

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 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 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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	55
7.1 期末基金资产组合情况	55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	81
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	83
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	83
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	83
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	83
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	84

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	84
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	84
7.12 投资组合报告附注.....	84
§ 8 基金份额持有人信息	85
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	85
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	86
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	86
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	87
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	87
§ 9 开放式基金份额变动	87
§ 10 重大事件揭示	87
10.1 基金份额持有人大会决议.....	88
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.....	88
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	88
10.4 基金投资策略的改变.....	88
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	88
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.....	88
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	88
10.8 其他重大事件.....	89
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
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.....	90
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
§ 12 备查文件目录	90
12.1 备查文件目录.....	90
12.2 存放地点	90
12.3 查阅方式	91

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)	
基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF)	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 08 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	254,880,400.20	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额 (份)	160,517,752.82	94,362,647.38

注: 本基金 A 类份额的扩位证券简称为中证 500LOF; C 类份额的扩位证券简称为中证 500LOFC。

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95565
传真	021-28932998	0755-82960794
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	深圳市福田区福华一路111号
办公地址	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼	深圳市福田区福华一路111号
邮政编码	200120	518000
法定代表人	李文	霍达

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日 - 2021年06月30日)	
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	22,067,077.78	12,697,187.49
本期利润	18,676,717.33	10,470,477.43
加权平均基金份额本期利润	0.1077	0.1058

本期加权平均净值利润率	9.63%	9.53%
本期基金份额净值增长率	9.86%	9.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)	
期末可供分配利润	32,077,694.75	17,879,385.41
期末可供分配基金份额利润	0.1998	0.1895
期末基金资产净值	192,595,447.57	112,242,032.79
期末基金份额净值	1.1998	1.1895
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	19.98%	18.95%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 500 指数 (LOF) A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.12%	0.71%	1.12%	0.69%	1.00%	0.02%
过去三个月	10.98%	0.65%	8.41%	0.65%	2.57%	0.00%
过去六个月	9.86%	0.94%	6.61%	0.94%	3.25%	0.00%
过去一年	26.22%	1.17%	15.35%	1.19%	10.87%	-0.02%
过去三年	47.45%	1.38%	29.32%	1.40%	18.13%	-0.02%
自基金	19.98%	1.33%	7.58%	1.35%	12.40%	-0.02%

合同生效日起至今						
汇添富中证 500 指数 (LOF) C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.10%	0.71%	1.12%	0.69%	0.98%	0.02%
过去三个月	10.92%	0.65%	8.41%	0.65%	2.51%	0.00%
过去六个月	9.73%	0.94%	6.61%	0.94%	3.12%	0.00%
过去一年	25.91%	1.17%	15.35%	1.19%	10.56%	-0.02%
过去三年	46.38%	1.38%	29.32%	1.40%	17.06%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	18.95%	1.33%	7.58%	1.35%	11.37%	-0.02%

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

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



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



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

§ 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。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

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

2021 上半年，汇添富基金新成立 21 只公开募集证券投资基金，包括 7 只股票型基金、13 只混合型基金、1 只债券型基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 189 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理，指数与量化投资部副总监	2017 年 08 月 10 日		15	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月

					<p>加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经</p>
--	--	--	--	--	---

				<p>理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指</p>
--	--	--	--	--

					<p>数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。</p> <p>2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 9 月 24 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2019 年 11 月 6 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2020 年 3 月 5 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人进一步完善了公司内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统中的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的溢价率进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，国内经济持续保持较高的景气度，企业经营状况改善，利润持续增长。大宗商品价格整体上涨，PPI 上行，通胀预期先升后降，整体通胀压力不大。在经济复苏背景下，实体融资需求旺盛，货币政策逐步常态化。

行业角度，新能源汽车、光伏、半导体、生物科技等新兴产业维持高景气，但估值相对较高，价格波动加大；与此同时，原材料价格上涨，叠加“碳中和”背景下的落后产能淘汰预期，周期性行业出现估值修复。

从风格方面来看，上半年市场风格波动较大，春节前侧重核心资产，之后转向价值，二季度成长风格鲜明，核心资产内部出现明显的分化。整体而言，上半年市场风格有以下特点，首先市场风险偏好提升，小市值、高 Beta、低 PB 风格表现较好，而风险规避类的质量因子表现一般；其次，趋势风格整体占优，以动量为代表的价格趋势以及以成长为代表的基本面趋势策略表现好；其三，投资的快逻辑优于慢逻辑，投资者更侧重短期的业绩弹性和财报超预期，对公司质地、竞争壁垒和盈利稳定性的要求有所弱化。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。权益投资仓位报告期内基本保持在 90%~95%之间，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期 A 类基金份额净值增长率为 9.86%；C 类基金份额净值增长率为 9.73%。同期业绩比较基准收益率为 6.61%。

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，国内经济仍将富有韧性，经济增速整体保持稳健。货币政策方面延续宽货币、紧信用的组合，流动性保持相对稳定。海外随着经济的逐步复苏，政策也将逐步回归常态化，在长期的宽松刺激政策后，美联储货币政策的转向可能带来市场预期的反复波动。

在当前的经济及货币政策组合下，出现单边趋势性行情的概率不大，下半年预计仍然以结构性行情为主。风格角度，下半年可能延续成长风格，但整体将表现得更为均衡。行业方面，上半年的 A 股市场呈现极强的结构性行情特征，行业估值分化程度处于较高的水平。部分行业估值高企，需要充分的业绩增长给予支撑，对短期业绩及外部扰动的敏感性日益提升；同时部分价值型行业已具备较好的左侧配置性价比。在此背景下，估值相对合理、行业配置均衡的中证 500 指数会有较好的配置价值。

汇添富中证 500 指数基金是跟踪中证 500 指数的基金产品，覆盖面广、结构均衡，是权

益资产的基础性配置工具,在投资运作上将严格遵守基金合同,坚持既定的投资策略,积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差,实现投资目标。

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

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 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

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

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

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,356,228.71	20,888,653.49
结算备付金		6,932,480.47	5,773,821.61
存出保证金		1,582,900.74	1,599,428.82
交易性金融资产	6.4.7.2	288,435,432.49	316,153,731.61
其中：股票投资		278,936,972.49	315,194,074.37
基金投资		-	-
债券投资		9,498,460.00	959,657.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	179,299.87	34,362.26
应收股利		-	-

