

# 汇添富全球消费行业混合型证券投资基金 2022年中期报告

2022年06月30日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022年08月31日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 .....	6
2.5 信息披露方式 .....	6
2.6 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
§ 4 管理人报告 .....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介 .....	15
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	15
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	16
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	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 .....	18
§ 5 托管人报告 .....	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	18
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 .....	19
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	19
6.1 资产负债表 .....	19
6.2 利润表 .....	21
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	22
6.4 报表附注 .....	23
§ 7 投资组合报告 .....	68
7.1 期末基金资产组合情况 .....	68
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	69
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	69
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细 .....	69
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	94
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	97
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	98

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	98
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	98
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	98
7.11 投资组合报告附注.....	98
§ 8 基金份额持有人信息 .....	99
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	99
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	100
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	100
§ 9 开放式基金份额变动 .....	101
§ 10 重大事件揭示 .....	101
10.1 基金份额持有人大会决议.....	101
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	102
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	102
10.4 基金投资策略的改变.....	102
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	102
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	102
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	102
10.8 其他重大事件.....	105
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	106
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	106
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	106
§ 12 备查文件目录 .....	106
12.1 备查文件目录.....	106
12.2 存放地点 .....	106
12.3 查阅方式 .....	106

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富全球消费行业混合型证券投资基金		
基金简称	添富全球消费混合(QDII)		
基金主代码	006308		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018年09月21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)	398,091,167.28		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	添富全球消费混合(QDII)人民币A	添富全球消费混合(QDII)人民币C	添富全球消费混合(QDII)美元现汇
下属分级基金的交易代码	006308	006309	006310
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	275,564,467.15	104,340,029.55	18,186,670.58

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选全球消费行业相关优质公司的股票进行投资布局，为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金主要采用稳健的资产配置和积极的股票投资策略。在资产配置中，根据宏观经济和证券市场状况，通过分析股票市场、固定收益产品及货币市场工具等的预期风险收益特征，确定投资组合的投资范围和比例。在股票投资中，采用“自下而上”的策略，精选全球消费行业相关优质公司的股票进行投资布局，精心科学构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金投资策略的重点是精选股票策略。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、个股精选策略、基金投资策略、固定收益类资产投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、汇率避险策略。
业绩比较基准	中证主要消费行业指数收益率*40%+恒生消费品制造及服务行业指数收益率*24%+中债综合财富指数收益率*20%+明晟全球可选消费指数收益率*8%+明晟全球主要消费指数收益率*8%

风险收益特征	<p>本基金为主要投资于全球范围内的消费行业相关优质上市公司股票的混合型基金，风险与预期收益水平低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>
--------	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市黄浦区外马路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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	北美信托银行
	英文	The Northern Trust Company
注册地址		Chicago, County of Cook, State of Illinois, USA
办公地址		50 South La Salle Street, Chicago, Illinois USA
邮政编码		60603

注：本基金无境外投资顾问。

### 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路728号
--------	---------------	---------------

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日 - 2022年06月30日)		
	添富全球消费混合(QDII)人民币A	添富全球消费混合(QDII)人民币C	添富全球消费混合(QDII)美元现汇
本期已实现收益	-231,755,090.12	-73,490,244.18	-98,999,981.31
本期利润	-104,382,350.55	-29,587,516.72	-40,911,392.23
加权平均基金份额本期利润	-0.3414	-0.2819	-2.1074
本期加权平均净值利润率	-18.86%	-16.23%	-17.08%
本期基金份额净值增长率	-12.09%	-12.53%	-16.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年06月30日)		
期末可供分配利润	24,096,080.07	3,241,435.75	10,744,306.91
期末可供分配基金份额利润	0.0874	0.0311	0.5908
期末基金资产净值	519,053,960.39	188,994,602.52	233,917,659.54
期末基金份额净值	1.8836	1.8113	1.9164
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	88.36%	81.13%	91.64%

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,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

添富全球消费混合(QDII)人民币 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.78%	1.82%	5.15%	0.95%	2.63%	0.87%
过去三个月	9.95%	1.84%	4.95%	1.11%	5.00%	0.73%
过去六个月	-12.09%	2.03%	-8.03%	1.25%	-4.06%	0.78%
过去一年	-31.75%	1.73%	-11.09%	1.10%	-20.66%	0.63%
过去三年	52.41%	1.62%	32.41%	1.06%	20.00%	0.56%
自基金合同生效日起至今	88.36%	1.51%	56.48%	1.08%	31.88%	0.43%
添富全球消费混合(QDII)人民币 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.69%	1.82%	5.15%	0.95%	2.54%	0.87%
过去三个月	9.68%	1.84%	4.95%	1.11%	4.73%	0.73%
过去六个月	-12.53%	2.03%	-8.03%	1.25%	-4.50%	0.78%
过去一	-32.43%	1.73%	-11.09%	1.10%	-21.34%	0.63%



年						
过去三年	47.89%	1.62%	32.41%	1.06%	15.48%	0.56%
自基金合同生效日起至今	81.13%	1.51%	56.48%	1.08%	24.65%	0.43%
添富全球消费混合(QDII)美元现汇						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.97%	1.91%	5.15%	0.95%	1.82%	0.96%
过去三个月	4.00%	1.82%	4.95%	1.11%	-0.95%	0.71%
过去六个月	-16.49%	2.06%	-8.03%	1.25%	-8.46%	0.81%
过去一年	-34.31%	1.74%	-11.09%	1.10%	-23.22%	0.64%
过去三年	56.06%	1.62%	32.41%	1.06%	23.65%	0.56%
自基金合同生效日起至今	91.64%	1.51%	56.48%	1.08%	35.16%	0.43%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

添富全球消费混合(QDII)人民币A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富全球消费混合(QDII)人民币C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



添富全球消费混合(QDII)美元现汇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（2018年09月21日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准，于2005年2月3日正式成立。目前，公司注册资本为132,724,224元人民币。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。

汇添富基金自成立以来，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2022 上半年, 汇添富基金新成立 26 只公开募集证券投资基金, 包括 11 只股票型基金、11 只混合型基金、4 只债券型基金。截至 2022 年 6 月 30 日, 公司共管理 252 只公开募集证券投资基金, 形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征, 较为完善、有效的产品线。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
郑慧莲	本基金的基金经理	2018 年 09 月 21 日		12	国籍：中国。学历：复旦大学会计学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格, CPA。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 历任行业研究员、高级研究员。2017 年 5 月 18 日至 2017 年 12 月 11 日任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2017 年 5 月 18 日至 2017 年 12 月 11 日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。2017 年 5 月 18 日至 2017 年 12 月 25 日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。2017 年 12 月 12 日至 2020 年 6 月 10 日任

					<p>汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2017 年 12 月 12 日至 2021 年 3 月 29 日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月 12 日至今任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月 12 日至 2020 年 2 月 26 日任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月 12 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月 26 日至 2020 年 2 月 26 日任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月 26 日至 2021 年 3 月 29 日任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 1 日至 2020 年 6 月 10 日任汇添富熙和精选混合型证券投资</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>基金的基金经 理。2018 年 4 月 2 日至 2020 年 6 月 10 日任汇添 富安鑫智选灵活 配置混合型证券 投资基金的基金 经理。2018 年 7 月 6 日至 2020 年 6 月 10 日任 汇添富达欣灵活 配置混合型证券 投资基金的基金 经理。2018 年 9 月 21 日至今任 汇添富全球消费 行业混合型证券 投资基金的基金 经理。2018 年 12 月 21 日至 2021 年 5 月 17 日任汇添富消费 升级混合型证券 投资基金的基金 经理。2019 年 1 月 30 日至 2020 年 6 月 10 日任 汇添富盈鑫灵活 配置混合型证券 投资基金的基金 经理。2019 年 7 月 31 日至今任 汇添富内需增长 股票型证券投资 基金的基金经 理。2020 年 10 月 19 日至今任 汇添富品牌驱动 六个月持有期混 合型证券投资基 金的基金经理。 2021 年 1 月 25 日至今任汇添富 互联网核心资产</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021年8月17日至今任汇添富价值领先混合型证券投资基金的基金经理。2021年12月21日至今任汇添富品牌价值一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022年3月1日至今任汇添富品牌力一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

