

汇添富价值成长均衡投资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：招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。

基金托管人招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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	62
7.1 期末基金资产组合情况	62
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	63
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	70
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
7.12 投资组合报告附注.....	70
§ 8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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.....	72
§ 9 开放式基金份额变动	72
§ 10 重大事件揭示	73
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8 其他重大事件.....	77
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
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.....	78
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§ 12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录.....	78
12.2 存放地点	78
12.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金	
基金简称	汇添富价值成长均衡投资混合	
基金主代码	011271	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 02 月 05 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	3,400,787,322.65	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富价值成长均衡投资混合 A	汇添富价值成长均衡投资混合 C
下属分级基金的交易代码	011271	011272
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	3,356,829,785.92	43,957,536.73

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金遵循“价值与成长并重”的理念，采用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资方法，通过行业的相对均衡配置和精选具备持续性竞争优势、具有良好成长性兼具较高内在价值的股票，在科学严格管理风险的前提下，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票精选策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*15%+中债综合指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。 本基金还可投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露	姓名	李鹏
负责人	联系电话	021-28932888
		张燕
		0755-83199084

电子邮箱	service@99fund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	400-888-9918	95555
传真	021-28932998	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	李文	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 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
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)	
	汇添富价值成长均衡投资混合 A	汇添富价值成长均衡投资混合 C
本期已实现收益	-607,871,389.60	-8,027,263.16
本期利润	-454,834,037.26	-5,863,837.67
加权平均基金份额本期利润	-0.1325	-0.1304
本期加权平均净值利润率	-17.90%	-17.76%
本期基金份额净值增长率	-13.88%	-14.13%
3.1.2 期末数据和指	报告期末(2022 年 06 月 30 日)	

标		
期末可供分配利润	-725,602,668.31	-9,763,873.66
期末可供分配基金份额利润	-0.2162	-0.2221
期末基金资产净值	2,634,848,274.85	34,215,459.51
期末基金份额净值	0.7849	0.7784
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	-21.51%	-22.16%

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

汇添富价值成长均衡投资混合 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	13.95%	1.64%	6.09%	0.84%	7.86%	0.80%
过去三个月	9.47%	1.93%	4.68%	1.06%	4.79%	0.87%
过去六个月	-13.88%	2.20%	-5.51%	1.12%	-8.37%	1.08%
过去一年	-23.27%	1.85%	-11.19%	0.95%	-12.08%	0.90%
自基金合同生效日起至今	-21.51%	1.69%	-13.48%	0.93%	-8.03%	0.76%
汇添富价值成长均衡投资混合 C						
阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较基	业绩比较	①—③	②—④

	长率①	增长率标准 差②	准收益率③	基准收益 率标准 差④		
过去一 个月	13.90%	1.64%	6.09%	0.84%	7.81%	0.80%
过去三 个月	9.33%	1.93%	4.68%	1.06%	4.65%	0.87%
过去六 个月	-14.13%	2.20%	-5.51%	1.12%	-8.62%	1.08%
过去一 年	-23.72%	1.85%	-11.19%	0.95%	-12.53%	0.90%
自基金 合同生 效日起 至今	-22.16%	1.69%	-13.48%	0.93%	-8.68%	0.76%

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

汇添富价值成长均衡投资混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



汇添富价值成长均衡投资混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2021年02月05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		
顾耀强	本基金的基金经理, 增强收益部总监	2021 年 02 月 05 日		18	国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 历任高级行业分析师、基金经理助理, 现任增强收益部总监。2009 年 12 月 22 日至今任汇添富策略回报混合型证券投资基金