应收申购款		4,503,933.55	1,550,344.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		309,990,275.83	346,000,342.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,697,622.34	3,651,193.19
应付管理人报酬		121,814.21	154,233.88
应付托管费		24,362.84	30,846.79
应付销售服务费		22,324.62	28,348.81
应付交易费用	6.4.7.7	152,605.09	163,030.99
应交税费		19,959.41	2.67
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	114,106.96	219,016.12
负债合计		5,152,795.47	4,246,672.45
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	254,880,400.20	313,853,303.79
未分配利润	6.4.7.1 0	49,957,080.16	27,900,366.00
所有者权益合计		304,837,480.36	341,753,669.79
负债和所有者权益总计		309,990,275.83	346,000,342.24

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 254,880,400.20 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.1998 元，基金份额总额 160,517,752.82 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.1895 元，基金份额总额 94,362,647.38 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
一、收入		30,846,060.87	49,685,091.72

1. 利息收入		509,593.18	561,896.98
其中：存款利息收入	6.4.7.11	117,389.66	275,412.28
债券利息收入		136,032.00	10,239.02
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		256,171.52	276,245.68
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,921,966.25	27,948,147.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	32,607,739.84	23,825,239.29
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	152,101.94	119,371.55
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	891,223.30	1,075,555.55
股利收益	6.4.7.17	2,270,901.17	2,927,980.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-5,617,070.51	21,107,096.23
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	31,571.95	67,951.38
减：二、费用		1,698,866.11	2,447,000.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	755,466.25	1,108,161.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	151,093.28	221,632.22
3. 销售服务费		136,440.15	197,655.82
4. 交易费用	6.4.7.20	517,743.24	765,366.53
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3,208.80	3,873.28
7. 其他费用	6.4.7.21	134,914.39	150,311.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,147,194.76	47,238,090.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,147,194.76	47,238,090.81

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	313,853,303.79	27,900,366.00	341,753,669.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,147,194.76	29,147,194.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-58,972,903.59	-7,090,480.60	-66,063,384.19
其中:1.基金申购款	326,341,284.44	38,330,462.14	364,671,746.58
2.基金赎回款	-385,314,188.03	-45,420,942.74	-430,735,130.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	254,880,400.20	49,957,080.16	304,837,480.36
项目	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	509,151,036.15	-75,500,310.46	433,650,725.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	47,238,090.81	47,238,090.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-97,150,125.67	7,062,481.37	-90,087,644.30
其中:1.基金申购款	505,196,675.73	-61,538,687.61	443,657,988.12
2.基金赎回款	-602,346,801.40	68,601,168.98	-533,745,632.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-	-

净值变动 (净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	412,000,910.48	-21,199,738.28	390,801,172.20

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 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

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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

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

税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权

的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
活期存款	8,356,228.71
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	8,356,228.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	248,855,614.97	278,936,972.49	30,081,357.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,510,645.60	9,498,460.00
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	9,510,645.60	9,498,460.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	258,366,260.57	288,435,432.49	30,069,171.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,806,000.00	-	-	-
（股指期货投资）	8,806,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,806,000.00	-	-	-

注：本期末 2021 年 6 月 30 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量(买/卖)	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IC2112	7	8,806,000.00	9,129,680.00	323,680.00
总额合计：		323,680.00		
减：可抵销期货暂收款		323,680.00		
股指期货投资净额：		0.00		

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	3,061.90
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,437.89
应收债券利息	174,745.18
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	54.90
合计	179,299.87

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	152,605.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	152,605.09

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	14,928.01
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	114,106.96

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	188,653,666.27	188,653,666.27
本期申购	115,327,269.08	115,327,269.08
本期赎回 (以“-”号填列)	-143,463,182.53	-143,463,182.53
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	160,517,752.82	160,517,752.82
汇添富中证 500 指数 (LOF) C		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	125,199,637.52	125,199,637.52
本期申购	211,014,015.36	211,014,015.36
本期赎回 (以“-”号填列)	-241,851,005.50	-241,851,005.50
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	94,362,647.38	94,362,647.38

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,057,309.50	1,322,104.01	17,379,413.51
本期利润	22,067,077.78	-3,390,360.45	18,676,717.33
本期基金份额交易产生的变动数	-3,083,328.88	-895,107.21	-3,978,436.09
其中:基金申购款	15,832,424.89	-2,303,447.16	13,528,977.73
基金赎回款	-18,915,753.77	1,408,339.95	-17,507,413.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,041,058.40	-2,963,363.65	32,077,694.75
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,711,147.01	809,805.48	10,520,952.49
本期利润	12,697,187.49	-2,226,710.06	10,470,477.43
本期基金份额交易产生的变动数	-2,753,335.62	-358,708.89	-3,112,044.51
其中:基金申购款	29,575,417.28	-4,773,932.87	24,801,484.41
基金赎回款	-32,328,752.90	4,415,223.98	-27,913,528.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,654,998.88	-1,775,613.47	17,879,385.41

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	61,504.50
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	47,388.88
其他	8,496.28
合计	117,389.66

注:“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	189,753,950.65
减: 卖出股票成本总额	157,146,210.81
买卖股票差价收入	32,607,739.84

6.4.7.13 基金投资收益

注: 本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成交总额	2,321,110.21
减: 卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成本总额	2,142,791.30
减: 应收利息总额	26,216.97
买卖债券差价收入	152,101.94

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注: 本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注: 本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位: 人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	891,223.30
买卖权证差价收入应缴纳增值税	-
外汇远期投资收益	-
国债期货投资收益	-
外汇期货投资收益	-
卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	-

6.4.7.17 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

股票投资产生的股利收益	2,270,901.17
其中：证券出借权益补偿收入	124,829.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,270,901.17

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-5,837,630.51
——股票投资	-5,693,566.57
——债券投资	-144,063.94
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	220,560.00
——权证投资	-
——期货投资	220,560.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,617,070.51

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	31,571.95
替代损益	-
其他	-
合计	31,571.95

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	517,743.24
银行间市场交易费用	-
合计	517,743.24

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
----	-------------------------------

审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	5,516.79
指数使用费	30,218.65
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	134,914.39

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, 基金发起人
招商证券股份有限公司 (“招商证券”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构

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	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至
-----	--------------------------------	---------------------------

名称	月 30 日		2020 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 (%)
招商证券	311,825,759.78	100.00	457,776,056.22	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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 (%)
招商证券	12,924,698.92	100.00	7,609,526.90	100.00

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 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 (%)
招商证券	287,114.45	100.00	152,605.09	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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 (%)
招商证券	421,250.01	100.00	219,216.38	100.00

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	755,466.25	1,108,161.17
其中：支付销售机构的客户维护费	202,207.56	239,962.46

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	151,093.28	221,632.22

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务 费的各关联方 名称	本期 2021 年 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		
	汇添富中证 500 指	汇添富中证 500 指数	合计

