

# 汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证 券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行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 02 月 01 日（基金合同生效日）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 .....	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、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 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
§ 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 .....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	14
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 .....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	18
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 .....	19
§ 5 托管人报告 .....	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	19
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 .....	19
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 .....	19
§ 6 审计报告 .....	19
6.1 审计报告的基本信息 .....	19
6.2 审计报告的基本内容 .....	19
§ 7 年度财务报表 .....	21
7.1 资产负债表 .....	21
7.2 利润表 .....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	24
7.4 报表附注 .....	24
§ 8 投资组合报告 .....	58
8.1 期末基金资产组合情况 .....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	59
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 .....	60

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76
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.....	76
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.....	76
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.....	76
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.....	76
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	77
8.12 投资组合报告附注.....	77
§ 9 基金份额持有人信息 .....	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	78
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	79
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.....	79
§ 10 开放式基金份额变动 .....	79
§ 11 重大事件揭示 .....	80
11.1 基金份额持有人大会决议.....	80
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.....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
11.4 基金投资策略的改变.....	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
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.....	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	80
11.8 其他重大事件.....	85
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
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.....	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
§ 13 备查文件目录 .....	88
13.1 备查文件目录.....	88
13.2 存放地点 .....	88
13.3 查阅方式 .....	88

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证沪港深 500ETF
场内简称	HGS500
基金主代码	517080
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 02 月 01 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	777,166,000.00
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	2021 年 02 月 22 日

注：扩位证券简称：沪港深 500ETF 基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。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%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
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。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工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
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	李文	陈四清

## 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 期间数据和指标	2021年02月01日（基金合同生效日）-2021年12月31日
本期已实现收益	-21,974,134.03
本期利润	-122,075,341.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1260
本期加权平均净值利润率	-13.67%
本期基金份额净值增长率	-12.75%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末
期末可供分配利润	-99,102,835.97
期末可供分配基金份额利润	-0.1275
期末基金资产净值	678,063,164.03
期末基金份额净值	0.8725

3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-12.75%

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 01 日，至本报告期末未满一年，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 12 月 31 日数据，特此说明。

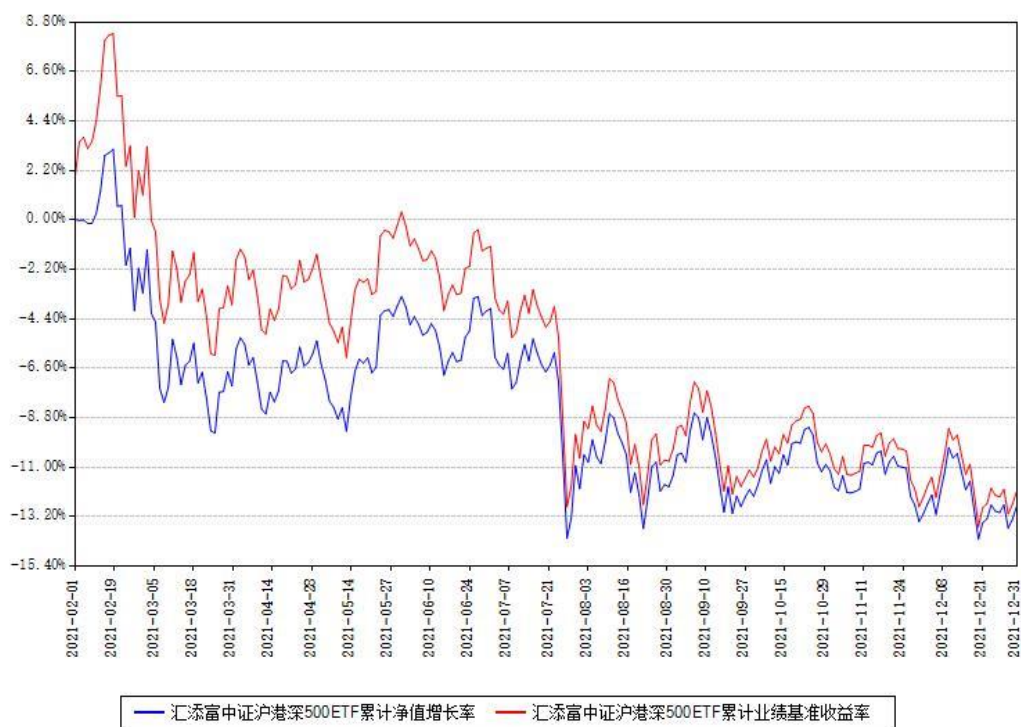
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	-1.09%	0.74%	-1.16%	0.76%	0.07%	-0.02%
过去六个月	-9.07%	1.02%	-10.95%	1.06%	1.88%	-0.04%
自基金合同生效日起至今	-12.75%	1.05%	-12.07%	1.13%	-0.68%	-0.08%

#### 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

汇添富中证沪港深500ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



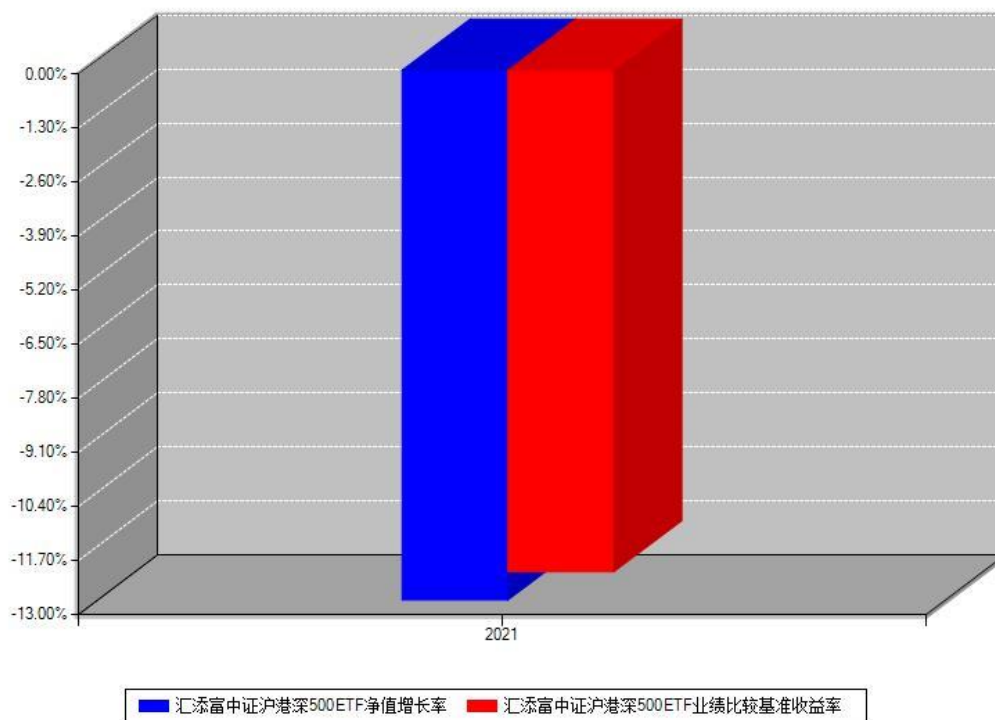
注：1、本《基金合同》生效之日为 2021 年 02 月 01 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

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，本基金已完成建仓，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



汇添富中证沪港深500ETF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2021年02月01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《基金合同》生效之日为2021年02月01日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

## § 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，汇添富基金继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。在应急救援灾方面，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		
董瑾	本基金的基金经理	2021年02月01日		12	国籍：中国。学历：北京大学西方经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010年8月至2012年12月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012年12月至2015年9月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015年9月至2016年10月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016年11月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017年12月18日至2019年12月31日任汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017年12月18日至2019年12月31日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017年12月18日至2019

					<p>年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 9 日至今任汇添富中证光伏产业交易型开</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 11 日至今任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 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、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内的公平交易模块，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