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

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、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。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本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 18 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期，A 股方面，上证指数下跌 6.63%，深证成指下跌 13.2%，沪深 300 下跌 9.22%，中小综指下跌 10.77%，创业板指下跌 15.41%。港股方面，恒生指数下跌 6.57%。美股方面，标普 500 下跌 20.58%，道琼斯工业指数下跌 15.31%。

本报告期，A 股走势是先抑后扬，随着上海疫情的解封，市场重塑了对中国经济的中长期增长前景的信心，加上宽裕的流动性，市场的风险偏好大幅提升。4 月底开始，先是超跌反弹。5 月开始，光伏、新能源车等新兴赛道的景气度持续超预期，带动了相关股票的显著上涨。6 月开始，随着上海的解封，多项消费数据的恢复速度均超预期，带动了一波消费股的行情。6 月开始，医药也明显上涨，主要是对前期悲观预期的修复（前期，对于医保限额



的担心、对于医疗政策的担心、对于创新药融资的担心等都压制了估值)。

港股方面，恒生科技指数从4月底以来，也随着风险偏好的提升、对政策担心的缓解，录得较大涨幅。此外，港股的可选消费由于前期受疫情影响而跌幅较大，从5月底以来，也有较好的涨幅。港股医药股同样受益于风险偏好的提升而大幅上涨。

美股方面，由于通胀持续高企导致的加息和缩表，提升了无风险收益率，压制了股票市场的估值水平。目前，市场对于美国后续衰退的担忧日益加剧，对美国公司后续下修盈利指引的预期也越来越强。所以，美股总体录得较差的表现。

本报告期，A股方面，我们适当加仓白酒；港股方面，我们加仓了一些可选消费品，如服装、啤酒等。我们认为，受疫情压制，这些可选消费品的估值被大幅压制，已经具备了较好投资价值。

本报告期，美股方面，我们适当加仓中概股，但由于中长期的中概股的制度安排尚未明确解决，所以，我们总体还是控制中概股仓位。纯美股方面，随着股价下跌，一些优质的公司逐步进入价值区间，我们开始小幅加仓。我们认为，虽然美股仍未完全企稳，但投资性价比在逐步提升。

本报告期，欧洲股票方面，我们仍持有定价能力最强的奢侈品公司。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期添富全球消费混合(QDII)人民币A类份额净值增长率为-12.09%，同期业绩比较基准收益率为-8.03%。本报告期添富全球消费混合(QDII)人民币C类份额净值增长率为-12.53%，同期业绩比较基准收益率为-8.03%。本报告期添富全球消费混合(QDII)美元现汇类份额净值增长率为-16.49%，同期业绩比较基准收益率为-8.03%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，我们依然看好A股和H股。疫情缓解后，我们对宏观经济不悲观，因为很多政策都有待发力。同时，我们对消费也不悲观，我们认为，消费中长期都有较好的增长空间。我们看好的长期逻辑较好的消费品子赛道包括白酒、啤酒、化妆品、医美，短期来说，可能5-6月的涨幅较大，股价对疫情后的恢复情况反映得比较积极，后续可能会以时间换空间，等待基本面的进一步兑现和夯实后，股价将打开进一步的上涨空间。后续，我们也将密切关注防疫政策的变化，这对市场情绪和消费基本面的影响都很大。

美股方面，我们认为，股市对货币政策收紧的反应已基本比较充分了。后续，随着盈利下修的落地，美股将见底。下半年，我们认为，美股可能是低位震荡的走势。美国国内需求仍然比较强劲，下半年，我们也不认为会大幅疲软。我们认为，美联储或在今年尽快地进行

足够幅度的加息，防止经济陷入较长的衰退期。所以，我们看好美国国内收入占比高的消费公司。

#### 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：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.9 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 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富全球消费行业混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	39,603,236.03	28,671,509.77
结算备付金		97,137.56	479,748.39
存出保证金		119,829.10	439,330.88
交易性金融资产	6.4.7.2	895,944,233.04	1,306,716,175.99
其中：股票投资		867,744,455.66	1,256,119,814.43
基金投资		-	-
债券投资		28,199,777.38	50,596,361.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

应收清算款		29,019,686.78	49,918,214.76
应收股利		1,468,526.19	166,226.26
应收申购款		2,832,567.16	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	1,095,009.79
资产总计		969,085,215.86	1,387,486,215.84
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		17,098,937.02	3,115,827.22
应付赎回款		7,956,859.19	34,443,887.47
应付管理人报酬		1,326,575.04	2,150,715.26
应付托管费		257,945.15	418,194.61
应付销售服务费		145,169.12	199,139.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.36	5.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	333,504.53	747,505.77
负债合计		27,118,993.41	41,075,274.57
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.8	504,217,096.69	632,238,664.93
未分配利润	6.4.7.9	437,749,125.76	714,172,276.34
净资产合计		941,966,222.45	1,346,410,941.27
负债和净资产总计		969,085,215.86	1,387,486,215.84

注：报告截止日2022年06月30日，基金份额总额398,091,167.28份。本基金下属添富全球消费混合(QDII)人民币A基金份额净值1.8836元，基金份额总额275,564,467.15份；本基金下属添富全球消费混合(QDII)人民币C基金份额净值1.8113元，基金份额总额104,340,029.55份；本基金下属添富全球消费混合(QDII)美元现汇基金份额净值1.9164元，基金份额总额18,186,670.58份。

比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富全球消费行业混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年01月01日 至2021年06月30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-163,254,786.69</b>	<b>-141,412,694.94</b>
1. 利息收入		62,425.20	1,618,635.04
其中：存款利息收入	6.4.7.10	62,425.20	229,575.98
债券利息收入		-	1,389,059.06
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）		-399,618,634.79	-84,021,392.76
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-406,232,471.06	-89,470,880.33
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	166,910.82	-14,400.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	6,446,925.45	5,463,887.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	229,364,056.11	-63,556,938.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		6,800,374.43	568,021.77
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	136,992.36	3,978,979.13
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>11,626,472.81</b>	<b>49,113,835.38</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,773,685.72	24,388,809.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,705,994.44	4,742,268.43
3. 销售服务费		909,669.44	1,920,994.53
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,890.56	2,689.56
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		2.23	0.24
8. 其他费用	6.4.7.21	231,230.42	18,059,073.25
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-174,881,259.50</b>	<b>-190,526,530.32</b>

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-174,881,259.50	-190,526,530.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-174,881,259.50	-190,526,530.32

注：比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富全球消费行业混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	632,238,664.93	714,172,276.34	1,346,410,941.27
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	632,238,664.93	714,172,276.34	1,346,410,941.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-128,021,568.24	-276,423,150.58	-404,444,718.82
（一）、综合收益总额	-	-174,881,259.50	-174,881,259.50
（二）、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）	-128,021,568.24	-101,541,891.08	-229,563,459.32
其中：1. 基金申购款	54,824,679.12	43,165,905.90	97,990,585.02
2. 基金赎回款	-182,846,247.36	-144,707,796.98	-327,554,044.34
（三）、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)			
四、本期期末净资产(基金净值)	504,217,096.69	437,749,125.76	941,966,222.45
项目	上年度可比期间		
	2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	678,548,673.54	1,212,616,506.31	1,891,165,179.85
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	678,548,673.54	1,212,616,506.31	1,891,165,179.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	250,785,623.24	411,897,126.81	662,682,750.05
(一)、综合收益总额	-	-190,526,530.32	-190,526,530.32
(二)、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)	250,785,623.24	602,423,657.13	853,209,280.37
其中: 1. 基金申购款	828,059,527.30	1,594,001,150.93	2,422,060,678.23
2. 基金赎回款	-577,273,904.06	-991,577,493.80	-1,568,851,397.86
(三)、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)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	929,334,296.78	1,624,513,633.12	2,553,847,929.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

张晖	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

汇添富全球消费行业混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]636号文《关于准予汇添富全球消费行业混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于2018年9月21日生效，首次设立募集规模为347,747,420.28份人民币基金份额和3,255,290.62份美元基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外托管人北美信托银行（The Northern Trust Company.）。