	数 (LOF) A	(LOF) C	
汇添富基金管理股份有限公司	-	20,416.64	20,416.64
招商证券股份有限公司	-	99.90	99.90
东方证券股份有限公司	-	7,790.30	7,790.30
合计	-	28,306.84	28,306.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	40,999.21	40,999.21
招商证券股份有限公司	-	64.69	64.69
东方证券股份有限公司	-	23,691.89	23,691.89
合计	-	64,755.79	64,755.79

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

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

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

单位：人民币元

本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	-	-	-	-
上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	450,651,178.00	276,245.68	48,775,909.11	7,829.15

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

份额单位：份

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	10,002,700.27
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	10,002,700.27
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%)	-	3.71
汇添富中证 500 指数 (LOF) C		
项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金合同生效日 (2017 年	-	-

08 月 10 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%)	-	-

注: 基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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

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

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

6.4.12 期末 (2021 年 06 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

300996	普联软件	2021年05月26日	2021年12月03日	新股流通受限	20.81	42.23	217	4,515.77	9,163.91
300955	嘉亨家化	2021年03月16日	2021年09月24日	新股流通受限	16.53	46.07	203	3,355.59	9,352.21
300952	恒辉安防	2021年03月03日	2021年09月13日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20
300966	共同药业	2021年03月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44
300957	贝泰妮	2021年03月18日	2021年09月27日	新股流通受限	47.33	251.96	179	8,472.07	45,100.84
300945	曼卡龙	2021年02月03日	2021年08月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12
300950	德固特	2021年02月24日	2021年09月03日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47
300992	泰福	2021年	2021年	新股	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00

	泵业	05月17日	11月25日	流通受限						
300943	春晖智控	2021年02月03日	2021年08月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2021年07月05日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	
688681	科汇股份	2021年06月04日	2021年12月16日	新股流通受限	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	
301010	晶雪节能	2021年06月09日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	
300614	百川畅银	2021年05月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	
301018	申菱环境	2021年06月	2021年07月	新股流通	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	

		28 日	07 日	受 限						
688613	奥 精 医 疗	2021 年 05 月 13 日	2021 年 11 月 22 日	新 股 流 通 受 限	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	
688499	利 元 亨	2021 年 06 月 23 日	2021 年 07 月 01 日	新 股 流 通 受 限	38.85	38.85	2,116	82,206.60	82,206.60	
300973	立 高 食 品	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 15 日	新 股 流 通 受 限	28.28	115.71	219	6,193.32	25,340.49	
688667	菱 电 电 控	2021 年 03 月 03 日	2021 年 09 月 13 日	新 股 流 通 受 限	75.42	103.88	858	64,710.36	89,129.04	
688113	联 测 科 技	2021 年 04 月 26 日	2021 年 11 月 08 日	新 股 流 通 受 限	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	
301018	申 菱 环 境	2021 年 06 月 28 日	2022 年 01 月 07 日	新 股 流 通 受 限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	
301016	雷 尔 伟	2021 年 06 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新 股 流 通 受 限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	

300995	奇德新材	2021年05月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12
301011	华立科技	2021年06月09日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00
688226	威腾电气	2021年06月28日	2021年07月07日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06
300933	中辰股份	2021年01月15日	2021年07月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28
301021	英诺激光	2021年06月28日	2021年07月06日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14
300986	志特新材	2021年04月21日	2021年11月01日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48
300942	易瑞生物	2021年02月02日	2021年08月09日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36
300993	玉马	2021年	2021年	新股	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90

	遮阳	05月17日	11月24日	流通受限						
300971	博亚精工	2021年04月07日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	
300997	欢乐家	2021年05月26日	2021年12月02日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	
300929	华骐环保	2021年01月12日	2021年07月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	
300948	冠中生态	2021年02月18日	2021年08月25日	新股流通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	
605162	新中港	2021年06月29日	2021年07月07日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	
301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	
688680	海优新材	2021年01月	2021年07月	新股流通	69.94	243.61	1,297	90,712.18	315,962.17	

		15 日	22 日	受 限						
301007	德 迈 仕	2021 年 06 月 04 日	2021 年 12 月 16 日	新 股 流 通 受 限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	
605287	德 才 股 份	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 06 日	新 股 流 通 受 限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	
300972	万 辰 生 物	2021 年 04 月 08 日	2021 年 10 月 19 日	新 股 流 通 受 限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	
300982	苏 文 电 能	2021 年 04 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新 股 流 通 受 限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	
301012	扬 电 科 技	2021 年 06 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新 股 流 通 受 限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	
300981	中 红 医 疗	2021 年 04 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新 股 流 通 受 限	48.59	90.39	163	7,920.17	14,733.57	
301015	百 洋 医 药	2021 年 06 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新 股 流 通 受 限	7.64	38.83	459	3,506.76	17,822.97	

688660	电气风电	2021年05月11日	2021年11月19日	新股流通受限	5.44	7.26	14,483	78,787.52	105,146.58	
688087	英科再生	2021年06月30日	2021年07月09日	新股流通受限	21.96	21.96	1,777	39,022.92	39,022.92	
300930	屹通新材	2021年01月13日	2021年07月21日	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	
300958	建工修复	2021年03月18日	2021年09月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	
688628	优利德	2021年01月22日	2021年08月02日	新股流通受限	19.11	32.62	2,789	53,297.79	90,977.18	
300962	中金辐照	2021年03月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	
300967	晓鸣股份	2021年04月02日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代	证	成功	可流	流	认购价	期末估	数量	期末成本	期末估值总	备

码	券名称	认购日	通日	通受限类型	格	值单价	(单位:张)	总额	额	注
113051	节能转债	2021年06月22日	2021年07月22日	新债流通受限	100.00	100.00	800	80,000.00	80,000.00	

注: 本基金持有的流通受限股票“冠中生态”(证券代码: 300948) 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 108 股(根据冠中生态 2020 年年度权益分派实施公告, 冠中生态以公司现有总股本 93,340,000 股为基数, 向全体股东每 10 股派 0.80 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 2021 年 6 月 4 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年06月30日	重大资产重组	56.35	2021年07月01日	59.49	35,500	630,329.64	2,000,425.00	
600811	东方集团	2021年06月30日	重大资产重组	3.05	2021年07月14日	3.36	132,200	520,942.09	403,210.00	

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注: 截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形

成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险

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

除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外, 本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

本报告期内, 本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本 期 末 202 1 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	8,356,228.7	-	-	-	-	-	8,356,228.71

行存款	1						
结算备付金	6,932,480.47	-	-	-	-	-	6,932,480.47
存出保证金	122,151.94	-	-	-	-	1,460,748.80	1,582,900.74
交易性金融资产	2,798,000.00	-	6,700,460.00	-	-	278,936,972.49	288,435,432.49
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	179,299.87	179,299.87
应收申购款	825,884.14	-	-	-	-	3,678,049.41	4,503,933.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清	-	-	-	-	-	-	-