2021 年全年我国经济持续稳定恢复,GDP 比上年增长 8.1%,完成了全年 6%以上的预期目标,两年平均增长 5.1%。全年来看,制造业恢复较为强劲;外需亦有较大贡献;消费和服务业整体表现平稳,下半年有修复趋势;而地产仍有拖累。四季度经济两年平均增长率比三季度有所提高,反映了经济运行总体平稳。随着宏观政策跨周期调节扎实推进,保供稳价和助企纾困力度加大,国民经济继续恢复,实体经济稳中有升。

权益市场方面,全年整体以震荡行情为主,而结构分化明显,风格上偏中小盘成长风格。行业方面,双碳目标下新能源的大发展是一条贯穿全年的投资主线。一方面政策较为支持,另一方面相关产业链也进入了快速增长和业绩验证的阶段,因此获得了市场的较多关注。下半年受能源紧缺和大宗商品涨价影响,传统能源板块也有所表现。其他市场主要板块来看,科技主题中半导体产业受缺芯影响行业景气度较高,而消费、医药和互联网板块由于受到疫情和政策等方面的影响,出现了较大幅度的调整。

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

本基金本报告期基金份额净值增长率为-12.75%。同期业绩比较基准收益率为-12.07%。

#### 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,全球疫情仍在持续演变,外部环境不确定性仍在。受益于稳增长和流动性宽松的各项政策,经济形势可能趋于稳健。2022 年经济或将延续复苏态势,消费、基建投资等或成为主要拉动力量。

政策和流动性方面,2021 年以来,由于经济复苏与通胀抬升并行,海外主要国家央行纷纷进行货币政策正常化,对货币政策采取收紧态度。而国内政策强调以我为主,稳字当头。



2021 年四季度召开了政治局会议和中央经济工作会议，明确了稳增长的基调，强调以经济建设为中心，保持经济在合理区间。2022 年货币政策预计稳中带松，财政政策或将进一步发力，适度超前开展基础设施投资，有助于托底经济。

权益市场方面，在稳增长的带动下，各个板块都具有一定的投资逻辑，整体风格可能更加均衡。新能源相关板块大概率仍将维持较高速度的增长。消费和医药板块估值调整较为充分，当前盈利改善，具备一定的配置价值。同时稳增长和流动性宽松也对大金融板块形成利好，可以适当关注银行和券商的投资机会。

港股来说，互联网企业经历了较大程度的调整，港股科技股的估值已经回到较为合理的区间，科技股仍然是港股市场最具特色的资产，在后续监管合规要求逐步落地实施后，具备长期的配置价值。

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历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

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

## 4.8 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：《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期

增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 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_B175 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	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021

	<p>年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金，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>汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</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</p>

	<p>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，根据获取的审计证据，就可能对汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</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：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	41,645,701.38
结算备付金		6,519,378.63
存出保证金		2,863,212.75

交易性金融资产	7.4.7.2	627,301,640.11
其中：股票投资		626,737,640.11
基金投资		-
债券投资		564,000.00
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		73,034.88
应收利息	7.4.7.5	6,785.15
应收股利		44,679.11
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		678,454,432.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日
<b>负 债：</b>		
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		53.25
应付赎回款		-
应付管理人报酬		87,243.40
应付托管费		29,081.13
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	107,379.98
应交税费		17,510.22
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	150,000.00
负债合计		391,267.98
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	777,166,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-99,102,835.97
所有者权益合计		678,063,164.03
负债和所有者权益总计		678,454,432.01

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8725 元，基金份额总额 777,166,000.00 份。

2、本基金合同于 2021 年 02 月 01 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2021

年 12 月 31 日数据，特此说明。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 02 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 02 月 01 日（基金合同生 效日）至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>-117,586,480.34</b>
1. 利息收入		679,273.44
其中：存款利息收入	7.4.7.11	679,088.33
债券利息收入		185.11
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,898,199.71
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-34,717,340.55
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	295,154.54
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	851,370.60
股利收益	7.4.7.17	14,672,615.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-100,101,207.14
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	733,653.07
<b>减：二、费用</b>		<b>4,488,860.83</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,227,460.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	409,153.45
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.20	2,698,373.84
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3,065.24
7. 其他费用	7.4.7.21	150,808.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-122,075,341.17</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-122,075,341.17</b>

注：本基金合同于 2021 年 02 月 01 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）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）	1,089,166,000.00	-	1,089,166,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-122,075,341.17	-122,075,341.17
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）	-312,000,000.00	22,972,505.20	-289,027,494.80
其中：1. 基金申购款	208,000,000.00	-10,061,344.45	197,938,655.55
2. 基金赎回款	-520,000,000.00	33,033,849.65	-486,966,150.35
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）	777,166,000.00	-99,102,835.97	678,063,164.03

注：本基金合同于 2021 年 02 月 01 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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

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

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（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”）[2020]3528 号《关于准予汇添富中证沪



港深 500 交易型开放式指数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自 2021 年 1 月 20 日至 2021 年 1 月 26 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\_B19 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 1 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的净认购金额为人民币 1,089,166,000.00 元，折合 1,089,166,000.00 份基金份额；在募集期间产生的利息为人民币 298,121.09 元，均计入基金财产，不折算为投资者基金份额；以上有效认购资金合计为人民币 1,089,464,121.09 元，折合 1,089,166,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、中小板、创业板、存托凭证及其他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、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、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相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为：中证沪港深 500 指数收益率。

#### 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 02 月 01 日（基金合同生效日）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。本期财务报表的实际编制期间系 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 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等，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；

股指期货/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货/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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金的收益分配采用现金分红；

(3) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

(4) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

### 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。

#### 7.4.6.6 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。

#### 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
活期存款	41,645,701.38
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	41,645,701.38

##### 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	726,705,347.25	626,737,640.11	-99,967,707.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	564,000.00	564,000.00
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	564,000.00	564,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	727,269,347.25	627,301,640.11	-99,967,707.14

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末			备注
	2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		
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	23,839,860.00	-	-	-
（股指期货投资）	23,839,860.00			

(权证)	-			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,839,860.00	-	-	-

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
IF2203	10	14,739,060.00	14,851,800.00	112,740.00
IF2206	6	9,100,800.00	8,854,560.00	-246,240.00
总额合计:			-133,500.00	
减:可抵销期货暂收款			-133,500.00	
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
应收活期存款利息	4,068.67
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	2,695.82
应收债券利息	12.36
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	8.30
合计	6,785.15

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
交易所市场应付交易费用	107,379.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	107,379.98

## 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付审计费	80,000.00
应付信息披露费	70,000.00
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	150,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2021年02月01日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,089,166,000.00	1,089,166,000.00
本期申购	208,000,000.00	208,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-520,000,000.00	-520,000,000.00
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	777,166,000.00	777,166,000.00

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 01 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 1,089,166,000.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 0.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,089,166,000.00 元，折合 1,089,166,000.00 份基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-21,974,134.03	-100,101,207.14	-122,075,341.17
本期基金份额交易产生的变动数	2,288,539.54	20,683,965.66	22,972,505.20
其中：基金申购款	-161,727.84	-9,899,616.61	-10,061,344.45
基金赎回款	2,450,267.38	30,583,582.27	33,033,849.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,685,594.49	-79,417,241.48	-99,102,835.97

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	579,843.93
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	86,220.51
其他	13,023.89
合计	679,088.33

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——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-24,780,895.86
股票投资收益——赎回差价收入	-9,936,444.69
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-34,717,340.55

#### 7.4.7.12.2 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 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	409,503,847.65
减：卖出股票成本总额	434,284,743.51
买卖股票差价收入	-24,780,895.86

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	486,966,150.35
减：现金支付赎回款总额	322,687,243.35
减：赎回股票成本总额	174,215,351.69
赎回差价收入	-9,936,444.69

#### 7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 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
	2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,649,029.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,353,700.00
减：应收利息总额	175.40
买卖债券差价收入	295,154.54