本基金投资于境内境外市场。针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（以下无特别说明，均包括 exchange traded fund, ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股（包括港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票（包含中小板、创业板、其他依法上市的股票），存托凭证，衍生工具（股指期货、权证、国债期货、股票期权等），债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、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、货币市场工具等资产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）。本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易、境内融资交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。



本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选全球消费行业相关优质公司的股票进行投资布局，为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金业绩比较基准为：中证主要消费行业指数收益率×40%+恒生消费品制造及服务业指数收益率×24%+明晟全球可选消费指数收益率×8%+明晟全球主要消费指数收益率×8%+中债综合财富指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员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3号《半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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年06月30日的财务状况以及2022年01月01日至2022年06月30日的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.2 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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本

或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益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；

(7) 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扣除适用情况下的相关税费后的净额，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，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币28,671,509.77元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,596.09元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币28,673,105.86元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币479,748.39元，自应收利息转入的重分类金额为人民币237.49元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币479,985.88元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币439,330.88元，自应收利息转入的重分类金额为人民币217.47元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币439,548.35元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,095,009.79元，转出至银行存款的重分类金额为人民币1,596.09元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币237.49元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币217.47元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币1,092,958.74元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,306,716,175.99元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,092,958.74元。经上述重分类后，交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币1,307,809,134.73元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资

产和金融负债项目无影响。

于首次执行日,新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011年修订)》、《征收教育费附加的

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
活期存款	39,603,236.03
等于：本金	39,601,697.54
加：应计利息	1,538.49
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	39,603,236.03

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	843,632,495.99	-	867,744,455.66	24,111,959.67	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	27,930,200.00	150,523.90	28,199,777.38	119,053.48
	银行间市场	-	-	-	-
	境外 OTC 市场	-	-	-	-
	合计	27,930,200.00	150,523.90	28,199,777.38	119,053.48

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	871,562,695.99	150,523.90	895,944,233.04	24,231,013.15

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	540.28
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	148,744.70
其中：交易所市场	148,744.70
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	124,712.18
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-



应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	333,504.53

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

添富全球消费混合(QDII)人民币 A		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	369,695,871.95	369,695,921.06
本期申购	27,187,277.57	27,187,338.14
本期赎回 (以“-”号填列)	-121,318,682.37	-121,319,195.05
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	275,564,467.15	275,564,064.15
添富全球消费混合(QDII)人民币 C		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	110,871,406.92	110,864,709.02
本期申购	21,070,317.81	21,069,072.80
本期赎回 (以“-”号填列)	-27,601,695.18	-27,599,969.33
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	104,340,029.55	104,333,812.49
添富全球消费混合(QDII)美元现汇		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,189,010.13	151,678,034.85
本期申购	960,872.29	6,568,268.18
本期赎回（以“-”号填列）	-4,963,211.84	-33,927,082.98
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	18,186,670.58	124,319,220.05

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

添富全球消费混合(QDII)人民币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	292,327,336.45	130,140,811.76	422,468,148.21
本期利润	-231,755,090.12	127,372,739.57	-104,382,350.55
本期基金份额交易产生的变动数	-36,476,166.26	-38,119,735.16	-74,595,901.42
其中：基金申购款	8,485,946.82	13,834,372.46	22,320,319.28
基金赎回款	-44,962,113.08	-51,954,107.62	-96,916,220.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,096,080.07	219,393,816.17	243,489,896.24
添富全球消费混合(QDII)人民币 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	79,663,571.96	39,061,066.55	118,724,638.51
本期利润	-73,490,244.18	43,902,727.46	-29,587,516.72
本期基金份额交易产生的变动数	-2,931,892.03	-1,544,439.73	-4,476,331.76
其中：基金申购款	4,112,176.54	11,461,410.54	15,573,587.08
基金赎回款	-7,044,068.57	-13,005,850.27	-20,049,918.84
本期已分配	-	-	-

利润			
本期末	3,241,435.75	81,419,354.28	84,660,790.03
添富全球消费混合(QDII)美元现汇			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	119,664,997.51	53,314,492.11	172,979,489.62
本期利润	-98,999,981.31	58,088,589.08	-40,911,392.23
本期基金份额交易产生的变动数	-9,920,709.29	-12,548,948.61	-22,469,657.90
其中：基金申购款	1,902,072.46	3,369,927.08	5,271,999.54
基金赎回款	-11,822,781.75	-15,918,875.69	-27,741,657.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,744,306.91	98,854,132.58	109,598,439.49

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	57,758.52
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	2,842.41
其他	1,824.27
合计	62,425.20

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	2,519,349,879.53
减：卖出股票成本总额	2,918,535,951.88
减：交易费用	7,046,398.71
买卖股票差价收入	-406,232,471.06

#### 6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	116,039.24
债券投资收益——买卖债券差价收入	50,871.58
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	166,910.82

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	47,568,130.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	46,392,941.20
减：应计利息总额	1,124,293.25
减：交易费用	24.17
买卖债券差价收入	50,871.58

**6.4.7.14 资产支持证券投资收益****6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益****6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	6,446,925.45
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	6,446,925.45

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	229,364,056.11
——股票投资	229,515,422.99
——债券投资	-151,366.88
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	229,364,056.11

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	136,992.36
替代损益	-
其他	-
合计	136,992.36

#### 6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年01月01日至2022年06月30日	
审计费用		34,712.18
信息披露费		59,507.37
证券出借违约金		-
账户维护费		9,000.00
银行费用		330.00
指数使用费		-
持有人大会-公证费		-
持有人大会-律师费		-
开户费		-
上市费		-
其他		127,680.87
合计		231,230.42

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
北美信托银行 (The Northern Trust Company) (“北美信托”)	基金境外托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	94,292,897.11	1.96	1,767,903,724.63	14.95

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	72,515.78	2.71	24,037.29	16.16
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	1,555,591.21	14.86	884,172.80	34.13

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至 2022年06月30日	2021年01月01日至 2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,773,685.72	24,388,809.37
其中：支付销售机构的客户维护费	2,663,035.66	5,655,031.04

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

$$H=E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至 2022年06月30日	2021年01月01日至 2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,705,994.44	4,742,268.43

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

## 6.4.10.2.3 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	添富全球消费混合(QDII)人	添富全球消费混合(QDII)人民币 C	添富全球消费混合(QDII)美	合计



	人民币 A		元现汇	
汇添富基金管理股份有限公司	-	38,338.24	-	38,338.24
中国工商银行股份有限公司	-	25,610.90	-	25,610.90
东方证券股份有限公司	-	784.52	-	784.52
合计	-	64,733.66	-	64,733.66
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	添富全球消费混合(QDII)人民币 A	添富全球消费混合(QDII)人民币 C	添富全球消费混合(QDII)美元现汇	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	103,189.09	-	103,189.09
中国工商银行股份有限公司	-	61,410.86	-	61,410.86
东方证券股份有限公司	-	853.03	-	853.03
合计	-	165,452.98	-	165,452.98

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 1.0%。

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 1.0% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，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。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺

延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

添富全球消费混合(QDII)人民币 A		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2018 年 09 月 21 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,270,242.51	25,563,568.02
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	9,270,242.51	16,293,325.51
报告期末持有的基金份额	-	9,270,242.51
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	-	1.44

添富全球消费混合(QDII)人民币 C		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金合同生效日(2018年 09 月 21 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(%)	-	-
添富全球消费混合(QDII)美元现汇		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
基金合同生效日(2018年 09 月 21 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。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位: 份

添富全球消费混合(QDII)人民币 A				
关联方名称	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
汇添富资本管理有限公司	-	-	9,025,592.98	2.44
添富全球消费混合(QDII)人民币 C				
关联方名称	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
	-	-	-	-
添富全球消费混合(QDII)美元现汇				
关联方名称	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
	-	-	-	-

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	14,807,014.79	57,758.52	81,739,036.03	160,841.93
北美信托	24,796,221.24	-	90,728,488.91	-