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

					<p>数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 2 月 5 日至今任汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 16 日至今任汇添富中证 500 基本面增强指数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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场受突发地缘冲突及国内疫情扩散的双重影响，一度跌幅较大。后期随着国内疫情逐步得到控制，市场信心有一定恢复，但整体呈现出波动剧烈，分化极致的特征。上半年除煤炭行业受益于国际能源价格的大幅上涨有较好表现外，大部分其它行业均表现不佳。电动车、光伏等少数高景气赛道在政策等推动下基本面超预期而先抑后扬，但结构分化严重。从风格上看，中小市值公司表现好于大市值公司。上半年本基金仓位变化不大，组合相对均衡地配置于消费、医药、新能源、稳增长等投资主题，但对市场的系统性风险和风格变化没有做出预判和有效反应，特别是港股配置的权重偏高阶段性对净值拖累较大。本基金管理人将因应市场环境的变化，积极优化投资策略框架，提高组合管理的灵活性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富价值成长均衡投资混合 A 类份额净值增长率为-13.88%，同期业绩比较基准收益率为-5.51%。本报告期汇添富价值成长均衡投资混合 C 类份额净值增长率为-

14.13%，同期业绩比较基准收益率为-5.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，虽然仍面临内外部诸多不确定性因素，但在国内经济筑底回升和流动性环境相对宽松的组合作用下，我们对 A 股市场整体看法略偏积极。基建等稳增长相关产业的确定性较强。新能源等高景气赛道则将面临市场较高预期能否兑现的检验，后期分化仍将较大。消费、医药等近几年受疫情、政策冲击较大的行业，阶段性仍须观察疫情防控进展，但从中长期看，一些优质公司已经具备较好投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《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对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；A 类基金份额和 C 类基金份额之间由于收取费用的不同，将导致在可供分配利润上有所不同；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金

报告截止日：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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	134,786,890.23	245,019,008.63
结算备付金		3,479,952.94	14,509,432.68
存出保证金		537,208.50	1,456,137.57

交易性金融资产	6.4.7.2	2,515,363,539.95	3,063,613,576.98
其中：股票投资		2,480,312,528.11	3,051,631,576.98
基金投资		-	-
债券投资		35,051,011.84	11,982,000.00
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		16,686,283.23	-
应收股利		4,657,993.04	-
应收申购款		458,087.92	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	147,438.32
资产总计		2,675,969,955.81	3,324,745,594.18
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		211.05	44,009,284.71
应付赎回款		1,015,787.02	-
应付管理人报酬		3,084,301.15	4,270,259.12
应付托管费		514,050.18	711,709.84
应付销售服务费		15,950.83	21,140.42
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6.23	5.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	2,275,914.99	4,436,905.90
负债合计		6,906,221.45	53,449,305.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	3,400,787,322.65	3,589,632,891.41
未分配利润	6.4.7.9	-731,723,588.29	-318,336,603.11
净资产合计		2,669,063,734.36	3,271,296,288.30
负债和净资产总计		2,675,969,955.81	3,324,745,594.18

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,400,787,322.65 份。本基金下属 A

类基金份额净值 0.7849 元，基金份额总额 3,356,829,785.92 份；本基金下属 C 类基金份额净值 0.7784 元，基金份额总额 43,957,536.73 份。

2、本基金合同生效日为 2021 年 02 月 05 日，上年度实际报告期间为 2021 年 02 月 05 日至 2021 年 12 月 31 日，特此说明。

3、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：汇添富价值成长均衡投资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 02 月 05 日 (基金合同生效 日) 至 2021 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-437,988,199.86	140,239,641.09
1. 利息收入		422,201.32	3,459,404.72
其中：存款利息收入	6.4.7.10	422,201.32	2,435,923.78
债券利息收入		-	686.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,022,794.01
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-593,637,553.93	-18,569,437.48
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-605,431,900.87	-38,662,733.07
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	151,549.02	1,430,278.72
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	11,642,797.92	18,663,016.87
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	155,200,777.83	154,712,369.89

4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	26,374.92	637,303.96
减：二、营业总支出		22,709,675.07	45,065,924.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	19,235,287.00	24,910,784.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,205,881.16	4,151,797.50
3. 销售服务费		98,621.78	127,404.46
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
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		0.83	2.49
8. 其他费用	6.4.7.21	169,884.30	15,875,934.94
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-460,697,874.93	95,173,716.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-460,697,874.93	95,173,716.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-460,697,874.93	95,173,716.78