##### 7.4.7.14.2 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。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
卖出权证成交总额	14,678.72
减：卖出权证成本总额	13,407.00
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	37.04
买卖权证差价收入	1,234.68

#### 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 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	850,135.92
外汇期货投资收益	-
国债期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	14,672,615.70
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	14,672,615.70

#### 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 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-99,967,707.14
——股票投资	-99,967,707.14
——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	-133,500.00
——权证投资	-
——期货投资	-133,500.00
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-100,101,207.14

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年02月01日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	733,653.07
其他	-
合计	733,653.07

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年02月01日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	2,698,373.84
银行间市场交易费用	-
合计	2,698,373.84

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年02月01日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	70,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	408.00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	400.00
上市费	-
其他	-
合计	150,808.00

#### 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
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东
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 02 月 01 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	816,968,439.71	48.63

##### 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 02 月 01 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	70,492.69	4.27

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期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 02 月 01 日（基金合同生效日）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（%）
东方证券	698,423.73	49.36	-	-

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 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,227,460.30
其中：支付销售机构的客户维护费	-

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	409,153.45

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 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：本基金本报告期末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

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。

##### 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。

#### 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自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自有资金投资本基金。

##### 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：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

#### 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

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	41,645,701.38	579,843.93

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	002142	宁波银行	原股东优先配售	6,200.00	123,814.00

#### 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

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券（及基金托管人工商银行发行的股票工商银行）。

于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 67,300 股，持有工商银行 2,028,900 股。

##### 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	2022 年 02 月	新股流通	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	

		26 日	16 日	受 限						
300814	中富 电路	2021 年 08 月 04 日	2022 年 02 月 14 日	新 股 流 通 受 限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	
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	420	4,998.00	19,089.00	
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	浩通科技	2021年07月08日	2022年01月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19
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
301041	金百	2021年	2022年	新股	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15

	泽	08 月 02 日	02 月 11 日	流 通 受 限						
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	
301058	中 粮 工 科	2021 年 09 月	2022 年 03 月	新 股 流 通	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	

		01 日	09 日	受 限						
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	君亭酒店	2021 年 09 月 22 日	2022 年 03 月 30 日	新 股 流 通 受 限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	
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	
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年04月27日	新股流通受限	15.48	21.53	534	8,266.32	11,497.02	
688511	天微电子	2021年07月22日	2022年02月07日	新股流通受限	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	
688622	禾信仪器	2021年09月03日	2022年03月14日	新股流通受限	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	
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	8,130	95,527.50	383,410.80	
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	1,865	51,306.15	217,309.80	

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
113052	兴	2021	2022	新	100.00	100.00	5,640	564,000.00	564,000.00	

	业 转 债	年 12 月 28 日	年 01 月 14 日	债 流 通 受 限						
7.4.12.1.3 受限证券类别：权证										
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
02997	新 城 发 展 股 权	2021 年 12 月 23 日	2022 年 01 月 07 日	权 证 流 通 受 限	-	-	-	-	-	

#### 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
01114	BRILLIANCE CHI	2021 年 03 月 31 日	重 大 事 项 停 牌	5.97		-	100,000	582,525.04	596,848.00	

#### 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

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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；本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、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	41,645,701.38	-	-	-	-	-	41,645,701.38
结算备付金	6,519,378.63	-	-	-	-	-	6,519,378.63

存出保证金	18,449.55	-	-	-	-	2,844,763.20	2,863,212.75
交易性金融资产	-	-	564,000.00	-	-	626,737,640.11	627,301,640.11
应收股利	-	-	-	-	-	44,679.11	44,679.11
应收利息	-	-	-	-	-	6,785.15	6,785.15
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	73,034.88	73,034.88
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	48,183,529.56	-	564,000.00	-	-	629,706,902.45	678,454,432.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	87,243.40	87,243.40
应付托管费	-	-	-	-	-	29,081.13	29,081.13
应付证券清算款	-	-	-	-	-	53.25	53.25

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	107,379.98	107,379.98
应交税费	-	-	-	-	-	17,510.22	17,510.22
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	391,267.98	391,267.98
利率敏感度缺口	48,183,529.56	-	564,000.00	-	-	629,315,634.47	678,063,164.03

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

注：本基金本报告期末未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	246,439,693.66	-	246,439,693.66
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	-	44,679.11	-	44,679.11
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	-	246,484,372.77	-	246,484,372.77
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	-	-	-	-
资产负债表外外汇风险敞口净额	-	246,484,372.77	-	246,484,372.77

#### 7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	12,324,218.64
	港币相对人民币贬值 5%	-12,324,218.64

#### 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交易的股票和债券，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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	626,737,640.11	92.43
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	564,000.00	0.08
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	627,301,640.11	92.51

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

#### 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
	中证沪港深 500 上涨 5%	31,040,653.07
	中证沪港深 500 下跌 5%	-31,040,653.07

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 625,081,618.31 元，属于第二层次的余额为人民币 569,504.49 元，属于第三层次的余额为人民币 1,650.517.31 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 1,650.517.31 元，均为本期新增。

#### 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	626,737,640.11	92.38
	其中：股票	626,737,640.11	92.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	564,000.00	0.08
	其中：债券	564,000.00	0.08
	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	48,165,080.01	7.10
8	其他各项资产	2,987,711.89	0.44
9	合计	678,454,432.01	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 246,439,693.66 元,占期末净值比例为 36.34%。

## 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	3,890,904.40	0.57
B	采矿业	7,744,879.00	1.14
C	制造业	227,132,334.26	33.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,456,481.00	1.25
E	建筑业	6,572,226.70	0.97
F	批发和零售业	1,961,171.20	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	9,463,465.00	1.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,410,473.60	1.98
J	金融业	78,420,021.88	11.57
K	房地产业	6,481,545.20	0.96
L	租赁和商务服务业	4,779,707.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	5,965,215.80	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	234,228.00	0.03
Q	卫生和社会工作	3,408,933.76	0.50
R	文化、体育和娱乐业	1,291,801.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	379,213,387.80	55.93

### 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	962,681.31	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	24,681.09	0.00
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	-	-

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	49,630.82	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.00
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	16,891.92	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,084,558.65	0.16

### 8.2.3 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	5,114,259.70	0.75
15 原材料	2,917,789.55	0.43
20 工业	11,983,064.47	1.77
25 可选消费	39,930,556.28	5.89
30 日常消费	12,106,268.61	1.79
35 医疗保健	12,245,814.94	1.81
40 金融	72,218,583.48	10.65
45 信息技术	13,349,458.02	1.97
50 电信服务	49,192,539.20	7.25
55 公用事业	9,902,352.59	1.46
60 房地产	17,479,006.82	2.58
合计	246,439,693.66	36.34