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
300834	星辉环材	2022年01月06日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	
301103	何氏眼科	2022年03月14日	6个月	新股流通受限	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	
301109	军信股份	2022年04月06日	6个月	新股流通受限	23.21	16.14	1,746	40,518.84	28,180.44	
301110	青木股份	2022年03月04日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	
301116	益客食品	2022年01月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	
301117	佳缘	2022年	6个月	新股	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	

	科技	01月07日	月	流通受限						
301135	瑞德智能	2022年04月01日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	
301139	元道通信	2022年06月30日	6个交易日	新股流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	
301139	元道通信	2022年06月30日	6个月	新股流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	
301148	嘉戎技术	2022年04月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	
301162	国能日新	2022年04月19日	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	
301175	中科环保	2022年06月30日	6个交易日	新股流通受限	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	
301175	中科环保	2022年06月	6个月	新股流通	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	

		30日		受限						
301187	欧圣电气	2022年04月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	
301196	唯科科技	2022年01月04日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	
301201	诚达药业	2022年01月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	
301212	联盛化学	2022年04月07日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	
301233	盛帮股份	2022年06月24日	8个交易日	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	
301233	盛帮股份	2022年06月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	
301239	普瑞眼科	2022年06月22日	9个交易日	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	

301239	普瑞眼科	2022年06月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75
301263	泰恩康	2022年03月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16
301268	铭利达	2022年03月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67
301286	侨源股份	2022年06月06日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36
600938	中国海油	2022年04月14日	6个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44
600941	中国移动	2021年12月24日	6个月	新股流通受限	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38
688163	赛伦生物	2022年03月02日	6个月	新股流通受限	33.03	23.56	3,607	119,139.21	84,980.92
688237	超卓	2022年	5个	新股	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57



	航科	06月24日	交易日	流通受限						
688400	凌云光	2022年06月27日	7个交易日	新股流通受限	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“何氏眼科”（证券代码：301103）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的117股（根据何氏眼科2021年年度权益分派实施公告，何氏眼科以公司现有总股本121,558,824股为基数，向全体股东每10股派6元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每10股转增3股，除权除息日为2022年6月1日。）。本基金持有的流通受限股票“军信股份”（证券代码：301109）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的582股（根据军信股份2021年年度权益分派实施公告，军信股份以公司现有总股本273,340,000股为基数，向全体股东每10股派3.80元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每10股转增5股，除权除息日为2022年6月17日。）。

#### 6.4.12.2 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
2120 HK	Wenzhou Kangning Hospital Co Ltd	2022年04月01日	重大事项停牌	10.35		-	1,094,200	32,315,844.62	11,322,561.67	

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且同一基金管理人管理的

全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。此外，基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

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

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素

的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年 06月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	39,603,236.03	-	-	-	-	-	39,603,236.03
结算备付金	97,137.56	-	-	-	-	-	97,137.56
存出保证金	119,829.10	-	-	-	-	-	119,829.10
交易性金融资产	4,107,111.08	-	24,092,666.30	-	-	867,744,455.66	895,944,233.04
衍生金融	-	-	-	-	-	-	-

融资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	29,019,686.78	29,019,686.78
应收股利	-	-	-	-	-	1,468,526.19	1,468,526.19
应收申购款	-	-	-	-	-	2,832,567.16	2,832,567.16
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	43,927,313.77	-	24,092,666.30	-	-	901,065,235.79	969,085,215.86

负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	17,098,937.02	17,098,937.02
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,956,859.19	7,956,859.19
应付管理人报	-	-	-	-	-	1,326,575.04	1,326,575.04

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	257,945.15	257,945.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	145,169.12	145,169.12
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	3.36	3.36
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	333,504.53	333,504.53
负债总计	-	-	-	-	-	27,118,993.41	27,118,993.41
利	43,927,313	-	24,092,666	-	-	873,946,242.3	941,966,222.4

率 敏 感 度 缺 口	.77		.30			8	5
上 年 度 末 202 1 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	28,671,509 .77	-	-	-	-	-	28,671,509.77
结 算 备 付 金	479,748.39	-	-	-	-	-	479,748.39
存 出 保 证 金	439,330.88	-	-	-	-	-	439,330.88
交 易 性 金 融 资 产	46,171,276 .80	294,029. 40	4,131,055. 36	-	-	1,256,119,814 .43	1,306,716,175 .99
衍 生 金 融	-	-	-	-	-	-	-



资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	49,918,214.76	49,918,214.76
应收股利	-	-	-	-	-	166,226.26	166,226.26
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	1,095,009.79	1,095,009.79
资产总计	75,761,865.84	294,029.40	4,131,055.36	-	-	1,307,299,265.24	1,387,486,215.84
资产							
负债							

债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	3,115,827.22	3,115,827.22
应付赎回款	-	-	-	-	-	34,443,887.47	34,443,887.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,150,715.26	2,150,715.26

应付托管费	-	-	-	-	-	418,194.61	418,194.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	199,139.12	199,139.12
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	5.12	5.12
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	747,505.77	747,505.77
负债总计	-	-	-	-	-	41,075,274.57	41,075,274.57
利率	75,761,865.84	294,029.40	4,131,055.36	-	-	1,266,223,990.67	1,346,410,941.27

敏 感 度 缺 口							
-----------------------	--	--	--	--	--	--	--

上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	49,020.03	11,376.22
	基准利率增加 25 个基点	-48,824.62	-11,361.44

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人	合计

			人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	8,225,564.05	3,330,711.20	13,465,744.30	25,022,019.55
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	185,520,035.06	512,380,172.75	26,496,699.93	724,396,907.74
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	23,201,316.42	-	23,201,316.42
应收股利	53.42	1,468,420.27	-	1,468,473.69
应收申购款	174,308.82	-	-	174,308.82
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	193,919,961.35	540,380,620.64	39,962,444.23	774,263,026.22
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 清算 款	3,925,890.14	-	13,173,046.88	17,098,937.02
应付 赎回 款	215,590.57	-	-	215,590.57
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-
应付 托管 费	-	-	-	-
应付 销售 服务 费	-	-	-	-
应付 投资 顾问 费	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-
递延 所得 税负 债	-	-	-	-
其他 负债	56.38	-	-	56.38

负债合计	4,141,537.09	-	13,173,046.88	17,314,583.97
资产负债表外 外汇风险敞口 净额	189,778,424.26	540,380,620.64	26,789,397.35	756,948,442.25
项目	上年度末 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	16,743,884.83	6,630,855.91	4,967.15	23,379,707.89
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	306,910,611.39	712,304,038.22	73,729,330.79	1,092,943,980.40
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	21,098,282.39	-	21,098,282.39
应收股利	-	166,226.26	-	166,226.26
应收申购	-	-	-	-

款				
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	2.49	0.07	-	2.56
资产合计	323,654,498.71	740,199,402.85	73,734,297.94	1,137,588,199.50
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	3,115,827.22	-	-	3,115,827.22
应付赎回款	351,755.40	-	-	351,755.40
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-



应付 投资 顾问 费	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-
递延 所得 税负 债	-	-	-	-
其他 负债	86.84	-	-	86.84
负债 合计	3,467,669.46	-	-	3,467,669.46
资产 负债 表外 汇风 险敞 口净 额	320,186,829.25	740,199,402.85	73,734,297.94	1,134,120,530.04

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	欧元相对人民币贬值 5%	-1,339,469.87	-3,686,714.90
	美元相对人民币升值 5%	9,488,921.21	16,009,341.46
	美元相对人民币贬值 5%	-9,488,921.21	-16,009,341.46
	港币相对人民币升值 5%	27,019,031.03	37,009,970.14
	港币相对人民币贬值 5%	-27,019,031.03	-37,009,970.14
	欧元相对人民	1,339,469.87	3,686,714.90

	币升值 5%		
--	--------	--	--

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 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	867,744,455.66	92.12	1,256,119,814.43	93.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	28,199,777.38	2.99	50,596,361.56	3.76
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	895,944,233.04	95.11	1,306,716,175.99	97.05

本基金的股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 60%-95%。本基金以全球消费行业相关公司股票及存托凭证为主要投资对象，投资于全球消费行业相关公司股票及存托凭证的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%。现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；	
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中证主要消费指数上涨 5%	29,021,823.28	42,362,003.50
	中证主要消费指数下跌 5%	-29,021,823.28	-42,362,003.50