算款							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,034,745.26	-	6,700,460.00	-	-	284,255,070.57	309,990,275.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,697,622.34	4,697,622.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	121,814.21	121,814.21
应付托管费	-	-	-	-	-	24,362.84	24,362.84
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	22,324.62	22,324.62
应付交易费用	-	-	-	-	-	152,605.09	152,605.09
应交税费	-	-	-	-	-	19,959.41	19,959.41
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	114,106.96	114,106.96
负债总计	-	-	-	-	-	5,152,795.47	5,152,795.47
利率	19,034,745.26	-	6,700,460.00	-	-	279,102,275.10	304,837,480.36

敏 感 度 缺 口							
上 年 度 末 202 0 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1- 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	20,888,653.49	-	-	-	-	-	20,888,653.49
结 算 备 付 金	5,773,821.61	-	-	-	-	-	5,773,821.61
存 出 保 证 金	178,417.62	-	-	-	-	1,421,011.20	1,599,428.82
交 易 性 金 融 资 产	95,115.00	85,727.01	778,815.23	-	-	315,194,074.37	316,153,731.61
应 收 股 利	-	-	-	-	-	-	-
应 收	-	-	-	-	-	34,362.26	34,362.26

利息							
应收申购款	64,786.96	-	-	-	-	1,485,557.49	1,550,344.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	27,000,794.68	85,727.01	778,815.23	-	-	318,135,005.32	346,000,342.24
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,651,193.19	3,651,193.19
应	-	-	-	-	-	154,233.88	154,233.88

付 管 理 人 报 酬							
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	30,846.79	30,846.79
应 付 证 券 清 算 款	-	-	-	-	-	-	-
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	28,348.81	28,348.81
应 付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	163,030.99	163,030.99
应 交 税 费	-	-	-	-	-	2.67	2.67

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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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与可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30	上年度末 2020 年 12 月

		日	31 日
	基准利率减少 25 个基点	6,701.32	494.37
	基准利率增加 25 个基点	-6,688.93	-493.06

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	278,936,972.49	91.50	315,194,074.37	92.23
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	9,498,460.00	3.12	959,657.24	0.28
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	288,435,432.49	94.62	316,153,731.61	92.51

注：本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，
----	-------------------------------------

	本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	中证小盘 500 指数上涨 5%	14, 226, 561. 94	15, 774, 520. 37
	中证小盘 500 指数下跌 5%	-14, 226, 561. 94	-15, 774, 520. 37

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	278, 936, 972. 49	89. 98
	其中：股票	278, 936, 972. 49	89. 98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9, 498, 460. 00	3. 06
	其中：债券	9, 498, 460. 00	3. 06
	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	15, 288, 709. 18	4. 93
8	其他资产	6, 266, 134. 16	2. 02
9	合计	309, 990, 275. 83	100. 00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,678,721.00	0.88
B	采矿业	9,496,874.28	3.12
C	制造业	172,800,571.89	56.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,575,319.77	2.16
E	建筑业	5,054,275.44	1.66
F	批发和零售业	8,134,279.46	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	5,257,280.25	1.72
H	住宿和餐饮业	1,462,265.95	0.48
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,668,710.12	7.44
J	金融业	15,992,525.52	5.25
K	房地产业	8,788,663.80	2.88
L	租赁和商务服务业	3,334,269.60	1.09
M	科学研究和技术服务业	716,131.60	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	2,312,755.31	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	173,178.00	0.06
Q	卫生和社会工作	750,718.30	0.25
R	文化、体育和娱乐业	2,739,091.00	0.90
S	综合	2,422,707.80	0.79
	合计	271,358,339.09	89.02

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	102,316.18	0.03
B	采矿业	76,751.35	0.03
C	制造业	5,626,629.66	1.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,286.79	0.02
E	建筑业	184,996.72	0.06
F	批发和零售业	378,009.34	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	27,865.35	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	301,891.84	0.10
J	金融业	97,319.40	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.02
M	科学研究和技术服务业	286,173.60	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	359,928.81	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,578,633.40	2.49

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002709	天赐材料	25,816	2,751,469.28	0.90
2	000799	酒鬼酒	10,300	2,632,680.00	0.86
3	603486	科沃斯	10,320	2,353,785.60	0.77
4	600089	特变电工	167,400	2,151,090.00	0.71
5	000009	中国宝安	116,140	2,121,877.80	0.70
6	002340	格林美	215,600	2,015,860.00	0.66
7	002074	国轩高科	46,200	2,012,472.00	0.66
8	600460	士兰微	35,500	2,000,425.00	0.66
9	300285	国瓷材料	36,200	1,764,750.00	0.58
10	601233	桐昆股份	72,100	1,736,889.00	0.57
11	300207	欣旺达	49,700	1,618,232.00	0.53
12	002185	华天科技	98,800	1,520,532.00	0.50
13	600885	宏发股份	23,441	1,469,750.70	0.48
14	300316	晶盛机电	29,000	1,464,500.00	0.48
15	601636	旗滨集团	72,700	1,349,312.00	0.44
16	600733	北汽蓝	96,500	1,300,820.00	0.43

		谷			
17	300037	新宙邦	12,900	1,291,290.00	0.42
18	300146	汤臣倍健	38,300	1,260,070.00	0.41
19	300253	卫宁健康	76,900	1,251,163.00	0.41
20	002648	卫星石化	31,020	1,215,673.80	0.40
21	002625	光启技术	58,300	1,213,223.00	0.40
22	002223	鱼跃医疗	31,700	1,208,721.00	0.40
23	603737	三棵树	6,820	1,200,320.00	0.39
24	600884	杉杉股份	51,375	1,198,065.00	0.39
25	600219	南山铝业	322,900	1,162,440.00	0.38
26	601127	小康股份	17,401	1,160,124.67	0.38
27	002353	杰瑞股份	25,841	1,155,092.70	0.38
28	002138	顺络电子	29,100	1,128,207.00	0.37
29	600779	水井坊	8,800	1,111,880.00	0.36
30	603589	口子窖	16,200	1,096,578.00	0.36
31	000547	航天发展	57,900	1,092,573.00	0.36
32	002797	第一创业	151,400	1,080,996.00	0.35
33	600704	物产中大	137,000	1,078,190.00	0.35
34	000988	华工科技	45,300	1,065,456.00	0.35
35	300699	光威复材	14,000	1,063,300.00	0.35
36	002212	天融信	53,400	1,055,718.00	0.35
37	002444	巨星科技	30,900	1,053,072.00	0.35
38	603893	瑞芯微	7,500	1,045,950.00	0.34
39	688099	晶晨股份	9,307	1,044,245.40	0.34
40	601099	太平洋	307,500	1,042,425.00	0.34
41	002422	科伦药	51,400	1,025,430.00	0.34