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。

### 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	00700	腾讯控股	113,400	42,352,595.71	6.25

2	600519	贵州茅台	10,100	20,705,000.00	3.05
3	03690	美团-W	103,400	19,055,279.94	2.81
4	601318	中国平安	174,600	8,801,586.00	1.30
4	02318	中国平安	126,000	5,784,438.24	0.85
5	600036	招商银行	199,500	9,717,645.00	1.43
5	03968	招商银行	77,500	3,836,690.20	0.57
6	00005	汇丰控股	348,400	13,359,551.30	1.97
7	300750	宁德时代	22,500	13,230,000.00	1.95
8	01299	友邦保险	204,000	13,109,725.44	1.93
9	00939	建设银行	2,028,000	8,953,701.12	1.32
9	601939	建设银行	108,200	634,052.00	0.09
10	00388	香港交易所	21,400	7,967,969.86	1.18
11	01398	工商银行	1,464,000	5,266,652.16	0.78
11	601398	工商银行	564,900	2,615,487.00	0.39
12	002594	比亚迪	14,600	3,914,552.00	0.58
12	01211	比亚迪股份	15,000	3,269,582.40	0.48
13	000858	五粮液	31,299	6,969,035.34	1.03
14	601012	隆基股份	69,779	6,014,949.80	0.89
15	000333	美的集团	78,800	5,816,228.00	0.86
16	02269	药明生物	71,500	5,410,324.92	0.80
17	300059	东方财富	133,260	4,945,278.60	0.73
18	01810	小米集团-W	295,000	4,558,528.80	0.67
19	601166	兴业银行	234,400	4,462,976.00	0.66
20	03988	中国银行	1,411,000	3,241,710.42	0.48
20	601988	中国银行	339,700	1,036,085.00	0.15
21	600030	中信证券	137,300	3,626,093.00	0.53
21	06030	中信证券	38,500	640,569.16	0.09
22	600900	长江电力	186,200	4,226,740.00	0.62
23	00941	中国移动	103,500	3,960,290.88	0.58
24	002415	海康威视	75,300	3,939,696.00	0.58
25	00669	创科实业	31,000	3,933,637.12	0.58
26	603259	药明康德	33,060	3,920,254.80	0.58
27	002475	立讯精密	79,500	3,911,400.00	0.58
28	600276	恒瑞医药	72,200	3,661,262.00	0.54
29	601888	中国中免	15,700	3,444,737.00	0.51
30	600887	伊利股份	82,800	3,432,888.00	0.51
31	688981	中芯国际	31,200	1,653,288.00	0.24
31	00981	中芯国际	100,500	1,533,269.81	0.23
32	601328	交通银行	442,800	2,041,308.00	0.30
32	03328	交通银行	295,000	1,136,014.32	0.17
33	600690	海尔智家	61,100	1,826,279.00	0.27
33	06690	海尔智家	47,600	1,282,340.19	0.19

34	02331	李宁	44,500	3,105,306.12	0.46
35	300760	迈瑞医疗	7,900	3,008,320.00	0.44
36	601899	紫金矿业	232,300	2,253,310.00	0.33
36	02899	紫金矿业	98,000	743,558.14	0.11
37	000568	泸州老窖	11,800	2,995,666.00	0.44
38	000651	格力电器	76,300	2,825,389.00	0.42
39	601288	农业银行	566,000	1,664,040.00	0.25
39	01288	农业银行	518,000	1,135,025.02	0.17
40	000002	万科A	109,700	2,167,672.00	0.32
40	02202	万科企业	32,100	476,083.57	0.07
41	603501	韦尔股份	8,400	2,610,468.00	0.38
42	02382	舜宇光学科技	12,900	2,600,900.06	0.38
43	000001	平安银行	156,400	2,577,472.00	0.38
44	600309	万华化学	25,300	2,555,300.00	0.38
45	09633	农夫山泉	59,400	2,498,691.89	0.37
46	600809	山西汾酒	7,820	2,469,399.60	0.36
47	300274	阳光电源	16,800	2,449,440.00	0.36
48	002142	宁波银行	63,900	2,446,092.00	0.36
49	000725	京东方A	483,700	2,442,685.00	0.36
50	601601	中国太保	55,200	1,497,024.00	0.22
50	02601	中国太保	46,800	809,276.83	0.12
51	002714	牧原股份	42,440	2,264,598.40	0.33
52	600585	海螺水泥	38,700	1,559,610.00	0.23
52	00914	海螺水泥	22,000	700,601.44	0.10
53	00002	中电控股	34,500	2,221,317.00	0.33
54	00386	中国石油化工股份	430,000	1,276,191.84	0.19
54	600028	中国石化	215,600	911,988.00	0.13
55	600031	三一重工	95,900	2,186,520.00	0.32
56	02020	安踏体育	22,800	2,179,165.63	0.32
57	002352	顺丰控股	31,600	2,177,872.00	0.32
58	300014	亿纬锂能	18,300	2,162,694.00	0.32
59	002812	恩捷股份	8,600	2,153,440.00	0.32
60	600436	片仔癀	4,900	2,142,035.00	0.32
61	603288	海天味业	20,360	2,140,039.60	0.32
62	02628	中国人寿	125,000	1,320,424.00	0.19
62	601628	中国人寿	26,800	806,412.00	0.12
63	02333	长城汽车	52,000	1,139,407.36	0.17
63	601633	长城汽车	19,800	961,092.00	0.14
64	002241	歌尔股份	38,600	2,088,260.00	0.31
65	601088	中国神华	53,200	1,198,064.00	0.18
65	01088	中国神华	57,000	851,906.50	0.13

66	300124	汇川技术	29,550	2,027,130.00	0.30
67	00883	中国海洋石油	301,000	1,976,163.73	0.29
68	600438	通威股份	43,600	1,960,256.00	0.29
69	02319	蒙牛乳业	53,000	1,915,309.76	0.28
70	600837	海通证券	155,600	1,907,656.00	0.28
71	601919	中远海控	102,000	1,906,380.00	0.28
72	00016	新鸿基地产	24,500	1,894,951.52	0.28
73	06160	百济神州	14,300	1,882,360.48	0.28
74	00003	香港中华煤气	188,700	1,872,972.80	0.28
75	00001	长和	45,500	1,871,200.24	0.28
76	02313	申洲国际	15,200	1,862,885.25	0.27
77	300015	爱尔眼科	43,642	1,845,183.76	0.27
78	002460	赣锋锂业	12,900	1,842,765.00	0.27
79	600048	保利发展	115,700	1,808,391.00	0.27
80	01658	邮储银行	201,000	898,926.67	0.13
80	601658	邮储银行	175,300	894,030.00	0.13
81	600406	国电南瑞	44,660	1,787,739.80	0.26
82	00857	中国石油股份	356,000	1,009,997.63	0.15
82	601857	中国石油	156,600	768,906.00	0.11
83	603799	华友钴业	15,700	1,731,867.00	0.26
84	00175	吉利汽车	99,000	1,724,073.12	0.25
85	000063	中兴通讯	51,200	1,715,200.00	0.25
86	601668	中国建筑	338,100	1,690,500.00	0.25
87	01024	快手-W	28,000	1,649,426.24	0.24
88	600000	浦发银行	189,200	1,613,876.00	0.24
89	01109	华润置地	60,000	1,609,036.80	0.24
90	600111	北方稀土	35,100	1,607,580.00	0.24
91	300122	智飞生物	12,900	1,607,340.00	0.24
92	002304	洋河股份	9,700	1,597,881.00	0.24
93	02688	新奥能源	13,300	1,596,314.94	0.24
94	600016	民生银行	400,100	1,560,390.00	0.23
95	002230	科大讯飞	29,600	1,554,296.00	0.23
96	600104	上汽集团	75,300	1,553,439.00	0.23
97	002049	紫光国微	6,900	1,552,500.00	0.23
98	600745	闻泰科技	12,000	1,551,600.00	0.23
99	601816	京沪高铁	316,600	1,529,178.00	0.23
100	603986	兆易创新	8,680	1,526,378.00	0.23
101	002129	中环股份	36,500	1,523,875.00	0.22
102	00011	恒生银行	12,900	1,505,062.61	0.22
103	002271	东方雨虹	28,450	1,498,746.00	0.22