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：汇添富价值成长均衡投资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)	3,589,632,891.41	-318,336,603.11	3,271,296,288.30
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	3,589,632,891.41	-318,336,603.11	3,271,296,288.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-188,845,568.76	-413,386,985.18	-602,232,553.94
(一)、综合收益	-	-460,697,874.93	-460,697,874.93

总额			
(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)	-188,845,568.76	47,310,889.75	-141,534,679.01
其中: 1. 基金申购款	54,527,309.17	-13,633,818.43	40,893,490.74
2. 基金赎回款	-243,372,877.93	60,944,708.18	-182,428,169.75
(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)	3,400,787,322.65	-731,723,588.29	2,669,063,734.36
项目	上年度可比期间		
	2021年02月05日(基金合同生效日)至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	4,412,390,980.93	-	4,412,390,980.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-215,546,351.71	96,338,287.15	-119,208,064.56
(一)、综合收益总额	-	95,173,716.78	95,173,716.78
(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)	-215,546,351.71	1,164,570.37	-214,381,781.34
其中: 1. 基金申购款	32,011,453.17	-1,071,039.46	30,940,413.71
2. 基金赎回款	-247,557,804.88	2,235,609.83	-245,322,195.05
(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)	4,196,844,629.22	96,338,287.15	4,293,182,916.37

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）[2020]3674 号《关于准予汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2021 年 2 月 5 日生效，首次设立募集规模为 4,412,390,980.93 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金还可根据法律法规参与融资。本基金遵循“价值与成长并重”的理念，采用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资方法，通过行业的相对均衡配置和精选具备持续性竞争优势、具有良好成长性兼具较高内在价值的股票，在科学严格管理风险的前提下，力争实现基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×15%+中债综合指数收益率×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（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的有关过去事项、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 245,019,008.63 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 20,203.49 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，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 245,039,212.12 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 14,509,432.68 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 15,657.09 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，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 14,525,089.77 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 1,456,137.57 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 4,399.66 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 1,460,537.23 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 147,438.32 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 20,203.49 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 15,657.09 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 4,399.66 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 107,178.08 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 3,063,613,576.98 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 107,178.08 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 3,063,720,755.06 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

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。

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

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。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
活期存款	134,786,890.23
等于：本金	134,774,303.69
加：应计利息	12,586.54
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	134,786,890.23

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	2,511,690,646.59	-	2,480,312,528.11	-31,378,118.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	34,448,157.14	603,411.84	35,051,011.84	-557.14
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	34,448,157.14	603,411.84	35,051,011.84	-557.14
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,546,138,803.73	603,411.84	2,515,363,539.95	31,378,675.62

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	363.25
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,081,413.39
其中：交易所市场	2,081,413.39
银行间市场	-
应付利息	-

应付审计费	134,630.98
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	2,275,914.99

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富价值成长均衡投资混合 A		
项目	本期 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	3,544,447,335.32	3,544,447,335.32
本期申购	50,799,612.99	50,799,612.99
本期赎回（以“-”号填列）	-238,417,162.39	-238,417,162.39
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	3,356,829,785.92	3,356,829,785.92
汇添富价值成长均衡投资混合 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	45,185,556.09	45,185,556.09
本期申购	3,727,696.18	3,727,696.18
本期赎回（以“-”号填列）	-4,955,715.54	-4,955,715.54
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）	-	-

号填列)		
本期末	43,957,536.73	43,957,536.73

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

汇添富价值成长均衡投资混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-138,520,421.25	-175,590,144.58	-314,110,565.83
本期利润	-607,871,389.60	153,037,352.34	-454,834,037.26
本期基金份额交易产生的变动数	20,789,142.54	26,173,949.48	46,963,092.02
其中：基金申购款	-6,289,068.07	-6,360,204.85	-12,649,272.92
基金赎回款	27,078,210.61	32,534,154.33	59,612,364.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-725,602,668.31	3,621,157.24	-721,981,511.07
汇添富价值成长均衡投资混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,990,639.59	-2,235,397.69	-4,226,037.28
本期利润	-8,027,263.16	2,163,425.49	-5,863,837.67
本期基金份额交易产生的变动数	254,029.09	93,768.64	347,797.73
其中：基金申购款	-485,349.73	-499,195.78	-984,545.51
基金赎回款	739,378.82	592,964.42	1,332,343.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,763,873.66	21,796.44	-9,742,077.22