		业			
42	601168	西部矿业	85,800	1,023,594.00	0.34
43	002385	大北农	149,200	1,014,560.00	0.33
44	603444	吉比特	1,900	1,007,000.00	0.33
45	000807	云铝股份	84,500	1,005,550.00	0.33
46	688002	睿创微纳	10,013	999,597.79	0.33
47	300308	中际旭创	25,700	989,964.00	0.32
48	002439	启明星辰	33,700	977,637.00	0.32
49	000636	风华高科	32,300	976,106.00	0.32
50	601117	中国化学	111,200	974,112.00	0.32
51	600862	中航高科	31,401	966,522.78	0.32
52	600563	法拉电子	6,101	966,154.36	0.32
53	000830	鲁西化工	51,493	964,463.89	0.32
54	600392	盛和资源	54,660	948,897.60	0.31
55	002078	太阳纸业	71,000	947,850.00	0.31
56	600754	锦江酒店	16,501	939,731.95	0.31
57	600486	扬农化工	8,400	938,868.00	0.31
58	002030	达安基因	44,195	938,701.80	0.31
59	002180	纳思达	29,000	933,800.00	0.31
60	600068	葛洲坝	124,500	932,505.00	0.31
61	600699	均胜电子	36,500	931,480.00	0.31
62	002250	联化科技	33,300	929,070.00	0.30
63	600315	上海家化	15,300	920,142.00	0.30
64	300088	长信科技	110,700	914,382.00	0.30

65	002507	涪陵榨菜	24,000	903,840.00	0.30
66	000630	铜陵有色	332,000	903,040.00	0.30
67	603605	珀莱雅	4,500	885,195.00	0.29
68	600201	生物股份	50,678	884,331.10	0.29
69	002013	中航机电	87,400	880,118.00	0.29
70	002075	沙钢股份	79,600	868,436.00	0.28
71	000039	中集集团	47,540	864,277.20	0.28
72	300223	北京君正	8,500	857,820.00	0.28
73	002127	南极电商	87,400	853,898.00	0.28
74	300001	特锐德	28,101	846,121.11	0.28
75	000513	丽珠集团	16,864	843,537.28	0.28
76	002028	思源电气	27,377	842,937.83	0.28
77	601997	贵阳银行	115,300	825,548.00	0.27
78	600177	雅戈尔	123,600	814,524.00	0.27
79	002511	中顺洁柔	29,479	812,146.45	0.27
80	002273	水晶光电	54,881	806,201.89	0.26
81	002299	圣农发展	33,700	804,756.00	0.26
82	601005	重庆钢铁	298,400	796,728.00	0.26
83	000021	深科技	41,600	796,224.00	0.26
84	002080	中材科技	30,300	792,951.00	0.26
85	600549	厦门钨业	37,800	787,374.00	0.26
86	002092	中泰化学	76,400	784,628.00	0.26
87	002603	以岭药业	26,900	784,404.00	0.26
88	600171	上海贝	25,700	782,051.00	0.26

		岭			
89	000739	普洛药业	26,600	782,040.00	0.26
90	300168	万达信息	53,500	781,100.00	0.26
91	600988	赤峰黄金	51,800	776,482.00	0.25
92	002465	海格通信	82,000	775,720.00	0.25
93	000050	深天马 A	54,700	775,646.00	0.25
94	300482	万孚生物	11,990	775,633.10	0.25
95	300618	寒锐钴业	9,800	772,632.00	0.25
96	300009	安科生物	51,676	769,972.40	0.25
97	600867	通化东宝	64,200	766,548.00	0.25
98	600516	方大炭素	102,900	765,576.00	0.25
99	600066	宇通客车	61,200	764,388.00	0.25
100	600536	中国软件	13,400	762,862.00	0.25
101	000825	太钢不锈	101,400	759,486.00	0.25
102	000983	山西焦煤	91,100	757,041.00	0.25
103	600637	东方明珠	92,400	756,756.00	0.25
104	300357	我武生物	11,800	756,616.00	0.25
105	601128	常熟银行	122,000	756,400.00	0.25
106	300244	迪安诊断	19,601	750,718.30	0.25
107	000998	隆平高科	46,800	750,672.00	0.25
108	600316	洪都航空	19,401	746,550.48	0.24
109	601689	拓普集团	19,898	744,782.14	0.24

110	300463	迈克生物	17,600	740,784.00	0.24
111	600879	航天电子	98,200	738,464.00	0.24
112	600418	江淮汽车	58,900	732,127.00	0.24
113	000750	国海证券	172,050	729,492.00	0.24
114	600487	亨通光电	63,900	728,460.00	0.24
115	600380	健康元	53,008	727,799.84	0.24
116	600529	山东药玻	21,400	726,530.00	0.24
117	000960	锡业股份	45,100	722,953.00	0.24
118	300070	碧水源	98,600	720,766.00	0.24
119	000932	华菱钢铁	109,080	719,928.00	0.24
120	600369	西南证券	147,800	719,786.00	0.24
121	600827	百联股份	35,700	719,355.00	0.24
122	002152	广电运通	55,200	719,256.00	0.24
123	000723	美锦能源	95,100	718,956.00	0.24
124	002373	千方科技	42,800	714,760.00	0.23
125	300271	华宇软件	36,900	710,325.00	0.23
126	002156	通富微电	29,500	709,180.00	0.23
127	300296	利亚德	90,500	707,710.00	0.23
128	600166	福田汽车	204,800	706,560.00	0.23
129	000975	银泰黄金	74,128	704,957.28	0.23
130	603290	斯达半导	2,200	704,000.00	0.23
131	002131	利欧股份	300,592	703,385.28	0.23
132	601615	明阳智能	43,400	702,646.00	0.23

133	600038	中直股份	13,300	701,442.00	0.23
134	600909	华安证券	125,670	699,981.90	0.23
135	688208	道通科技	8,000	695,920.00	0.23
136	300383	光环新网	48,000	690,720.00	0.23
137	002572	索菲亚	28,400	687,280.00	0.23
138	002690	美亚光电	12,200	680,272.00	0.22
139	002926	华西证券	70,100	675,063.00	0.22
140	600642	申能股份	109,300	671,102.00	0.22
141	601198	东兴证券	61,300	670,009.00	0.22
142	601866	中远海发	176,500	661,875.00	0.22
143	002065	东华软件	83,200	659,776.00	0.22
144	300115	长盈精密	32,020	659,612.00	0.22
145	300474	景嘉微	6,700	656,064.00	0.22
146	603260	合盛硅业	8,500	653,735.00	0.21
147	600271	航天信息	49,400	643,682.00	0.21
148	603156	养元饮品	22,500	643,050.00	0.21
149	002500	山西证券	95,810	642,885.10	0.21
150	000623	吉林敖东	41,400	641,286.00	0.21
151	600998	九州通	41,700	640,929.00	0.21
152	603638	艾迪精密	14,920	639,620.40	0.21
153	600415	小商品城	122,100	628,815.00	0.21
154	600895	张江高科	34,400	628,488.00	0.21
155	601699	潞安环能	53,200	628,292.00	0.21

