	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21 国债 06	1,100	110,033.00	0.03
2	113633	科沃转债	220	28,514.20	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2206	IC2206	7.00	10,006,920.00	160,840.00	
公允价值变动总额合计					160,840.00
股指期货投资本期收益					2,317,436.89
股指期货投资本期公允价值变动					57,720.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等,以降低交易成本和组合风险,提高投资效率。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,浙江争光实业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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,666,597.68

2	应收证券清算款		-
3	应收股利		-
4	应收利息		20,747.72
5	应收申购款		2,151,364.56
6	其他应收款		-
7	待摊费用		-
8	其他		-
9	合计		3,838,709.96

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000723	美锦能源	655,692.00	0.16	转融通出借流通受限
2	601615	明阳智能	623,790.00	0.15	转融通出借流通受限
3	600522	中天科技	317,152.00	0.08	转融通出借流通受限

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688707	振华新材	336,109.32	0.08	新股流通受限
2	688711	宏微科技	183,169.44	0.05	新股流通受限
3	688167	炬光科技	172,783.26	0.04	新股流通受限
4	688262	国芯科技	136,183.12	0.03	新股流通受限
5	301092	争光股份	9,732.48	0.00	新股流通受限

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
汇添富中证 500 指数 (LOF) A	18,828	10,766.93	10,030,710.10	4.95	192,688,960.37	95.05
汇添富中证 500 指数 (LOF) C	25,043	4,197.57	11,937.20	0.01	105,107,836.26	99.99
合计	43,871	7,016.92	10,042,647.30	3.26	297,796,796.63	96.74

9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	张婷	1,139,480.00	13.66
2	高倩	198,824.00	2.38
3	钟爱民	166,061.00	1.99
4	杨波	141,681.00	1.70
5	高明英	137,684.00	1.65
6	余建萍	127,722.00	1.53
7	王轶轮	104,512.00	1.25
8	王正旺	102,600.00	1.23
9	李峰	101,125.00	1.21
10	闫丽京	99,412.00	1.19
10	陈靖	99,412.00	1.19
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	玉志	1,326,173.00	26.17
2	王伟鹏	270,763.00	5.34

3	樊孝鹏	203,656.00	4.02
4	虞永金	200,117.00	3.95
5	赵丽妹	200,018.00	3.95
6	顾奔驰	198,018.00	3.91
7	于文华	150,175.00	2.96
8	欧阳东	150,000.00	2.96
9	任小疆	128,716.00	2.54
10	王建伟	106,572.00	2.10

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	557,982.18	0.28
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	628.68	0.00
	合计	558,610.86	0.18

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,002,700.27 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 08 月 10 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份额总额	188,653,666.27	125,199,637.52
本报告期基金总申购份额	275,699,420.58	489,134,334.77
减: 本报告期基金总赎回份额	261,633,416.38	509,214,198.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	202,719,670.47	105,119,773.46

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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, 本基金基金管理人未发生重大人事变动。

2021 年 5 月 4 日, 本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强、张志斌任托管部副总经理。

11.3 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。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 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 (2017 年 08 月 10 日) 起至本报告期末, 为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币 80,000.00 元。

11.6 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，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
招商证券	2	607,953,137.49	100.00	528,702.12	100.00	

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

11.7.2 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 (%)
招商证券	17,752,362.92	100.00	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

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

超过总成交量的 30%。

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

11.8 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, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 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, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 03 月 30 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 03 月 31 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金修订的招募说明书、基金产品资料概要	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 04 月 02 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 04 月 22 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基	2021 年 06 月 24 日

		金电子披露网站, 深交所	
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 07 月 21 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于获准设立子公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 08 月 26 日
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年中期报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 08 月 31 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于变更直销中心银行账户信息的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 09 月 16 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于本公司及上海分公司办公地址变更的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 10 月 09 日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 10 月 27 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行首次申购和追加申购起点金额的公告	中证报, 上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 11 月 02 日
15	关于汇添富基金管理股份有限公司投顾业务中通过投资者投顾账户交易本公司旗下基金免除相关费用的公告	上交所, 上证报, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	2021 年 12 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 募集的文件；
- 2、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

13.3 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

2022 年 03 月 31 日