104	002371	北方华创	4,300	1,492,186.00	0.22
105	01113	长实集团	37,000	1,486,846.48	0.22
106	02388	中银香港	71,000	1,483,167.28	0.22
107	601688	华泰证券	83,000	1,474,080.00	0.22
108	00291	华润啤酒	28,000	1,461,705.28	0.22
109	300142	沃森生物	25,300	1,421,860.00	0.21
110	000661	长春高新	5,200	1,411,280.00	0.21
111	000100	TCL 科技	226,100	1,395,037.00	0.21
112	300498	温氏股份	71,700	1,380,942.00	0.20
113	000338	潍柴动力	76,600	1,370,374.00	0.20
114	600893	航发动力	21,500	1,364,390.00	0.20
115	002027	分众传媒	163,000	1,334,970.00	0.20
116	300450	先导智能	17,640	1,311,886.80	0.19
117	601211	国泰君安	72,700	1,300,603.00	0.19
118	06098	碧桂园服务	34,000	1,298,185.28	0.19
119	600089	特变电工	61,100	1,293,487.00	0.19
120	300782	卓胜微	3,760	1,228,768.00	0.18
121	00027	银河娱乐	37,000	1,222,148.48	0.18
122	601766	中国中车	196,100	1,194,249.00	0.18
123	600050	中国联通	299,700	1,177,821.00	0.17
124	600570	恒生电子	18,900	1,174,635.00	0.17
125	000776	广发证券	47,700	1,172,943.00	0.17
126	601229	上海银行	160,300	1,142,939.00	0.17
127	01093	石药集团	162,000	1,121,861.66	0.17
128	00688	中国海外发 展	74,000	1,116,874.30	0.16
129	600919	江苏银行	190,400	1,110,032.00	0.16
130	300347	泰格医药	8,500	1,086,300.00	0.16
131	06618	京东健康	21,600	1,085,216.83	0.16
132	00066	港铁公司	31,500	1,077,821.64	0.16
133	600660	福耀玻璃	22,600	1,065,364.00	0.16
134	601169	北京银行	238,500	1,058,940.00	0.16
135	688599	天合光能	13,400	1,057,260.00	0.16
136	600999	招商证券	59,800	1,055,470.00	0.16
137	002709	天赐材料	9,200	1,054,780.00	0.16
138	002821	凯莱英	2,400	1,044,000.00	0.15
139	600905	三峡能源	138,100	1,037,131.00	0.15
140	600019	宝钢股份	143,600	1,028,176.00	0.15
141	600010	包钢股份	367,300	1,024,767.00	0.15
142	00006	电能实业	25,500	1,013,251.68	0.15
143	01997	九龙仓置业	31,000	1,003,685.76	0.15
144	601669	中国电建	123,300	996,264.00	0.15
145	01177	中国生物制	223,000	995,493.41	0.15



		药			
146	600958	东方证券	67,300	992,002.00	0.15
147	002311	海大集团	13,400	982,220.00	0.14
148	002410	广联达	15,300	978,894.00	0.14
149	06969	思摩尔国际	30,000	974,988.00	0.14
150	00968	信义光能	90,000	972,780.48	0.14
151	01801	信达生物	24,500	966,505.40	0.14
152	00586	海螺创业	31,000	965,667.36	0.14
153	002459	晶澳科技	10,300	954,810.00	0.14
154	600196	复星医药	19,500	954,330.00	0.14
155	601390	中国中铁	164,100	950,139.00	0.14
156	600588	用友网络	26,300	943,644.00	0.14
157	601985	中国核电	113,000	937,900.00	0.14
158	000625	长安汽车	61,428	933,091.32	0.14
159	601877	正泰电器	17,300	932,297.00	0.14
160	00960	龙湖集团	31,000	930,183.52	0.14
161	000166	申万宏源	181,600	929,792.00	0.14
162	00267	中信股份	147,000	925,441.44	0.14
163	00268	金蝶国际	47,000	922,252.80	0.14
164	300408	三环集团	20,500	914,300.00	0.13
165	603659	璞泰来	5,640	905,840.40	0.13
166	02618	京东物流	41,800	903,946.74	0.13
167	00992	联想集团	122,000	893,734.91	0.13
168	002493	荣盛石化	48,890	887,842.40	0.13
169	601818	光大银行	266,600	885,112.00	0.13
170	002179	中航光电	8,800	884,928.00	0.13
171	02007	碧桂园	156,000	882,615.55	0.13
172	000895	双汇发展	27,900	880,245.00	0.13
173	000538	云南白药	8,300	868,595.00	0.13
174	00322	康师傅控股	66,000	864,464.83	0.13
175	601377	兴业证券	86,300	852,644.00	0.13
176	002074	国轩高科	16,500	845,625.00	0.12
177	300661	圣邦股份	2,650	818,850.00	0.12
178	300207	欣旺达	19,400	817,904.00	0.12
179	000768	中航西飞	22,300	813,950.00	0.12
180	01928	金沙中国有限公司	54,400	807,710.31	0.12
181	603806	福斯特	6,120	798,966.00	0.12
182	688111	金山办公	3,000	795,000.00	0.12
183	000799	酒鬼酒	3,700	786,250.00	0.12
184	600346	恒力石化	34,000	780,980.00	0.12
185	002001	新和成	25,000	778,000.00	0.11
186	601989	中国重工	183,800	775,636.00	0.11

187	01821	ESR	36,000	775,575.36	0.11
188	601600	中国铝业	126,500	770,385.00	0.11
189	00868	信义玻璃	48,000	765,273.60	0.11
190	601138	工业富联	64,000	762,880.00	0.11
191	601225	陕西煤业	62,500	762,500.00	0.11
192	300496	中科创达	5,500	761,310.00	0.11
193	300896	爱美客	1,400	750,554.00	0.11
194	600426	华鲁恒升	23,880	747,444.00	0.11
195	600460	士兰微	13,700	742,540.00	0.11
196	002008	大族激光	13,700	739,800.00	0.11
197	300433	蓝思科技	32,000	735,360.00	0.11
198	002202	金风科技	44,500	732,915.00	0.11
199	002050	三花智控	28,900	731,170.00	0.11
200	600009	上海机场	15,500	723,695.00	0.11
201	601009	南京银行	80,600	722,176.00	0.11
202	600741	华域汽车	25,500	721,650.00	0.11
203	600763	通策医疗	3,600	716,400.00	0.11
204	300316	晶盛机电	10,300	715,850.00	0.11
205	00998	中信银行	176,000	486,373.89	0.07
205	601998	中信银行	49,400	228,228.00	0.03
206	600150	中国船舶	28,800	713,952.00	0.11
207	03908	中金公司	26,000	457,038.40	0.07
207	601995	中金公司	5,200	254,956.00	0.04
208	600176	中国巨石	38,736	704,995.20	0.10
209	601100	恒立液压	8,500	695,300.00	0.10
210	600011	华能国际	70,900	687,021.00	0.10
211	300413	芒果超媒	12,000	686,640.00	0.10
212	00836	华润电力	32,000	682,859.52	0.10
213	001979	招商蛇口	51,100	681,674.00	0.10
214	00012	恒基地产	25,000	678,608.00	0.10
215	002236	大华股份	28,900	678,572.00	0.10
216	600522	中天科技	39,600	671,616.00	0.10
217	300601	康泰生物	6,700	660,218.00	0.10
218	00017	新世界发展	26,000	655,796.96	0.10
219	06186	中国飞鹤	76,000	649,959.30	0.10
220	300454	深信服	3,400	649,400.00	0.10
221	600760	中航沈飞	9,420	640,936.80	0.09
222	002920	德赛西威	4,500	636,795.00	0.09
223	603993	洛阳钼业	113,900	635,562.00	0.09
224	600584	长电科技	20,100	623,502.00	0.09
225	00881	中升控股	12,500	621,376.00	0.09
226	600989	宝丰能源	35,500	616,280.00	0.09
227	02328	中国财险	118,000	614,557.22	0.09