156	000012	南玻 A	61,065	625,305.60	0.21
157	300630	普利制药	11,875	622,250.00	0.20
158	600153	建发股份	76,400	618,840.00	0.20
159	002294	信立泰	18,600	611,940.00	0.20
160	600188	兖州煤业	39,700	609,792.00	0.20
161	600256	广汇能源	180,300	600,399.00	0.20
162	600707	彩虹股份	63,800	600,358.00	0.20
163	600390	五矿资本	100,100	598,598.00	0.20
164	300418	昆仑万维	36,500	597,870.00	0.20
165	600667	太极实业	65,600	596,960.00	0.20
166	600535	天士力	40,300	596,843.00	0.20
167	002372	伟星新材	28,780	594,882.60	0.20
168	300024	机器人	55,500	592,185.00	0.19
169	600008	首创环保	196,040	590,080.40	0.19
170	600060	海信视像	34,900	589,810.00	0.19
171	002670	国盛金控	51,598	587,701.22	0.19
172	600497	驰宏锌锗	135,900	585,729.00	0.19
173	000027	深圳能源	63,460	581,928.20	0.19
174	002557	洽洽食品	13,500	581,850.00	0.19
175	002382	蓝帆医疗	27,900	581,715.00	0.19
176	600208	新湖中宝	191,300	581,552.00	0.19
177	000878	云南铜业	45,300	581,199.00	0.19
178	600155	华创阳安	54,200	579,940.00	0.19

179	603858	步长制药	25,400	571,246.00	0.19
180	002019	亿帆医药	32,900	567,525.00	0.19
181	600765	中航重机	25,000	566,250.00	0.19
182	300251	光线传媒	52,200	564,282.00	0.19
183	600498	烽火通信	30,200	562,626.00	0.18
184	600511	国药股份	17,002	562,086.12	0.18
185	600141	兴发集团	29,840	561,887.20	0.18
186	002221	东华能源	51,300	561,735.00	0.18
187	002174	游族网络	32,600	559,742.00	0.18
188	000718	苏宁环球	67,500	559,575.00	0.18
189	600409	三友化工	55,100	557,061.00	0.18
190	002683	宏大爆破	20,000	555,400.00	0.18
191	600170	上海建工	198,100	546,756.00	0.18
192	002146	荣盛发展	96,700	545,388.00	0.18
193	002966	苏州银行	74,100	544,635.00	0.18
194	002506	协鑫集成	156,300	543,924.00	0.18
195	002390	信邦制药	51,900	543,912.00	0.18
196	000401	冀东水泥	44,000	543,400.00	0.18
197	000997	新大陆	32,700	542,493.00	0.18
198	600875	东方电气	49,400	541,918.00	0.18
199	601717	郑煤机	46,400	539,632.00	0.18
200	603866	桃李面包	17,228	537,513.60	0.18

201	300058	蓝色光标	88,700	536,635.00	0.18
202	600801	华新水泥	30,300	532,371.00	0.17
203	002408	齐翔腾达	42,800	531,576.00	0.17
204	600160	巨化股份	60,060	530,930.40	0.17
205	688029	南微医学	1,700	529,873.00	0.17
206	000738	航发控制	25,400	529,082.00	0.17
207	002958	青农商行	123,600	529,008.00	0.17
208	000686	东北证券	62,500	528,125.00	0.17
209	600258	首旅酒店	21,900	522,534.00	0.17
210	300315	掌趣科技	122,700	521,475.00	0.17
211	600663	陆家嘴	39,100	520,812.00	0.17
212	603707	健友股份	12,400	517,700.00	0.17
213	002195	二三四五	254,801	517,246.03	0.17
214	002268	卫士通	26,330	512,908.40	0.17
215	000540	中天金融	187,000	510,510.00	0.17
216	300017	网宿科技	87,200	510,120.00	0.17
217	600325	华发股份	75,300	507,522.00	0.17
218	603225	新凤鸣	24,920	505,876.00	0.17
219	600732	爱旭股份	36,200	503,904.00	0.17
220	000060	中金岭南	111,200	502,624.00	0.16
221	688321	微芯生物	10,862	501,715.78	0.16
222	688088	虹软科技	8,991	501,248.25	0.16
223	601016	节能风	133,800	500,412.00	0.16

		电			
224	601992	金隅集团	185,500	498,995.00	0.16
225	600027	华电国际	145,000	498,800.00	0.16
226	000961	中南建设	84,100	497,872.00	0.16
227	600859	王府井	17,202	496,793.76	0.16
228	600567	山鹰国际	143,800	496,110.00	0.16
229	002831	裕同科技	16,660	494,635.40	0.16
230	603712	七一二	13,700	494,570.00	0.16
231	603077	和邦生物	235,800	490,464.00	0.16
232	000158	常山北明	42,600	489,474.00	0.16
233	002429	兆驰股份	80,600	489,242.00	0.16
234	600282	南钢股份	136,900	487,364.00	0.16
235	603927	中科软	11,300	485,335.00	0.16
236	002191	劲嘉股份	45,600	485,184.00	0.16
237	600500	中化国际	61,500	483,390.00	0.16
238	600528	中铁工业	59,300	480,330.00	0.16
239	600216	浙江医药	30,000	480,300.00	0.16
240	601577	长沙银行	53,700	480,078.00	0.16
241	300212	易华录	17,780	478,459.80	0.16
242	603883	老百姓	9,082	478,439.76	0.16
243	600839	四川长虹	164,300	478,113.00	0.16
244	000671	阳光城	91,700	476,840.00	0.16
245	600737	中粮糖业	47,600	476,476.00	0.16
246	002595	豪迈科技	17,800	475,260.00	0.16
247	000898	鞍钢股	106,700	474,815.00	0.16