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	312,135.57
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	94,498.27

其他	15,567.48
合计	422,201.32

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	2,629,209,630.26
减：卖出股票成本总额	3,226,304,310.34
减：交易费用	8,337,220.79
买卖股票差价收入	-605,431,900.87

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	151,569.38
债券投资收益——买卖债券差价收入	-20.36
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	151,549.02

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	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	20.36
买卖债券差价收入	-20.36

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	11,642,797.92
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	11,642,797.92

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	155,200,777.83
——股票投资	155,191,734.97
——债券投资	9,042.86
——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	155,200,777.83

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	26,374.92
替代损益	-
其他	-
合计	26,374.92

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	44,630.98
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	22,242.09
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	34,503.86
合计	169,884.30

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东

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 02 月 05 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	346,477,854.23	6.78	2,960,397,670.62	28.90

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 02 月 05 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	5,099,686.33	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 02 月 05 日（基金 合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成 交总额的比例 （%）	成交金额	占当期回购成 交总额的比例 （%）
东方证券	-	-	8,000,000,000.00	69.57

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期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	271,033.69	7.13	209,121.13	10.05
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例 （%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例 （%）
东方证券	2,598,710.75	29.57	783,074.30	16.59

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 02 月 05 日（基 金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	19,235,287.00	24,910,784.92
其中：支付销售机构的客户维护费	9,557,239.44	12,408,197.20

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 02 月 05 日（基 金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,205,881.16	4,151,797.50

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	汇添富价值成长均衡投资混合 A	汇添富价值成长均衡投资混合 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	10,568.57	10,568.57
招商银行股份有限公司	-	85,396.35	85,396.35
合计	-	95,964.92	95,964.92
获得销售服务	上年度可比期间 2021 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06		

费的各关联方 名称	月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富价值成 长均衡投资混 合 A	汇添富价值成长均衡投 资混合 C	合计
汇添富基金管 理股份有限公 司	-	10,910.05	10,910.05
招商银行股份 有限公司	-	116,219.16	116,219.16
合计	-	127,129.21	127,129.21

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

本基金基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.6% 年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

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 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	134,786,890.23	312,135.57	427,268,320.56	2,032,156.75

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（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	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

				型					
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	1,837	42,642.25	29,649.18
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	佳缘科技	2022年01月07日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28
301123	奕东电子	2022年01月14日	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84
301113	瑞	202	6	新	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88

5	德智能	2年 04月 01日	个月	股 流 通 受 限						
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 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 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 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 30日	6个 个月	新 股 流 通 受 限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	
301181	标榜股	2022年 02月	6个 个月	新 股 流	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	

	份	月		通					
		11		受					
		日		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
301200	大族数控	2022年02月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44
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
301207	华兰疫苗	2022年02月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98
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

		日		限					
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
301235	华康医疗	2022年01月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74
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
60093	中	202	6	新	10.80	15.86	84,00	907,243.20	1,332,303.4

8	国海油	2年04月14日	个月	股流通受限			4		4
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
688170	德龙激光	2022年04月22日	6个月	新股流通受限	30.18	47.04	6,175	186,361.50	290,472.00
688173	希荻微	2022年01月13日	6个月	新股流通受限	33.57	31.62	4,236	142,202.52	133,942.32
688234	天岳先进	2022年01月05日	6个月	新股流通受限	82.79	65.19	6,759	559,577.61	440,619.21
688237	超卓航科	2022年06月24日	5个交易日	新股流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57
688267	中触媒	2022年02月09日	6个月	新股流通受限	41.90	31.90	3,390	142,041.00	108,141.00
688337	普源精	2022年03	6个月	新股流	60.88	51.03	6,563	399,555.44	334,909.89