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

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 06 月 30 日
第一层次	846,552,531.12
第二层次	42,444,760.88
第三层次	6,946,941.04
合计	895,944,233.04

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	867,744,455.66	89.54
	其中：普通股	768,548,813.45	79.31
	存托凭证	99,195,642.21	10.24
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,199,777.38	2.91
	其中：债券	28,199,777.38	2.91
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	39,700,373.59	4.10
8	其他各项资产	33,440,609.23	3.45

9	合计	969,085,215.86	100.00
---	----	----------------	--------

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	512,380,172.75	54.39
美国	185,520,035.06	19.69
中国	143,347,547.92	15.22
法国	26,496,699.93	2.81
合计	867,744,455.66	92.12

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

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	9,837,475.86	1.04
15 原材料	2,914,174.43	0.31
20 工业	19,563,315.91	2.08
25 可选消费	441,592,678.88	46.88
30 日常消费	204,201,146.64	21.68
35 医疗保健	71,991,458.84	7.64
40 金融	14,356,095.90	1.52
45 信息技术	651,810.00	0.07
50 电信服务	72,845,245.86	7.73
55 公用事业	-	-
60 房地产	29,791,053.34	3.16
合计	867,744,455.66	92.12

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券	所属国家	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比
----	----------	----------	------	------	------	-------	------	----------

				市场 (地区)			例 (%)
1	Meituan	美团-W	3690 HK	香港 联合交易所 中国 香港	405,320	67,314,693. 62	7.15
2	Li Ning Co Ltd	李宁	2331 HK	香港 联合交易所 中国 香港	1,002,80 0	62,346,395. 48	6.62
3	Li Auto Inc	理想汽车	LI US	纳斯 达克交易所 美国	115,500	29,696,636. 28	3.15
3	Li Auto Inc	理想汽车	2015 HK	香港 联合交易所 中国 香港	74,300	9,715,360.3 4	1.03
4	Kweichow Moutai Co Ltd	贵州茅台	60051 9	上海 证券交易所 中国	18,757	38,358,065. 00	4.07
5	Tsingtao Brewery Co Ltd	青岛啤酒	168 HK	香港 联合交易所 中国 香港	518,300	36,168,790. 12	3.84

				易所				
6	Hermes International	爱马仕国际公司	RMS FP	巴黎交易所	法国	3,538	26,457,032.39	2.81
7	Pinduoduo Inc	拼多多	PDD US	纳斯达克交易所	美国	59,365	24,622,495.73	2.61
8	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	34,311	24,457,491.33	2.60
9	Lululemon Athletica Inc	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU US	纳斯达克交易所	美国	12,902	23,605,431.52	2.51
10	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克交易所	美国	5,046	22,805,856.13	2.42
11	China Resources Beer Holdings Co Ltd	华润啤酒	291 HK	香港联合交易所	中国香港	434,000	21,712,418.91	2.31
12	Shede Spirits Co Ltd	舍得酒业	600702	上海	中国	103,100	21,031,369.00	2.23

				证 券 交 易 所				
13	NetEase Inc	网易	9999 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	161,800	19,939,079. 82	2.12
14	Wuliangye Yibin Co Ltd	五粮液	00085 8	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	96,239	19,433,541. 27	2.06
15	Anhui Gujing Distillery Co Ltd	古井贡酒	00059 6	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	77,500	19,348,650. 00	2.05
16	Kuaishou Technology	快手	1024 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	254,000	18,984,875. 92	2.02
17	Bosideng International Holdings Ltd	波司登	3998 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	4,446,00 0	18,516,590. 98	1.97
18	WuXi AppTec Co Ltd	药明康德	2359 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	203,200	18,159,446. 54	1.93



				交易所				
19	China Overseas Land & Investment Ltd	中国海外发展	688 HK	香港联合交易所	中国香港	820,000	17,391,143.84	1.85
20	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	78,054	16,874,652.87	1.79
20	JD.com Inc	京东集团	JD US	纳斯达克交易所	美国	200	86,201.22	0.01
21	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家	6690 HK	香港联合交易所	中国香港	634,000	15,750,632.86	1.67
22	Bilibili Inc	哔哩哔哩	BILI US	纳斯达克交易所	美国	87,200	14,981,992.45	1.59
22	Bilibili Inc	哔哩哔哩	9626 HK	香港联合交易所	中国香港	2,800	481,300.93	0.05

				所				
23	Sands China Ltd	金沙中国有限公司	1928 HK	香港联合交易所	中国香港	918,000	14,696,405.94	1.56
24	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	山西汾酒	600809	上海证券交易所	中国	45,069	14,638,411.20	1.55
25	China Mobile Ltd	中国移动	941 HK	香港联合交易所	中国香港	194,500	8,150,388.30	0.87
25	China Mobile Ltd	中国移动	600941	上海证券交易所	中国	87,363	5,264,494.38	0.56
26	ZTO Express Cayman Inc	中通快递	ZTO US	纽约证券交易所	美国	57,500	10,593,105.98	1.12
26	ZTO Express Cayman Inc	中通快递	2057 HK	香港联合交易所	中国香港	16,050	2,789,082.46	0.30
27	Hong Kong	香港交易	388	香	中	35,600	11,751,678.	1.25

	Exchanges & Clearing Ltd	所	HK	港 联 合 交 易 所	国 香 港		90	
28	Luzhou Laojiao Co Ltd	泸州老窖	000568	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	46,800	11,538,072.00	1.22
29	Xtep International Holdings Ltd	特步国际	1368 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	935,500	11,360,429.48	1.21
30	Wenzhou Kangning Hospital Co Ltd	康宁医院	2120 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,094,200	11,322,561.67	1.20
31	Huazhu Group Ltd	华住集团	1179 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	239,300	6,221,267.80	0.66
31	Huazhu Group Ltd	华住集团	HTHT US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	19,370	4,952,993.07	0.53
32	CIFI Ever Sunshine Services	旭辉永升服务	1995 HK	香 港 联	中 国 香	1,217,300	10,410,227.87	1.11

	Group Ltd			合 交 易 所	港			
33	Yonghe Medical Group Co Ltd	-	2279 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	1,149,300	10,320,133.60	1.10
34	COFCO Joycome Foods Ltd	中 粮 家 佳 康	1610 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	3,006,000	9,768,664.33	1.04
35	Helens International Holdings Co ltd	海 伦 司	9869 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	594,500	9,202,229.24	0.98
36	XPeng Inc	广 州 橙 行 智 动 汽 车 科 技 有 限 公 司	XPEV US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	42,300	9,010,739.06	0.96
36	XPeng Inc	广 州 橙 行 智 动 汽 车 科 技 有 限 公 司	9868 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	800	86,476.81	0.01
37	CNOOC Ltd	中 国 海 洋 石 油	883 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	846,000	7,495,364.07	0.80

				易所				
37	CNOOC Ltd	中国海洋石油	600938	上海证券交易所	中国	84,004	1,332,303.44	0.14
38	China Feihe Ltd	中国飞鹤	6186HK	香港联合交易所	中国香港	985,200	7,599,649.36	0.81
39	Jinxin Fertility Group Ltd	锦欣生殖	1951HK	香港联合交易所	中国香港	845,000	5,224,655.03	0.55
40	Trip.com Group Ltd	携程集团	9961HK	香港联合交易所	中国香港	11,000	2,084,611.14	0.22
40	Trip.com Group Ltd	携程集团	TCOMUS	纳斯达克交易所	美国	11,290	2,079,933.33	0.22
41	Aier Eye Hospital Group Co Ltd	爱尔眼科	300015	深圳证券交易所	中国	92,900	4,159,133.00	0.44