228	601066	中信建投	21,000	614,250.00	0.09
229	601006	大秦铁路	95,900	613,760.00	0.09
230	600926	杭州银行	47,800	612,796.00	0.09
231	688008	澜起科技	7,300	612,251.00	0.09
232	688036	传音控股	3,900	611,910.00	0.09
233	03323	中国建材	78,000	609,667.97	0.09
234	300759	康龙化成	4,300	607,461.00	0.09
235	00288	万洲国际	151,500	605,706.70	0.09
236	002602	世纪华通	72,100	604,919.00	0.09
237	002384	东山精密	22,100	598,910.00	0.09
238	003816	中国广核	190,200	595,326.00	0.09
239	601117	中国化学	49,200	590,400.00	0.09
240	600132	重庆啤酒	3,900	590,148.00	0.09
241	000977	浪潮信息	16,400	587,612.00	0.09
242	00151	中国旺旺	100,000	585,401.60	0.09
243	601360	三六零	46,000	585,120.00	0.09
244	000786	北新建材	16,300	584,029.00	0.09
245	002555	三七互娱	21,500	580,930.00	0.09
246	01929	周大福	50,600	580,015.25	0.09
247	601555	东吴证券	65,390	579,355.40	0.09
248	601186	中国铁建	74,200	578,760.00	0.09
249	01193	华润燃气	16,000	576,244.48	0.08
250	601233	桐昆股份	27,200	576,096.00	0.08
251	000157	中联重科	80,000	573,600.00	0.08
252	601868	中国能建	209,000	570,570.00	0.08
253	002013	中航机电	31,300	569,034.00	0.08
254	000963	华东医药	14,100	566,820.00	0.08
255	600600	青岛啤酒	5,700	564,300.00	0.08
256	002385	大北农	53,400	560,166.00	0.08
257	603486	科沃斯	3,700	558,515.00	0.08
258	600029	南方航空	81,700	556,377.00	0.08
259	600015	华夏银行	99,200	555,520.00	0.08
260	00788	中国铁塔	788,000	554,071.17	0.08
261	002648	卫星化学	13,800	552,414.00	0.08
262	000876	新希望	36,300	552,123.00	0.08
263	603369	今世缘	10,100	549,440.00	0.08
264	002601	龙佰集团	19,200	548,928.00	0.08
265	01038	长江基建集团	13,500	548,016.84	0.08
266	600547	山东黄金	29,100	547,662.00	0.08
267	600219	南山铝业	115,500	544,005.00	0.08
268	601238	广汽集团	35,100	533,169.00	0.08
269	002736	国信证券	46,400	532,672.00	0.08

270	600352	浙江龙盛	42,000	530,460.00	0.08
271	01308	海丰国际	23,000	530,295.36	0.08
272	000425	徐工机械	88,400	529,516.00	0.08
273	000938	紫光股份	23,100	527,835.00	0.08
274	603019	中科曙光	18,900	521,073.00	0.08
275	601336	新华保险	13,400	520,992.00	0.08
276	601901	方正证券	66,300	519,792.00	0.08
277	09992	泡泡玛特	14,200	518,963.42	0.08
278	03888	金山软件	18,400	515,251.52	0.08
279	600886	国投电力	44,900	515,003.00	0.08
280	002007	华兰生物	17,600	512,864.00	0.08
281	00004	九龙仓集团	26,000	509,119.52	0.08
282	00083	信和置业	64,000	508,089.34	0.07
283	688012	中微公司	4,000	506,400.00	0.07
284	300033	同花顺	3,500	506,030.00	0.07
285	603882	金域医学	4,500	501,165.00	0.07
286	00101	恒隆地产	38,000	498,343.55	0.07
287	00241	阿里健康	92,000	495,694.53	0.07
288	00384	中国燃气	37,400	495,367.49	0.07
289	01918	融创中国	51,000	491,197.73	0.07
290	600298	安琪酵母	8,100	488,916.00	0.07
291	000596	古井贡酒	2,000	488,000.00	0.07
292	601800	中国交建	56,800	487,344.00	0.07
293	01876	百威亚太	29,000	484,877.68	0.07
294	002180	纳思达	10,100	482,376.00	0.07
295	601865	福莱特	8,300	480,902.00	0.07
296	300628	亿联网络	5,900	480,555.00	0.07
297	300595	欧普康视	8,300	476,171.00	0.07
298	002938	鹏鼎控股	11,200	475,216.00	0.07
299	600383	金地集团	36,400	472,108.00	0.07
300	601916	浙商银行	134,700	471,450.00	0.07
301	601788	光大证券	31,500	470,295.00	0.07
302	601799	星宇股份	2,300	469,775.00	0.07
303	000783	长江证券	62,300	469,742.00	0.07
304	000069	华侨城 A	66,100	465,344.00	0.07
305	300253	卫宁健康	27,600	462,576.00	0.07
306	300003	乐普医疗	20,400	461,652.00	0.07
307	002185	华天科技	36,200	460,102.00	0.07
308	600115	中国东航	88,300	455,628.00	0.07
309	00270	粤海投资	56,000	453,735.30	0.07
310	000301	东方盛虹	23,400	452,556.00	0.07
311	601108	财通证券	40,500	450,360.00	0.07
312	600918	中泰证券	44,900	447,653.00	0.07

313	002252	上海莱士	65,200	444,664.00	0.07
314	603833	欧派家居	3,000	442,500.00	0.07
315	00135	昆仑能源	74,000	442,272.54	0.07
316	600109	国金证券	39,000	441,870.00	0.07
317	300999	金龙鱼	7,000	440,510.00	0.06
318	601618	中国中冶	115,000	440,450.00	0.06
319	002841	视源股份	5,400	439,560.00	0.06
320	601111	中国国航	48,100	439,153.00	0.06
321	603392	万泰生物	1,980	438,570.00	0.06
322	600183	生益科技	18,600	438,030.00	0.06
323	601155	新城控股	14,600	425,298.00	0.06
324	601838	成都银行	34,900	418,800.00	0.06
325	300529	健帆生物	7,800	415,740.00	0.06
326	01378	中国宏桥	61,500	413,824.15	0.06
327	603589	口子窖	5,800	411,046.00	0.06
328	01044	恒安国际	12,500	410,333.00	0.06
329	603517	绝味食品	6,000	409,980.00	0.06
330	000066	中国长城	28,400	402,144.00	0.06
331	601966	玲珑轮胎	11,000	402,050.00	0.06
332	601727	上海电气	82,400	400,464.00	0.06
333	603160	汇顶科技	3,700	398,749.00	0.06
334	603816	顾家家居	5,100	393,516.00	0.06
335	00425	敏实集团	14,000	393,183.84	0.06
336	002916	深南电路	3,200	389,824.00	0.06
337	603899	晨光文具	6,000	387,060.00	0.06
338	600332	白云山	11,300	386,460.00	0.06
339	00522	ASM PACIFIC	5,600	385,743.68	0.06
340	600038	中直股份	4,800	385,440.00	0.06
341	600779	水井坊	3,200	383,968.00	0.06
342	601077	渝农商行	99,700	383,845.00	0.06
343	002120	韵达股份	18,700	382,602.00	0.06
344	002624	完美世界	18,800	381,828.00	0.06
345	002791	坚朗五金	2,100	381,339.00	0.06
346	000728	国元证券	49,200	378,840.00	0.06
347	000703	恒逸石化	35,500	377,010.00	0.06
348	688180	君实生物	5,600	375,088.00	0.06
349	600362	江西铜业	16,700	372,911.00	0.05
350	600233	圆通速递	22,200	370,296.00	0.05
351	601607	上海医药	18,600	369,582.00	0.05
352	300146	汤臣倍健	13,700	369,352.00	0.05
353	002414	高德红外	15,160	367,023.60	0.05
354	002568	百润股份	6,100	364,963.00	0.05
355	600143	金发科技	29,000	364,820.00	0.05