	电	月 30 日		通 受 限						
688400	凌云光	2022年 06月 27日	6 个月	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
118008	海优转债	2022年 06月 24日	1 9 个 交 易 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.01	16,660	1,666,000.00	1,666,087.64	
127064	杭氧转债	2022年 05月 19日	3 2 个 交 易 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.02	7,752	775,200.00	775,346.12	
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 612 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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 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。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和

款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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 202 2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	134,786,890. 23	-	-	-	-	-	134,786,890.23
结 算 备 付 金	3,479,952.94	-	-	-	-	-	3,479,952.94
存 出 保 证 金	537,208.50	-	-	-	-	-	537,208.50
交 易 性 金 融 资 产	32,609,578.0 8	-	2,441,433.7 6	-	-	2,480,312,528. 11	2,515,363,539. 95
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
买 入 返 售 金	-	-	-	-	-	-	-

融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	16,686,283.23	16,686,283.23
应收股利	-	-	-	-	-	4,657,993.04	4,657,993.04
应收申购款	-	-	-	-	-	458,087.92	458,087.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	171,413,629.75	-	2,441,433.76	-	-	2,502,114,892.30	2,675,969,955.81
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	-	-	-	-	-	211.05	211.05
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,015,787.02	1,015,787.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,084,301.15	3,084,301.15
应付托管费	-	-	-	-	-	514,050.18	514,050.18
应付	-	-	-	-	-	15,950.83	15,950.83

销售服务费							
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	6.23	6.23
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,275,914.99	2,275,914.99
负债总计	-	-	-	-	-	6,906,221.45	6,906,221.45
利率敏感度缺口	171,413,629.75	-	2,441,433.76	-	-	2,495,208,670.85	2,669,063,734.36
上年	1个月以内	1-	3个月-1年	1-	5年	不计息	合计

度末 2021年 12月 31日		3 个月		5 年	以 上		
资产							
银行存款	245,019,008.63	-	-	-	-	-	245,019,008.63
结算备付金	14,509,432.68	-	-	-	-	-	14,509,432.68
存出保证金	1,456,137.57	-	-	-	-	-	1,456,137.57
交易性金融资产	-	-	11,982,000.00	-	-	3,051,631,576.98	3,063,613,576.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	147,438.32	147,438.32
资产总计	260,984,578.88	-	11,982,000.00	-	-	3,051,779,015.30	3,324,745,594.18
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	-	-	-	-	-	44,009,284.71	44,009,284.71
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	4,270,259.12	4,270,259.12
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	711,709.84	711,709.84
应 付 销 售	-	-	-	-	-	21,140.42	21,140.42

服务费							
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	5.89	5.89
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	4,436,905.90	4,436,905.90
负债总计	-	-	-	-	-	53,449,305.88	53,449,305.88
利率敏感度缺口	260,984,578.88	-	11,982,000.00	-	-	2,998,329,709.42	3,271,296,288.30

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	4,817.69	16,485.89
基准利率增加 25 个基点	-4,816.23	-16,440.64	

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	-	957,740,549.27	-	957,740,549.27
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	4,657,993.04	-	4,657,993.04
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	962,398,542.31	-	962,398,542.31
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	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债	-	962,398,542.31	-	962,398,542.31

表外汇风险敞口净额				
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	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	891,902,421.03	-	891,902,421.03
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	891,902,421.03	-	891,902,421.03
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	-	-	-	-
应付赎回	-	-	-	-

款				
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	891,902,421.03	-	891,902,421.03

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
	港币相对人民币升值 5%	48,119,927.12	44,595,121.05
港币相对人民币贬值 5%	-48,119,927.12	-44,595,121.05	

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。

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	2,480,312,528.11	92.93	3,051,631,576.98	93.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	35,051,011.84	1.31	11,982,000.00	0.37
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,515,363,539.95	94.24	3,063,613,576.98	93.65