42	Chaoju Eye Care Holdings Ltd	朝聚眼科	2219 HK	香港联合交易所	中国香港	975,500	3,962,629.76	0.42
43	Galaxy Entertainment Group Ltd	银河娱乐	27 HK	香港联合交易所	中国香港	97,000	3,882,220.52	0.41
44	Chipotle Mexican Grill Inc	Chipotle Mexican Grill 股份有限公司	CMG US	纽约证券交易所	美国	441	3,869,133.24	0.41
45	Hisense Home Appliances Group Co Ltd	海信家电	921 HK	香港联合交易所	中国香港	484,000	3,667,259.97	0.39
46	Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd	凯莱英	6821 HK	香港联合交易所	中国香港	23,000	3,638,833.45	0.39
47	Gushengtang Holdings Ltd	固生堂	2273 HK	香港联合交易所	中国香港	109,000	3,635,412.69	0.39
48	Booking Holdings Inc	Booking 控股股份	BKNG US	纳斯达克	美国	297	3,486,236.93	0.37

		有限公司		达克交易所				
49	JS Global Lifestyle Co Ltd	JS 环球生活	1691 HK	香港联合交易所	中国香港	396,500	3,465,426.57	0.37
50	Full Truck Alliance Co Ltd	-	YMM US	纽约证券交易所	美国	52,100	3,167,955.30	0.34
51	Ross Stores Inc	Ross 商店有限公司	ROST US	纳斯达克交易所	美国	6,600	3,110,854.71	0.33
52	Focus Media Information Technology Co Ltd	分众传媒	002027	深圳证券交易所	中国	453,200	3,050,036.00	0.32
53	Man Wah Holdings Ltd	敏华控股	1999 HK	香港联合交易所	中国香港	391,200	2,836,986.78	0.30
54	Fufeng Group Ltd	阜丰集团	546 HK	香港联合交易所	中国香港	655,000	2,817,551.73	0.30

				交易所				
55	NIKE Inc	耐克公司	NKE US	纽约 证券 交易 所	美国	3,819	2,619,471.5 0	0.28
56	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	3968 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	57,500	2,581,604.8 1	0.27
57	Pharmaron Beijing Co Ltd	康龙化成	3759 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	36,600	2,458,611.3 9	0.26
58	Great Wall Motor Co Ltd	长城汽车	2333 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	161,500	2,229,146.8 1	0.24
59	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	泰格医药	3347 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	25,800	2,001,195.9 1	0.21
60	China Lesso Group Holdings Ltd	中国联塑	2128 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	188,000	1,903,584.5 2	0.20



				所				
61	China Mengniu Dairy Co Ltd	蒙牛乳业	2319 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	55,000	1,841,437.8 7	0.20
62	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	华润万象生活	1209 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	55,200	1,836,332.3 8	0.19
63	Ocumension Therapeutics	欧康维视生物	1477 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	142,000	1,704,975.2 0	0.18
64	Canada Goose Holdings Inc	加拿大鹅控股公司	G00S US	纽约 证券 交易所	美国	13,500	1,631,776.2 4	0.17
65	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	9988 HK	香港 联合 交易所	中国 香港	15,900	1,521,562.6 0	0.16
66	China Telecom Corp Ltd	中国电信	60172 8	上海 证券 交易所	中国	394,011	1,469,661.0 3	0.16
67	China Yongda	永达汽车	3669	香 中		220,500	1,399,184.9	0.15

	Automobiles Services Holdings Ltd		HK	香港联合交易所	中国香港		1	
68	Chervon Holdings Ltd	-	2285 HK	香港联合交易所	中国香港	32,500	1,225,701.07	0.13
69	Chongqing Fuling Zhacai Group Co Ltd	涪陵榨菜	002507	深圳证券交易所	中国	34,700	1,197,844.00	0.13
70	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物	2269 HK	香港联合交易所	中国香港	18,300	1,123,668.35	0.12
71	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co Ltd	同仁堂国药	3613 HK	香港联合交易所	中国香港	100,000	1,082,670.54	0.11
72	EuroEyes International Eye Clinic Ltd	德视佳	1846 HK	香港联合交易所	中国香港	167,000	1,053,987.47	0.11
73	Tongcheng Travel Holdings Ltd	同程旅行	780 HK	香港联	中国香港	72,000	1,039,363.72	0.11

				合 交 易 所	港			
74	Yankuang Energy Group Co Ltd	兖矿能源	1171 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	48,000	1,009,808.3 5	0.11
75	Uni-President China Holdings Ltd	统一企业 中国	220 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	171,000	984,178.31	0.10
76	Regina Miracle International Holdings Ltd	维珍妮	2199 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	212,000	950,013.47	0.10
77	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	福耀玻璃	3606 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	27,600	939,409.11	0.10
78	Airbnb Inc	爱彼迎股 份有限公 司	ABNB US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	1,208	722,204.63	0.08
79	Tong Ren Tang Technologies Co Ltd	同仁堂科 技	1666 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	127,000	715,734.17	0.08

				易所				
80	Aidigong Maternal & Child Health Ltd	爱帝宫	286 HK	香港联合交易所	中国香港	1,400,000	580,674.01	0.06
81	Zhou Hei Ya International Holdings Co Ltd	周黑鸭	1458 HK	香港联合交易所	中国香港	118,000	544,927.07	0.06
82	Angelalign Technology Inc	时代天使	6699 HK	香港联合交易所	中国香港	3,400	457,081.95	0.05
83	Baidu Inc	百度	9888 HK	香港联合交易所	中国香港	2,900	368,287.57	0.04
84	Hunan Junxin Environmental Protection Co Ltd	军信股份	301109	深圳证券交易所	中国	17,457	297,309.87	0.03
85	Luster LightTech Co Ltd	凌云光	688400	上海证券交易所	中国	13,111	287,524.23	0.03

86	SF Holding Co Ltd	顺丰控股	002352	深圳证券交易所	中国	4,700	262,307.00	0.03
87	Beijing China Sciences Runyu Environmental Technology Co Ltd	中科环保	301175	深圳证券交易所	中国	63,694	243,311.08	0.03
88	Wintao Communications Co Ltd	元道通信	301139	深圳证券交易所	中国	5,651	217,337.46	0.02
89	China Yuhua Education Corp Ltd	宇华教育	6169 HK	香港联合交易所	中国香港	180,000	213,968.54	0.02
90	Guangzhou Automobile Group Co Ltd	广汽集团	2238 HK	香港联合交易所	中国香港	30,000	194,726.76	0.02
91	Chengdu Bright Eye Hospital Co Ltd	普瑞眼科	301239	深圳证券交易所	中国	5,747	193,386.55	0.02
92	China East Education	中国东方教育	667 HK	香港	中国	52,500	186,773.50	0.02

	Holdings Ltd			联合交易所	香港			
93	Jinke Smart Services Group Co Ltd	金科服务	9666 HK	香港联合交易所	中国香港	8,800	152,018.57	0.02
94	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	500	151,539.67	0.02
95	BYD Co Ltd	比亚迪	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	500	134,264.83	0.01
96	Hubei Chaozhuo Aviation Technology Co Ltd	超卓航科	688237	上海证券交易所	中国	2,891	119,311.57	0.01
97	Guangdong Real-Design Intelligent Technology Co Ltd	瑞德智能	301135	深圳证券交易所	中国	3,376	96,066.48	0.01
98	Smartgiant Technology Co Ltd	思林杰	688115	上海证券交易所	中国	2,153	86,636.72	0.01

				交易所				
99	Qingmu Digital Technology Co Ltd	青木股份	301110	深圳证券交易所	中国	2,013	86,466.00	0.01
100	Shanghai Serum Biotechnology Co Ltd	赛伦生物	688163	上海证券交易所	中国	3,607	84,980.92	0.01
101	Chengdu Shengbang Seals Co Ltd	盛帮股份	301233	深圳证券交易所	中国	1,576	65,435.52	0.01
102	DR Corp Ltd	迪阿股份	301177	深圳证券交易所	中国	792	58,766.40	0.01
103	Christian Dior SE	克里斯汀迪奥股份公司	CDI FP	巴黎交易所	法国	10	39,667.54	0.00
104	Chengda Pharmaceuticals Co Ltd	诚达药业	301201	深圳证券交易所	中国	353	25,253.62	0.00
10	Ping An	中国平安	2318	香中		500	22,812.19	0.00