		份			
248	002056	横店东磁	36,500	474,500.00	0.16
249	002081	金螳螂	59,700	472,824.00	0.16
250	600598	北大荒	31,600	472,736.00	0.16
251	603198	迎驾贡酒	10,600	469,580.00	0.15
252	000999	华润三九	17,400	465,450.00	0.15
253	000709	河钢股份	189,000	464,940.00	0.15
254	000581	威孚高科	22,300	464,509.00	0.15
255	600580	卧龙电驱	34,900	464,170.00	0.15
256	600728	佳都科技	62,500	463,125.00	0.15
257	002203	海亮股份	43,500	462,840.00	0.15
258	002124	天邦股份	65,400	458,454.00	0.15
259	002281	光迅科技	18,605	457,683.00	0.15
260	300182	捷成股份	91,600	457,084.00	0.15
261	600808	马钢股份	106,200	455,598.00	0.15
262	000729	燕京啤酒	62,700	453,948.00	0.15
263	002010	传化智联	58,800	453,348.00	0.15
264	000930	中粮科技	49,800	448,698.00	0.15
265	300166	东方国信	35,993	444,873.48	0.15
266	002387	维信诺	42,600	444,318.00	0.15
267	600820	隧道股份	83,900	443,831.00	0.15
268	000488	晨鸣纸业	54,500	443,630.00	0.15
269	002745	木林森	33,000	442,200.00	0.15
270	002396	星网锐	20,700	441,945.00	0.14

		捷			
271	002242	九阳股份	13,601	441,896.49	0.14
272	002004	华邦健康	70,500	437,805.00	0.14
273	000629	攀钢钒钛	191,100	437,619.00	0.14
274	002048	宁波华翔	22,300	434,850.00	0.14
275	002563	森马服饰	36,000	430,200.00	0.14
276	600755	厦门国贸	51,900	426,099.00	0.14
277	600970	中材国际	46,400	425,488.00	0.14
278	300002	神州泰岳	87,200	422,920.00	0.14
279	603000	人民网	24,600	422,874.00	0.14
280	600022	山东钢铁	243,600	418,992.00	0.14
281	600803	新奥股份	25,300	417,703.00	0.14
282	600398	海澜之家	57,600	417,024.00	0.14
283	600037	歌华有线	43,300	416,113.00	0.14
284	000598	兴蓉环境	79,700	415,237.00	0.14
285	601106	中国一重	122,100	413,919.00	0.14
286	600881	亚泰集团	144,600	412,110.00	0.14
287	002925	盈趣科技	10,380	403,885.80	0.13
288	600811	东方集团	132,200	403,210.00	0.13
289	002002	鸿达兴业	102,100	401,253.00	0.13
290	603885	吉祥航空	26,200	399,812.00	0.13
291	600039	四川路桥	63,700	399,399.00	0.13
292	601880	辽港股	233,200	398,772.00	0.13

		份			
293	000883	湖北能源	86,800	398,412.00	0.13
294	601456	国联证券	25,800	397,320.00	0.13
295	600348	华阳股份	53,500	396,970.00	0.13
296	000778	新兴铸管	106,500	396,180.00	0.13
297	600782	新钢股份	70,900	395,622.00	0.13
298	000690	宝新能源	77,400	395,514.00	0.13
299	000887	中鼎股份	32,600	393,808.00	0.13
300	600260	凯乐科技	44,300	393,384.00	0.13
301	600597	光明乳业	27,200	391,952.00	0.13
302	601118	海南橡胶	76,100	387,349.00	0.13
303	002701	奥瑞金	75,300	387,042.00	0.13
304	002249	大洋电机	73,700	386,925.00	0.13
305	002705	新宝股份	14,700	385,875.00	0.13
306	002867	周大生	19,500	385,515.00	0.13
307	600126	杭钢股份	75,120	385,365.60	0.13
308	600908	无锡银行	66,200	383,960.00	0.13
309	600967	内蒙一机	37,900	383,548.00	0.13
310	603568	伟明环保	16,707	381,420.81	0.13
311	002085	万丰奥威	68,100	381,360.00	0.13
312	600645	中源协和	16,608	381,153.60	0.13
313	600026	中远海能	61,700	380,072.00	0.12
314	600410	华胜天成	48,900	379,464.00	0.12

315	002183	怡亚通	66,100	378,753.00	0.12
316	600718	东软集团	38,700	378,486.00	0.12
317	000528	柳工	45,960	376,872.00	0.12
318	601179	中国西电	91,200	375,744.00	0.12
319	603650	彤程新材	7,800	375,180.00	0.12
320	600985	淮北矿业	30,500	372,405.00	0.12
321	600572	康恩贝	83,100	368,964.00	0.12
322	002110	三钢闽光	54,550	367,667.00	0.12
323	000877	天山股份	28,000	364,840.00	0.12
324	600167	联美控股	40,680	363,272.40	0.12
325	600446	金证股份	25,100	362,444.00	0.12
326	000970	中科三环	37,900	361,945.00	0.12
327	002368	太极股份	18,002	361,120.12	0.12
328	300072	三聚环保	62,700	359,898.00	0.12
329	000402	金融街	53,200	359,100.00	0.12
330	601200	上海环境	29,950	358,501.50	0.12
331	002266	浙富控股	71,700	357,783.00	0.12
332	600064	南京高科	38,440	357,107.60	0.12
333	600329	中新药业	12,700	356,743.00	0.12
334	002128	露天煤业	34,200	356,022.00	0.12
335	000089	深圳机场	45,600	354,312.00	0.12
336	601598	中国外运	70,100	354,005.00	0.12

337	000990	诚志股份	27,800	353,894.00	0.12
338	600517	国网英大	50,900	346,629.00	0.11
339	002985	北摩高科	3,500	341,250.00	0.11
340	300026	红日药业	80,200	340,850.00	0.11
341	000400	许继电气	26,900	340,554.00	0.11
342	600158	中体产业	29,800	340,018.00	0.11
343	003035	南网能源	33,700	334,978.00	0.11
344	000519	中兵红箭	30,900	331,248.00	0.11
345	600120	浙江东方	77,270	330,715.60	0.11
346	601718	际华集团	117,200	330,504.00	0.11
347	300376	易事特	41,100	330,444.00	0.11
348	601975	招商南油	153,900	329,346.00	0.11
349	002233	塔牌集团	31,801	326,914.28	0.11
350	000959	首钢股份	58,000	325,960.00	0.11
351	600507	方大特钢	47,949	325,094.22	0.11
352	600195	中牧股份	27,049	323,506.04	0.11
353	600307	酒钢宏兴	139,300	323,176.00	0.11
354	001914	招商积余	18,800	322,984.00	0.11
355	000090	天健集团	58,148	321,558.44	0.11
356	600376	首开股份	57,400	321,440.00	0.11
357	000685	中山公用	39,300	320,688.00	0.11
358	601333	广深铁路	150,900	319,908.00	0.10