股票资产占基金资产的比例不低于 60%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	171,201,130.24	154,599,223.89
	沪深 300 指数下跌 5%	-171,201,130.24	-154,599,223.89

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	2,470,897,737.79
第二层次	36,177,318.25
第三层次	8,288,483.91
合计	2,515,363,539.95

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,480,312,528.11	92.69
	其中：股票	2,480,312,528.11	92.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,051,011.84	1.31
	其中：债券	35,051,011.84	1.31
	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	138,266,843.17	5.17
8	其他各项资产	22,339,572.69	0.83
9	合计	2,675,969,955.81	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 957,740,549.27 元，占期末净值比例为 35.88%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	26,641,780.00	1.00
B	采矿业	1,960,520.89	0.07
C	制造业	1,054,523,006.29	39.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	65,796,401.16	2.47
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,326,285.61	1.02
J	金融业	168,947,183.80	6.33
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	110,106,011.00	4.13
M	科学研究和技术服务业	15,854.74	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	67,045,314.66	2.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,522,571,978.84	57.05

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	17,719,536.80	0.66
15 原材料	25,193,897.40	0.94
20 工业	-	-
25 可选消费	364,210,532.14	13.65
30 日常消费	90,797,916.83	3.40
35 医疗保健	349,018,812.98	13.08
40 金融	-	-
45 信息技术	12,969,469.46	0.49
50 电信服务	25,353,031.16	0.95
55 公用事业	42,588,462.00	1.60
60 房地产	29,888,890.50	1.12
合计	957,740,549.27	35.88

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	03690	美团-W	1,447,400	240,381,149.57	9.01
2	02269	药明生物	3,180,000	195,260,401.56	7.32
3	601888	中国中	472,700	110,106,011.00	4.13

		免			
4	600519	贵州茅台	50,000	102,250,000.00	3.83
5	002142	宁波银行	2,589,980	92,747,183.80	3.47
6	601012	隆基绿能	1,259,972	83,951,934.36	3.15
7	02331	李宁	1,282,500	79,735,991.42	2.99
8	300122	智飞生物	699,939	77,700,228.39	2.91
9	000568	泸州老窖	312,300	76,994,442.00	2.88
10	300059	东方财富	3,000,000	76,200,000.00	2.85
11	002557	洽洽食品	1,282,827	73,031,341.11	2.74
12	603568	伟明环保	2,000,600	66,760,022.00	2.50
13	300755	华致酒行	1,500,000	65,775,000.00	2.46
14	600096	云天化	2,000,000	62,960,000.00	2.36
15	688390	固德威	200,000	62,602,000.00	2.35
16	603799	华友钴业	650,000	62,153,000.00	2.33
17	300171	东富龙	1,580,000	53,577,800.00	2.01
18	300750	宁德时代	100,000	53,400,000.00	2.00
19	002541	鸿路钢构	1,559,974	52,103,131.60	1.95
20	00168	青岛啤酒股份	708,000	49,406,720.83	1.85
21	688356	键凯科技	202,917	49,067,359.77	1.84
22	300014	亿纬锂能	500,000	48,750,000.00	1.83
23	06127	昭衍新药	812,700	45,940,353.55	1.72
24	02380	中国电力	10,000,000	42,588,462.00	1.60
25	06969	思摩尔国际	2,000,000	41,391,196.00	1.55
26	688680	海优新材	201,780	40,093,686.00	1.50