5	Insurance Group Co of China Ltd		HK	港 联 合 交 易 所	中 国 香 港			
10 6	Shenzhen Minglida Precision Technology Co Ltd	铭利达	301268	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	641	22,351.67	0.00
10 7	Hangzhou Bio-Sincerity Pharma-Tech Co Ltd	百诚医药	301096	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	272	21,488.00	0.00
10 8	Guangdong Taienkang Pharmaceutical Co Ltd	泰恩康	301263	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	682	21,401.16	0.00
10 9	Suzhou Alton Electrical & Mechanical Industry Co Ltd	欧圣电气	301187	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	876	19,745.04	0.00
11 0	Rastar Environmental Protection Materials Co Ltd	星辉环材	300834	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	635	19,069.05	0.00
11 1	Shenzhen Urban Transport	深城交	301091	深 圳 证	中 国	681	18,591.30	0.00



	Planning Center Co Ltd			券交易所				
11 2	State Power Rixin Technology Co Ltd	国能日新	301162	深圳证券交易所	中国	334	18,072.74	0.00
11 3	Liaoning He Eye Hospital Group Co Ltd	何氏眼科	301103	深圳证券交易所	中国	507	16,234.14	0.00
11 4	PayPal Holdings Inc	Paypal 控股股份有限公司	PYPL US	纳斯达克交易所	美国	34	15,936.62	0.00
11 5	Sichuan Qiaoyuan Gas Co Ltd	侨源股份	301286	深圳证券交易所	中国	784	15,515.36	0.00
11 6	Jiayuan Science & Technology Co Ltd	佳缘科技	301117	深圳证券交易所	中国	262	14,263.28	0.00
11 7	Jiangsu Hualan New Pharmaceutical Material Co Ltd	华兰股份	301093	深圳证券交易所	中国	409	13,861.01	0.00

				易所				
118	Zhejiang Realsun Chemical Co Ltd	联盛化学	301212	深圳证券交易所	中国	416	13,844.48	0.00
119	Joy Kie Corp Ltd	久祺股份	300994	深圳证券交易所	中国	420	13,780.20	0.00
120	Rumere Co Ltd	戎美股份	301088	深圳证券交易所	中国	704	13,136.64	0.00
121	MH Robot & Automation Co Ltd	迈赫股份	301199	深圳证券交易所	中国	402	12,880.08	0.00
122	Xiamen Jiarong Technology Co Ltd	嘉戎技术	301148	深圳证券交易所	中国	516	12,332.40	0.00
123	Jiangsu Zeyu Intelligent Electric Power Co Ltd	泽宇智能	301179	深圳证券交易所	中国	295	12,038.95	0.00

12 4	Jiangsu Yike Food Group Co Ltd	益客食品	30111 6	深圳 证券 交易 所	中 国	577	11,805.42	0.00
12 5	Guangdong Yangshan United Precision Manufacturing Co Ltd	联合精密	00126 8	深圳 证券 交易 所	中 国	409	11,337.48	0.00
12 6	ShuYu Civilian Pharmacy Corp Ltd	漱玉平民	30101 7	深圳 证券 交易 所	中 国	555	10,289.70	0.00
12 7	Xiamen Voke Mold & Plastic Engineering Co Ltd	唯科科技	30119 6	深圳 证券 交易 所	中 国	271	10,167.92	0.00
12 8	Zhejiang Zhengguang Industrial Co Ltd/China	争光股份	30109 2	深圳 证券 交易 所	中 国	323	10,161.58	0.00
12 9	AK Medical Holdings Ltd	爱康医疗	1789 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	2,000	10,057.03	0.00
13 0	Hangzhou Flariant Co	福莱茵特	60556 6	上海	中 国	435	9,926.70	0.00

	Ltd			证 券 交 易 所				
13 1	ANTA Sports Products Ltd	安踏体育	2020 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	120	9,892.84	0.00
13 2	Ningxia Xiaoming Agriculture & Animal Husbandry Co Ltd	晓鸣股份	30096 7	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	507	9,131.07	0.00
13 3	Zhejiang Sunrise Garment Group Co Ltd	盛泰集团	60513 8	上 海 证 券 交 易 所	中 国	723	9,023.04	0.00
13 4	AnHui Higasket Plastics Co Ltd	万朗磁塑	60315 0	上 海 证 券 交 易 所	中 国	250	7,442.50	0.00
13 5	Shanghai Ailu Package Co Ltd	上海艾录	30106 2	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	523	6,103.41	0.00
13 6	Zhongjie Jiangsu Technology Co Ltd	中捷精工	30107 2	深 圳 证 券	中 国	181	5,797.43	0.00

				交易所				
137	Jahen Household Products Co Ltd	嘉亨家化	300955	深圳证券交易所	中国	232	5,688.64	0.00
138	Sunlour Pigment Co Ltd	双乐股份	301036	深圳证券交易所	中国	205	4,608.40	0.00
139	Zhangjiagang Haiguo New Energy Equipment Manufacturing Co Ltd	海锅股份	301063	深圳证券交易所	中国	153	4,262.58	0.00
140	JiuGui Liquor Co Ltd	酒鬼酒	000799	深圳证券交易所	中国	21	3,902.01	0.00
141	Yoantion Industrial Inc Ltd	远信工业	301053	深圳证券交易所	中国	155	3,620.80	0.00
142	Sea Ltd	Sea 有限公司	SE US	纽约证券交易所	美国	8	3,589.79	0.00

				所				
14 3	Joinn Laboratories China Co Ltd	昭衍新药	6127 HK	香港 联合 交易 所	中 国 香 港	60	3,391.68	0.00
14 4	Central China New Life Ltd	建业新生 活	9983 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	400	1,330.68	0.00
14 5	Tianli International Holdings Ltd	天立国际 控股	1773 HK	香 港 联 合 交 易 所	中 国 香 港	800	725.20	0.00

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比 例（%）
1	Meituan	3690 HK	167,157,252.25	12.42
2	Pinduoduo Inc	PDD US	99,939,000.37	7.42
3	JD.com Inc	9618 HK	98,708,318.37	7.33
3	JD.com Inc	JD US	73,384.48	0.01
4	Huazhu Group Ltd	HTHT US	82,958,366.30	6.16
4	Huazhu Group Ltd	1179 HK	14,182,569.30	1.05
5	Li Ning Co Ltd	2331 HK	84,966,122.67	6.31
6	Tsingtao Brewery Co Ltd	168 HK	76,768,822.22	5.70
7	NetEase Inc	9999 HK	50,874,229.40	3.78
7	NetEase Inc	NTES US	23,618,210.51	1.75
8	Tencent Holdings Ltd	700 HK	66,327,967.57	4.93

9	ZTO Express Cayman Inc	ZTO US	50,379,144.46	3.74
9	ZTO Express Cayman Inc	2057 HK	13,874,558.21	1.03
10	WuXi AppTec Co Ltd	2359 HK	63,294,160.21	4.70
11	Li Auto Inc	LI US	31,274,819.63	2.32
11	Li Auto Inc	2015 HK	30,298,042.66	2.25
12	Amazon.com Inc	AMZN US	55,787,616.82	4.14
13	Walmart Inc	WMT US	53,539,336.21	3.98
14	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	41,665,999.34	3.09
14	Alibaba Group Holding Ltd	BABA US	5,389,519.91	0.40
15	Kuaishou Technology	1024 HK	45,134,312.20	3.35
16	Procter & Gamble Co/The	PG US	44,451,121.88	3.30
17	Bilibili Inc	BILI US	34,430,623.73	2.56
17	Bilibili Inc	9626 HK	9,098,723.74	0.68
18	China Resources Beer Holdings Co Ltd	291 HK	43,028,662.31	3.20
19	Focus Media Information Technology Co Ltd	002027	41,819,215.00	3.11
20	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	600809	41,153,999.90	3.06
21	Haier Smart Home Co Ltd	6690 HK	39,672,829.40	2.95
22	BYD Co Ltd	1211 HK	37,475,577.85	2.78
23	Wuliangye Yibin Co Ltd	000858	36,552,751.00	2.71
24	Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd	6821 HK	34,616,018.35	2.57
25	Shede Spirits Co Ltd	600702	34,515,935.68	2.56
26	CNOOC Ltd	883 HK	31,648,531.64	2.35
26	CNOOC Ltd	600938	1,296,054.00	0.10
27	China Feihe Ltd	6186 HK	29,837,679.02	2.22
28	Anhui Gujing	000596	28,182,308.04	2.09