356	01066	威高股份	45,600	362,759.31	0.05
357	300144	宋城演艺	25,300	362,296.00	0.05
358	00285	比亚迪电子	15,500	361,808.44	0.05
359	300677	英科医疗	6,200	358,608.00	0.05
360	600079	人福医药	15,800	355,816.00	0.05
361	00853	微创医疗	15,300	355,263.55	0.05
362	601990	南京证券	35,700	353,787.00	0.05
363	300676	华大基因	4,000	351,200.00	0.05
364	002673	西部证券	43,300	349,431.00	0.05
365	002044	美年健康	44,100	346,185.00	0.05
366	01209	华润万象生活	11,600	344,749.22	0.05
367	00772	阅文集团	8,600	344,536.64	0.05
368	603260	合盛硅业	2,600	343,122.00	0.05
369	600705	中航产融	86,200	342,214.00	0.05
370	603345	安井食品	2,000	341,560.00	0.05
371	600061	国投资本	41,504	341,162.88	0.05
372	600188	兖矿能源	14,400	338,832.00	0.05
373	600872	中炬高新	8,900	337,933.00	0.05
374	600845	宝信软件	5,520	335,781.60	0.05
375	002600	领益智造	45,500	334,880.00	0.05
376	603737	三棵树	2,400	333,960.00	0.05
377	000708	中信特钢	16,300	333,824.00	0.05
378	01999	敏华控股	33,600	331,854.03	0.05
379	00762	中国联通	104,000	331,618.56	0.05
380	688185	康希诺	1,100	329,505.00	0.05
381	601878	浙商证券	25,000	329,500.00	0.05
382	00019	太古股份公司A	9,000	326,345.04	0.05
383	688169	石头科技	400	325,200.00	0.05
384	601728	中国电信	75,100	325,183.00	0.05
385	603939	益丰药房	5,860	322,944.60	0.05
386	000860	顺鑫农业	8,400	320,712.00	0.05
387	300558	贝达药业	4,000	319,320.00	0.05
388	600161	天坛生物	11,000	318,560.00	0.05
389	01691	J S 环球生活	29,500	316,926.29	0.05
390	02018	瑞声科技	12,500	314,776.00	0.05
391	01972	太古地产	19,600	313,127.72	0.05
392	603338	浙江鼎力	3,900	313,014.00	0.05
393	688126	沪硅产业	12,100	312,422.00	0.05
394	600521	华海药业	14,400	311,904.00	0.05
395	03692	翰森制药	20,000	310,688.00	0.05

396	600018	上港集团	56,300	308,524.00	0.05
397	601198	东兴证券	26,100	303,543.00	0.04
398	00144	招商局港口	26,000	301,857.92	0.04
399	601696	中银证券	22,400	301,280.00	0.04
400	603185	上机数控	1,800	300,564.00	0.04
401	00884	旭辉控股集团	78,100	299,477.89	0.04
402	00817	中国金茂	150,000	295,562.40	0.04
403	00656	复星国际	42,500	292,230.68	0.04
404	00909	明源云	20,000	290,411.52	0.04
405	601216	君正集团	54,400	284,512.00	0.04
406	600369	西南证券	53,600	283,544.00	0.04
407	601162	天风证券	69,800	282,690.00	0.04
408	688396	华润微	4,300	277,780.00	0.04
409	600372	中航电子	12,400	277,636.00	0.04
410	002508	老板电器	7,700	277,354.00	0.04
411	06862	海底捞	19,000	273,405.44	0.04
412	06110	滔搏	42,000	270,936.29	0.04
413	600606	绿地控股	61,705	267,799.70	0.04
414	00754	合生创展集团	20,100	267,212.94	0.04
415	300866	安克创新	2,600	266,500.00	0.04
416	600674	川投能源	21,300	266,250.00	0.04
417	01579	颐海国际	9,000	265,270.32	0.04
418	600118	中国卫星	9,500	257,925.00	0.04
419	000050	深天马 A	19,800	257,796.00	0.04
420	688363	华熙生物	1,600	248,480.00	0.04
421	002024	苏宁易购	60,100	247,612.00	0.04
422	603707	健友股份	5,870	246,540.00	0.04
423	002157	正邦科技	25,400	245,364.00	0.04
424	300251	光线传媒	18,900	242,865.00	0.04
425	601933	永辉超市	58,500	236,925.00	0.03
426	002607	中公教育	29,800	234,228.00	0.03
427	002064	华峰化学	22,400	233,856.00	0.03
428	601881	中国银河	20,800	232,752.00	0.03
429	000656	金科股份	51,600	231,168.00	0.03
430	01313	华润水泥控股	48,000	231,151.87	0.03
431	600848	上海临港	15,460	229,890.20	0.03
432	300832	新产业	5,100	224,655.00	0.03
433	01833	平安好医生	9,600	222,518.02	0.03
434	02689	玖龙纸业	32,000	218,985.98	0.03
435	603195	公牛集团	1,300	217,490.00	0.03

436	603233	大参林	5,160	217,287.60	0.03
437	601319	中国人保	45,700	214,790.00	0.03
438	00966	中国太平	24,200	211,709.34	0.03
439	002153	石基信息	7,280	209,227.20	0.03
440	603658	安图生物	3,790	208,677.40	0.03
441	002294	信立泰	7,200	196,704.00	0.03
442	002939	长城证券	15,000	194,250.00	0.03
443	300957	贝泰妮	1,000	192,280.00	0.03
444	600025	华能水电	29,000	191,110.00	0.03
445	603087	甘李药业	2,700	189,918.00	0.03
446	601898	中煤能源	29,500	185,555.00	0.03
447	06993	蓝月亮集团	30,000	181,507.20	0.03
448	01030	新城发展	42,000	180,967.58	0.03
449	601236	红塔证券	15,150	180,588.00	0.03
450	603866	桃李面包	6,180	175,512.00	0.03
451	601231	环旭电子	10,600	170,236.00	0.03
452	00880	澳博控股	39,000	167,403.60	0.02
453	02588	中银航空租 赁	3,500	163,397.36	0.02
454	002032	苏泊尔	2,600	161,824.00	0.02
455	06666	恒大物业	73,000	157,567.87	0.02
456	000987	越秀金控	17,990	156,513.00	0.02
457	000800	一汽解放	15,000	154,350.00	0.02
458	601577	长沙银行	19,500	152,295.00	0.02
459	601808	中海油服	9,500	142,500.00	0.02
460	01128	永利澳门	26,400	137,494.16	0.02
461	03808	中国重汽	14,000	137,356.80	0.02
462	03380	龙光集团	28,000	136,441.09	0.02
463	605499	东鹏饮料	700	127,288.00	0.02
464	06808	高鑫零售	48,000	122,836.22	0.02
465	06699	时代天使	600	122,345.66	0.02
466	300919	中伟股份	800	121,208.00	0.02
467	300979	华利集团	1,300	115,765.00	0.02
468	300888	稳健医疗	1,400	115,430.00	0.02
469	00293	国泰航空	22,000	114,938.21	0.02
470	00813	世茂集团	25,000	104,244.00	0.02
471	01516	融创服务	16,000	103,998.72	0.02
472	601698	中国卫通	7,100	102,169.00	0.02
473	03383	雅居乐集团	26,000	89,919.65	0.01
474	300869	康泰医学	2,000	81,100.00	0.01
475	600299	安迪苏	6,500	80,080.00	0.01
476	02282	美高梅中国	19,200	74,251.16	0.01
477	03333	中国恒大	34,000	44,199.46	0.01



### 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	01114	BRILLIANCE CHI	100,000	596,848.00	0.09
2	688707	振华新材	8,130	383,410.80	0.06
3	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.03
4	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.01
5	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.01
6	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
7	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
8	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
9	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
10	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
11	301017	漱玉平民	650	15,503.25	0.00
12	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
13	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
14	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
15	301082	久盛电气	534	11,497.02	0.00
16	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
17	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
18	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
19	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
20	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
21	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
22	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
23	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
24	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
25	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
26	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
27	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
28	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
29	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
30	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
31	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
32	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
33	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
34	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00

35	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
36	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
37	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
38	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
39	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
40	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	124,725,729.58	18.39
2	03690	美团-W	51,002,766.73	7.52
3	600519	贵州茅台	40,934,318.82	6.04
4	601318	中国平安	22,066,857.58	3.25
4	02318	中国平安	17,200,382.61	2.54
5	01299	友邦保险	30,357,328.41	4.48
6	600036	招商银行	17,784,725.61	2.62
6	03968	招商银行	7,464,001.68	1.10
7	00005	汇丰控股	22,267,446.00	3.28
8	00939	建设银行	18,289,004.68	2.70
8	601939	建设银行	1,153,013.00	0.17
9	000858	五粮液	18,884,016.52	2.78
10	00388	香港交易所	16,946,223.77	2.50
11	01398	工商银行	10,907,296.72	1.61
11	601398	工商银行	4,660,518.00	0.69
12	000333	美的集团	14,736,044.55	2.17
13	300750	宁德时代	14,565,221.00	2.15
14	01810	小米集团-W	12,840,757.74	1.89
15	002594	比亚迪	7,304,210.00	1.08
15	01211	比亚迪股份	4,487,857.14	0.66
16	02269	药明生物	10,821,897.17	1.60
17	600276	恒瑞医药	10,180,442.80	1.50
18	601166	兴业银行	9,658,839.00	1.42
19	601888	中国中免	8,897,535.92	1.31
20	000651	格力电器	8,768,480.00	1.29