27	603198	迎驾贡酒	600,000	39,084,000.00	1.46
28	09969	诺诚健华-B	2,795,000	31,981,625.95	1.20
29	002518	科士达	999,987	30,599,602.20	1.15
30	06098	碧桂园服务	1,000,000	29,888,890.50	1.12
31	600563	法拉电子	141,800	29,091,688.00	1.09
32	603477	巨星农牧	1,111,000	26,641,780.00	1.00
33	01024	快手-W	339,200	25,353,031.16	0.95
34	00189	东岳集团	3,000,000	25,193,897.40	0.94
35	01548	金斯瑞生物科技	1,000,000	24,330,155.50	0.91
36	09995	荣昌生物-B	622,500	23,397,036.31	0.88
36	688331	荣昌生物	15,915	744,185.40	0.03
37	600765	中航重机	699,901	22,522,814.18	0.84
38	300682	朗新科技	860,267	21,670,125.73	0.81
39	00883	中国海洋石油	2,000,000	17,719,536.80	0.66
39	600938	中国海油	120,005	1,960,520.89	0.07
40	01877	君实生物	500,000	18,065,888.75	0.68
41	09992	泡泡玛特	500,000	16,205,850.50	0.61
42	01347	华虹半导体	534,000	12,969,469.46	0.49
43	002179	中航光电	200,000	12,664,000.00	0.47
44	00175	吉利汽车	814,000	12,418,863.93	0.47
45	01211	比亚迪股份	45,500	12,218,099.53	0.46
46	300666	江丰电子	200,000	12,200,000.00	0.46

47	02096	先声药业	1,000,000	7,354,634.00	0.28
48	002025	航天电器	100,000	6,982,000.00	0.26
49	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	0.20
50	09869	海伦司	210,000	3,250,577.19	0.12
51	06699	时代天使	20,000	2,688,717.36	0.10
52	688234	天岳先进	6,759	440,619.21	0.02
53	688337	普源精电	6,563	334,909.89	0.01
54	688170	德龙激光	6,175	290,472.00	0.01
55	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
56	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
57	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
58	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
59	688173	希荻微	4,236	133,942.32	0.01
60	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
61	688267	中触媒	3,390	108,141.00	0.00
62	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
63	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.00
64	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
65	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
66	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
67	301109	军信股份	1,837	29,649.18	0.00
68	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
69	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
70	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
71	301187	欧圣电	876	19,745.04	0.00

		气			
72	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
73	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
74	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
75	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
76	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
77	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
78	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
79	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
80	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
81	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
82	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
83	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
84	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
85	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
86	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	03690	美团-W	109,136,258.65	3.34
2	002557	洽洽食品	87,987,218.86	2.69
3	600519	贵州茅台	87,691,088.00	2.68
4	02331	李宁	74,024,951.02	2.26

5	300750	宁德时代	69,725,952.96	2.13
6	601012	隆基绿能	69,489,621.36	2.12
7	300059	东方财富	67,543,964.70	2.06
8	688356	键凯科技	66,250,634.50	2.03
9	600702	舍得酒业	66,102,020.65	2.02
10	688680	海优新材	66,088,557.87	2.02
11	01024	快手-W	65,468,117.84	2.00
12	01171	兖矿能源	64,644,555.93	1.98
13	00688	中国海外发展	64,340,053.75	1.97
14	600096	云天化	61,379,263.64	1.88
15	300274	阳光电源	59,810,364.00	1.83
16	02269	药明生物	57,880,255.26	1.77
17	002541	鸿路钢构	56,309,029.60	1.72
18	300014	亿纬锂能	55,016,954.00	1.68
19	603198	迎驾贡酒	53,224,871.80	1.63
20	688390	固德威	52,357,102.60	1.60

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	01024	快手-W	140,536,989.78	4.30
2	603501	韦尔股份	133,648,073.50	4.09
3	000568	泸州老窖	116,889,687.72	3.57
4	00700	腾讯控股	111,234,305.38	3.40
5	002466	天齐锂业	101,622,229.52	3.11
6	600702	舍得酒业	99,388,970.61	3.04
7	01171	兖矿能源	87,449,057.26	2.67
8	603348	文灿股份	79,695,367.53	2.44
9	603799	华友钴业	74,992,778.50	2.29
10	002142	宁波银行	70,288,608.99	2.15
11	300122	智飞生物	69,542,345.52	2.13
12	00916	龙源电力	65,657,204.01	2.01
13	300274	阳光电源	62,389,812.98	1.91
14	688680	海优新材	61,931,616.62	1.89
15	300715	凯伦股份	58,605,471.63	1.79
16	00688	中国海外发展	57,818,035.63	1.77