	Distillery Co Ltd			
--	-------------------	--	--	--

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Meituan	3690 HK	181,169,533.05	13.46
2	Pinduoduo Inc	PDD US	120,140,002.47	8.92
3	NetEase Inc	NTES US	63,440,828.85	4.71
3	NetEase Inc	9999 HK	49,462,692.47	3.67
4	JD.com Inc	9618 HK	108,231,513.11	8.04
5	Huazhu Group Ltd	HTHT US	88,489,023.38	6.57
5	Huazhu Group Ltd	1179 HK	9,574,679.92	0.71
6	Tencent Holdings Ltd	700 HK	83,459,761.15	6.20
7	Nayuki Holdings Ltd	2150 HK	74,782,106.52	5.55
8	ZTO Express Cayman Inc	ZTO US	51,229,131.22	3.80
8	ZTO Express Cayman Inc	2057 HK	21,231,807.79	1.58
9	Tsingtao Brewery Co Ltd	168 HK	69,673,510.27	5.17
10	Amazon.com Inc	AMZN US	65,128,447.39	4.84
11	China Resources Beer Holdings Co Ltd	291 HK	58,997,971.79	4.38
12	BYD Co Ltd	1211 HK	58,075,706.04	4.31
13	Li Ning Co Ltd	2331 HK	57,846,978.69	4.30
14	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	49,243,126.51	3.66
14	Alibaba Group Holding Ltd	BABA US	5,563,761.91	0.41
15	Walmart Inc	WMT US	54,379,403.69	4.04
16	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	600809	52,938,657.76	3.93
17	WuXi AppTec Co Ltd	2359 HK	48,449,528.63	3.60
18	Haier Smart Home	6690 HK	45,288,175.30	3.36



	Co Ltd			
19	Procter & Gamble Co/The	PG US	45,010,748.93	3.34
20	Kuaishou Technology	1024 HK	39,133,916.17	2.91
21	Tesla Inc	TSLA US	33,988,756.69	2.52
22	Bilibili Inc	BILI US	24,048,393.84	1.79
22	Bilibili Inc	9626 HK	8,842,550.44	0.66
23	Hermes International	RMS FP	32,886,951.49	2.44
24	Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd	6821 HK	32,784,742.27	2.43
25	Shede Spirits Co Ltd	600702	31,813,288.00	2.36
26	Focus Media Information Technology Co Ltd	002027	30,457,422.00	2.26
27	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	3606 HK	28,364,628.32	2.11
28	Yadea Group Holdings Ltd	1585 HK	28,258,906.72	2.10
29	Full Truck Alliance Co Ltd	YMM US	28,127,108.14	2.09
30	Li Auto Inc	2015 HK	19,312,670.62	1.43
30	Li Auto Inc	LI US	8,287,724.82	0.62
31	Kweichow Moutai Co Ltd	600519	26,949,355.00	2.00

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,300,645,170.12
卖出收入（成交）总额	2,519,349,879.53

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

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例
--------	------	-----------

		(%)
A-至 A+	27,557,433.97	2.93
无评级	642,343.41	0.07

注:本基金债券投资组合主要采用穆迪、标准普尔等国际权威评级机构提供的债券信用评级信息。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019674	22 国债 09	240,000	24,092,666.30	2.56
2	019658	21 国债 10	34,000	3,464,767.67	0.37
3	127046	百润转债	5,364	642,343.41	0.07

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注:本基金本报告期末未持有基金投资。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,美团出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

## 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	119,829.10
2	应收清算款	29,019,686.78
3	应收股利	1,468,526.19
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,832,567.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,440,609.23

## 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127046	百润转债	642,343.41	0.07

## 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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(%)
添富全球消费混合(QDII)人民币A	85,774	3,212.68	7,931,006.72	2.88	267,633,460.43	97.12

添富全球消费混合(QDII)人民币C	45,406	2,297.93	1,290,987.02	1.24	103,049,042.53	98.76
添富全球消费混合(QDII)美元现汇	3,130	5,810.44	0.00	0.00	18,186,670.58	100.00
合计	134,310	2,963.97	9,221,993.74	2.32	388,869,173.54	97.68

注：计算上表份额数据时，未将美元份额折算为人民币份额。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	添富全球消费混合(QDII)人民币A	1,684,198.38	0.61
	添富全球消费混合(QDII)人民币C	4,032.74	0.00
	添富全球消费混合(QDII)美元现汇	2,048.24	0.01
	合计	1,690,279.36	0.42

注：计算上表份额数据时，未将美元份额折算为人民币份额。如果将美元份额按照2022年06月30日中国人民银行美元兑换人民币汇率中间价折算为人民币份额后进行计算，添富全球消费混合(QDII)美元现汇份额的管理人所有从业人员持有本基金为13,746.56份；从业人员持有本基金合计份额为1,701,977.68份，合计份额占比为0.34%。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	添富全球消费混合(QDII)人民币A	10~50
	添富全球消费混合(QDII)人民币C	0
	添富全球消费混合(QDII)美	0

	元现汇	
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	添富全球消费混合(QDII)人民币 A	50~100
	添富全球消费混合(QDII)人民币 C	0
	添富全球消费混合(QDII)美元现汇	0
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	添富全球消费混合(QDII)人民币 A	添富全球消费混合(QDII)人民币 C	添富全球消费混合(QDII)美元现汇
基金合同生效日(2018年09月21日)基金份额总额	285,568,522.32	62,178,897.96	3,255,290.62
本报告期期初基金份额总额	369,695,871.95	110,871,406.92	22,189,010.13
本报告期基金总申购份额	27,187,277.57	21,070,317.81	960,872.29
减：本报告期基金总赎回份额	121,318,682.37	27,601,695.18	4,963,211.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	275,564,467.15	104,340,029.55	18,186,670.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
Jefferies International	-	1,051,633,923.04	21.87	311,100.54	11.61	
JPMorgan Securities	-	714,266,195.71	14.85	320,252.97	11.95	

Goldman Sachs	-	570,904,613.26	11.87	400,765.06	14.96	
Sanford C. Bernstein	-	549,527,663.20	11.43	164,544.41	6.14	
Haitong International Securities	-	301,063,959.00	6.26	240,851.20	8.99	
Wolfe Research	-	233,783,914.19	4.86	185,683.63	6.93	
兴业证券	2	191,327,994.69	3.98	143,677.69	5.36	
Macquarie	-	167,112,448.27	3.48	50,133.56	1.87	
Morgan Stanley	-	152,657,802.72	3.17	212,076.24	7.92	
Huatai Securities (HK)	-	135,217,219.38	2.81	108,173.76	4.04	
CICC Hong Kong Securities	-	130,078,392.51	2.71	130,078.39	4.85	
安信证券	2	113,044,670.33	2.35	84,341.15	3.15	
Oppenheimier	-	102,809,270.26	2.14	67,780.64	2.53	
东方证券	3	94,292,897.11	1.96	72,515.78	2.71	
长江证券	1	86,188,074.86	1.79	61,303.81	2.29	
CGS-CIMB Securities (Singapore)	-	82,315,248.46	1.71	24,694.58	0.92	
China Merchant Security (HK)	-	77,303,090.74	1.61	61,842.46	2.31	
国泰君安	2	52,378,261.80	1.09	37,700.32	1.41	
海通证券	1	2,575,053.13	0.05	1,857.33	0.07	
长城证券	1	-	-	-	-	
中泰证券	2	-	-	-	-	

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

		(%)		比例 (%)		(%)		(%)
Jefferies International	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Wolfe Research	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
Huatai Securities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC Hong Kong Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	23,997,200.00	99.38	-	-	-	-	-	-
Oppenhemier	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	149,862.20	0.62	-	-	-	-	-	-
CGS-CIMB Securities (Singapore)	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchant Security (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分



配比例。

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年年度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第一季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证	2022 年 04 月 22 日

		监会基金电子披露网站	
--	--	------------	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富全球消费行业混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富全球消费行业混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富全球消费行业混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富全球消费行业混合型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。

### 12.2 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

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](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 08 月 31 日