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	00700	腾讯控股	45,480,841.57	6.71
2	03690	美团-W	15,389,733.07	2.27
3	01299	友邦保险	13,145,901.74	1.94
4	00005	汇丰控股	10,980,894.20	1.62
5	000858	五粮液	8,267,575.20	1.22
6	00939	建设银行	8,166,575.37	1.20
6	601939	建设银行	54,926.00	0.01
7	02318	中国平安	6,494,971.40	0.96
7	601318	中国平安	1,552,116.88	0.23
8	00388	香港交易所	7,257,041.22	1.07
9	300750	宁德时代	7,110,218.00	1.05
10	000333	美的集团	5,838,257.00	0.86
11	01810	小米集团-W	5,240,732.09	0.77
12	01398	工商银行	4,766,400.20	0.70
12	601398	工商银行	317,586.00	0.05
13	03968	招商银行	3,541,985.36	0.52
13	600036	招商银行	1,469,920.00	0.22
14	002594	比亚迪	3,420,560.00	0.50
14	01211	比亚迪股份	1,348,900.05	0.20
15	02269	药明生物	4,035,839.04	0.60
16	300059	东方财富	3,845,392.50	0.57
17	000651	格力电器	3,826,669.00	0.56
18	00941	中国移动	3,445,481.81	0.51
19	000568	泸州老窖	3,304,708.36	0.49
20	002415	海康威视	3,231,468.00	0.48

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	1,274,950,694.73
卖出股票收入（成交）总额	409,503,847.65

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	-	-
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）	564,000.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	564,000.00	0.08

## 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	113052	兴业转债	5,640	564,000.00	0.08

## 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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	02997 HS	新城发展 股权	2,000	-	-

## 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
IF2203	IF2203	10.00	14,851,800.00	112,740.00	
IF2206	IF2206	6.00	8,854,560.00	-246,240.00	
公允价值变动总额合计					-133,500.00
股指期货投资本期收益					850,135.92
股指期货投资本期公允价值变动					-133,500.00

### 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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

### 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，美团本期被监管部门立案调查，兴业银行股份有限公司、腾讯控股有限公司、美团、招商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 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	2,863,212.75
2	应收证券清算款	73,034.88
3	应收股利	44,679.11
4	应收利息	6,785.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,987,711.89

### 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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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	01114	BRILLIANCE CHI	596,848.00	0.09	重大事项停牌
2	688707	振华新材	383,410.80	0.06	新股流通受限
3	688711	宏微科技	217,309.80	0.03	新股流通受限
4	688511	天微电子	81,234.80	0.01	新股流通受限
5	688622	禾信仪器	68,543.72	0.01	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

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 (%)
21,197	36,663.96	48,864,900.00	6.29	728,301,100.00	93.71

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	威海市威力高档工具有限公司	15,000,000.00	1.93

2	招商证券股份有 限公司	9,560,071.00	1.23
3	毛瓯越	8,000,000.00	1.03
4	中信建投证券股 份有限公司	7,392,500.00	0.95
5	中信证券股份有 限公司	3,267,229.00	0.42
6	刘贞峰	3,160,000.00	0.41
7	李静	3,000,000.00	0.39
8	朴昌建	3,000,000.00	0.39
9	上海或然投资管 理有限公司-或 然赋益私募证券 投资基金	2,938,100.00	0.38
10	陆有为	2,920,000.00	0.38

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年02月01日） 基金份额总额	1,089,166,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	208,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	520,000,000.00
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	777,166,000.00

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。

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

### 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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 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（2021年02月01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。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	



东方证券	4	816,968,439.71	48.63	698,423.73	49.36	
华泰证券	2	188,494,146.80	11.22	136,688.69	9.66	
兴业证券	2	126,130,329.80	7.51	108,843.18	7.69	
安信证券	2	88,004,414.21	5.24	73,661.04	5.21	
国泰君安	2	73,419,085.14	4.37	61,830.37	4.37	
西南证券	1	72,401,871.92	4.31	58,053.61	4.10	
东吴证券	2	59,924,819.64	3.57	50,120.68	3.54	
广发证券	1	52,952,673.63	3.15	49,132.99	3.47	
中金公司	2	46,824,552.86	2.79	42,101.85	2.98	
中金财富	1	42,660,036.53	2.54	39,729.27	2.81	
东兴证券	1	38,718,189.75	2.30	36,043.71	2.55	
中泰证券	2	26,695,511.20	1.59	21,423.51	1.51	
国金证券	2	13,839,819.12	0.82	11,122.09	0.79	
海通证券	2	9,877,514.91	0.59	7,940.85	0.56	
招商证券	2	6,735,721.31	0.40	5,409.46	0.38	
国信证券	2	6,586,565.08	0.39	5,357.64	0.38	
光大证券	1	4,308,052.68	0.26	4,012.35	0.28	
银河证券	3	2,205,869.00	0.13	2,054.35	0.15	
上海证券	1	2,005,749.34	0.12	1,868.02	0.13	
申万宏源证券	1	457,318.23	0.03	425.89	0.03	
中银国际	1	348,829.47	0.02	324.86	0.02	
国都	1	327,608.49	0.02	305.10	0.02	

证券						
北京高华	1	240,143.67	0.01	223.65	0.02	
财信证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	
华融证券	2	-	-	-	-	
华鑫证券	1	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
中信证券华南	1	-	-	-	-	

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

### 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 (%)
东方证券	70,492.69	4.27	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	24,979.98	1.51	-	-	-	-	-	-
安信	47,902.72	2.90	-	-	-	-	-	-

证券								
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	451,158.76	27.36	-	-	-	-	-	-
东吴证券	293,778.90	17.82	-	-	-	-	-	-
广发证券	289,973.30	17.58	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	151,825.30	9.21	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	34,379.76	2.08	-	-	-	-	-	-
招商证券	180,440.23	10.94	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华	104,098.30	6.31	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-

长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券 华南	-	-	-	-	-	-	-	-

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	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金发行文件	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 01 月 15 日
2	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金增加网下现金发售代理机构的公告	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 01 月 20 日
3	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	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 01 月 22 日
4	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集期认购申请确认比例的公告	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 02 月 01 日
5	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	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 02 月 02 日
6	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	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 02 月 10 日
7	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	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 02 月 10 日
8	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 10 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告	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 02 月 20 日
10	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	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 02 月 22 日
11	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	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 03 月 31 日
12	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

13	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
14	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	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 04 月 27 日
15	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	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 05 月 17 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加第一创业为申购赎回代理券商的公告	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 05 月 19 日
17	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金电子披露网站, 深交所	2021 年 06 月 24 日
18	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	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 06 月 28 日
19	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	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 06 月 29 日
20	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
21	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2021 年 8 月 10 日更新)	上交所, 公司网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 08 月 10 日
22	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
23	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
24	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	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 09 月 14 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关	上交所, 上证报, 公司	2021 年 09 月 16 日

	于变更直销中心银行账户信息的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站, 深交所	
26	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	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 09 月 27 日
27	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
28	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	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 10 月 12 日
29	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	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 10 月 13 日
30	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
31	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	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 04 日
32	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	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 12 月 22 日
33	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
34	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	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 12 月 27 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沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数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、报告期内汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金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](http://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