17	688598	金博股份	56,506,340.20	1.73
18	300413	芒果超媒	54,522,436.85	1.67
19	300033	同花顺	53,664,379.36	1.64
20	06098	碧桂园服务	52,556,472.99	1.61

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,499,793,526.50
卖出股票收入（成交）总额	2,629,209,630.26

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	32,609,578.08	1.22
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）	2,441,433.76	0.09
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	35,051,011.84	1.31

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019658	21 国债 10	320,000	32,609,578.08	1.22
2	118008	海优转债	16,660	1,666,087.64	0.06
3	127064	杭氧转	7,752	775,346.12	0.03

		债			
--	--	---	--	--	--

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，美团、宁波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。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	537,208.50
2	应收清算款	16,686,283.23
3	应收股利	4,657,993.04
4	应收利息	-
5	应收申购款	458,087.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	22,339,572.69
---	----	---------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
汇添富价值成长均衡投资混合 A	29,076	115,450.19	992,102.38	0.03	3,355,837,683.54	99.97
汇添富价值成长均衡投	1,193	36,846.22	0.00	0.00	43,957,536.73	100.00

资 混 合 C						
合 计	30,269	112,352.15	992,102.38	0.03	3,399,795,220.27	99.97

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	汇添富价值成长 均衡投资混合 A	4,382,076.32	0.13
	汇添富价值成长 均衡投资混合 C	16,984.41	0.04
	合计	4,399,060.73	0.13

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持有 本开放式基金	汇添富价值成长均衡投资 混合 A	0
	汇添富价值成长均衡投资 混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	汇添富价值成长均衡投资 混合 A	>100
	汇添富价值成长均衡投资 混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富价值成长均衡投资混合 A	汇添富价值成长均衡投资混 合 C
基金合同生效日 （2021 年 02 月 05 日）基金份额总额	4,356,652,046.04	55,738,934.89
本报告期初基金份	3,544,447,335.32	45,185,556.09

额总额		
本报告期基金总申购份额	50,799,612.99	3,727,696.18
减：本报告期基金总赎回份额	238,417,162.39	4,955,715.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,356,829,785.92	43,957,536.73

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。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
安信证券	2	795,337,110.50	15.56	615,395.45	16.18	
开源证券	2	688,357,215.42	13.47	514,870.22	13.54	
中信证券	2	585,713,098.63	11.46	423,212.37	11.13	
中信建投证券	2	411,768,455.91	8.06	308,704.75	8.12	
东方财富	2	371,326,019.78	7.27	318,823.41	8.38	
国泰君安	2	350,191,961.16	6.85	261,297.66	6.87	
东方证券	2	346,477,854.23	6.78	271,033.69	7.13	
广发证券	4	340,623,750.02	6.66	188,607.51	4.96	
国金证券	2	301,294,386.45	5.90	219,133.22	5.76	
天风证券	2	234,071,912.39	4.58	176,132.40	4.63	
国信证券	2	188,036,106.97	3.68	138,704.47	3.65	
申万宏源证券	2	153,264,186.37	3.00	109,132.88	2.87	
东北证券	2	152,778,376.59	2.99	114,129.89	3.00	

海通证券	2	120,637,853.05	2.36	91,395.59	2.40	
华安证券	2	71,120,535.17	1.39	51,872.23	1.36	
北京高华	2	-	-	-	-	
财达证券	2	-	-	-	-	
德邦证券	2	-	-	-	-	
民生证券	2	-	-	-	-	
招商证券	3	-	-	-	-	
中原证券	2	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	10,007,978.14	50.00	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	10,007,379.00	50.00	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京 高华	-	-	-	-	-	-	-	-
财达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

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

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

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

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

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理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：

本基金本报告期内新增 3 家证券公司的 5 个交易单元：民生证券（深交所单元，上交所单元）、招商证券（新三板单元）、华安证券（上交所单元，深交所单元）。

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, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 22 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于在直销中心开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 28 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金在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 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