359	601000	唐山港	131,830	317,710.30	0.10
360	002505	鹏都农牧	141,800	317,632.00	0.10
361	002440	闰土股份	35,750	316,387.50	0.10
362	600435	北方导航	39,700	315,218.00	0.10
363	000559	万向钱潮	58,800	312,228.00	0.10
364	600804	鹏博士	63,700	308,308.00	0.10
365	002839	张家港行	56,300	306,272.00	0.10
366	600643	爱建集团	43,300	302,234.00	0.10
367	600673	东阳光	67,000	300,830.00	0.10
368	300133	华策影视	50,700	300,144.00	0.10
369	600373	中文传媒	30,100	296,786.00	0.10
370	603228	景旺电子	11,301	296,086.20	0.10
371	601860	紫金银行	81,400	295,482.00	0.10
372	601991	大唐发电	110,300	291,192.00	0.10
373	000758	中色股份	61,300	291,175.00	0.10
374	000967	盈峰环境	42,200	289,914.00	0.10
375	002155	湖南黄金	37,400	289,850.00	0.10
376	601608	中信重工	77,200	288,728.00	0.09
377	002038	双鹭药业	27,348	287,974.44	0.09
378	600056	中国医药	23,700	287,955.00	0.09
379	600582	天地科技	73,600	287,040.00	0.09
380	002936	郑州银行	77,990	286,223.30	0.09
381	600266	城建发展	60,180	285,253.20	0.09

382	000563	陕国投 A	88,220	284,068.40	0.09
383	600388	龙净环保	33,300	283,716.00	0.09
384	000681	视觉中国	21,800	281,874.00	0.09
385	601098	中南传媒	31,900	281,358.00	0.09
386	600131	国网信通	21,200	280,688.00	0.09
387	300113	顺网科技	21,600	279,504.00	0.09
388	600095	湘财股份	23,800	278,698.00	0.09
389	601958	金钼股份	43,000	278,640.00	0.09
390	002416	爱施德	27,581	276,637.43	0.09
391	600928	西安银行	59,300	276,338.00	0.09
392	600062	华润双鹤	23,200	276,312.00	0.09
393	600901	江苏租赁	53,100	276,120.00	0.09
394	300741	华宝股份	5,400	273,888.00	0.09
395	003022	联泓新科	8,900	273,230.00	0.09
396	600959	江苏有线	89,000	271,450.00	0.09
397	300180	华峰超纤	54,800	271,260.00	0.09
398	600259	广晟有色	8,000	270,480.00	0.09
399	600649	城投控股	56,200	267,512.00	0.09
400	600094	大名城	70,900	267,293.00	0.09
401	002399	海普瑞	16,600	264,438.00	0.09
402	002458	益生股份	26,400	263,208.00	0.09
403	600776	东方通信	21,200	262,880.00	0.09
404	600006	东风汽车	35,600	259,880.00	0.09

405	601611	中国核 建	35,300	254,866.00	0.08
406	600556	天下秀	24,100	254,496.00	0.08
407	300257	开山股 份	17,601	252,926.37	0.08
408	600546	山煤国 际	35,200	252,736.00	0.08
409	600717	天津港	64,363	252,302.96	0.08
410	000028	国药一 致	6,601	249,781.84	0.08
411	002317	众生药 业	29,003	249,715.83	0.08
412	600633	浙数文 化	34,700	249,146.00	0.08
413	600729	重庆百 货	9,001	247,077.45	0.08
414	000717	韶钢松 山	53,800	246,942.00	0.08
415	600648	外高桥	16,600	245,348.00	0.08
416	601928	凤凰传 媒	33,900	242,046.00	0.08
417	002434	万里扬	29,800	241,678.00	0.08
418	600021	上海电 力	34,900	241,159.00	0.08
419	600863	内蒙华 电	103,400	240,922.00	0.08
420	000501	鄂武商 A	20,501	239,861.70	0.08
421	000078	海王生 物	73,400	239,284.00	0.08
422	601828	美凯龙	19,700	236,400.00	0.08
423	002375	亚厦股 份	29,800	236,016.00	0.08
424	000062	深圳华 强	13,940	235,725.40	0.08
425	600968	海油发 展	90,400	234,136.00	0.08
426	600835	上海机 电	14,304	232,440.00	0.08
427	002244	滨江集 团	55,300	231,707.00	0.08
428	605358	立昂微	2,000	231,160.00	0.08
429	002424	贵州百	31,400	231,104.00	0.08

		灵			
430	603355	莱克电气	3,601	224,090.23	0.07
431	000869	张裕 A	6,000	222,840.00	0.07
432	600623	华谊集团	25,200	222,012.00	0.07
433	600377	宁沪高速	22,000	214,720.00	0.07
434	600339	中油工程	74,500	211,580.00	0.07
435	600312	平高电气	36,199	211,402.16	0.07
436	600566	济川药业	11,800	211,220.00	0.07
437	600787	中储股份	39,100	208,403.00	0.07
438	002468	申通快递	27,200	207,264.00	0.07
439	002583	海能达	40,900	206,136.00	0.07
440	600639	浦东金桥	15,100	206,115.00	0.07
441	000031	大悦城	57,200	205,920.00	0.07
442	000826	启迪环境	38,200	204,370.00	0.07
443	601969	海南矿业	17,400	202,362.00	0.07
444	600823	世茂股份	50,000	202,000.00	0.07
445	601778	晶科科技	36,900	201,474.00	0.07
446	600466	蓝光发展	67,540	199,243.00	0.07
447	603317	天味食品	6,640	195,415.20	0.06
448	603888	新华网	9,201	194,785.17	0.06
449	002815	崇达技术	15,500	193,440.00	0.06
450	601298	青岛港	31,200	192,816.00	0.06
451	002532	天山铝业	22,700	190,453.00	0.06
452	000156	华数传媒	24,700	190,437.00	0.06

453	000937	冀中能源	47,100	185,103.00	0.06
454	002948	青岛银行	36,600	181,902.00	0.06
455	002635	安洁科技	12,402	181,441.26	0.06
456	000813	德展健康	39,900	181,146.00	0.06
457	000553	安道麦 A	19,300	178,911.00	0.06
458	002302	西部建设	22,400	176,960.00	0.06
459	601228	广州港	55,100	175,218.00	0.06
460	300010	豆神教育	30,900	175,203.00	0.06
461	603377	东方时尚	16,200	173,178.00	0.06
462	600640	号百控股	14,101	171,891.19	0.06
463	600350	山东高速	27,800	170,970.00	0.06
464	603515	欧普照明	6,650	170,705.50	0.06
465	001872	招商港口	10,000	169,200.00	0.06
466	601139	深圳燃气	25,600	167,936.00	0.06
467	000061	农产品	30,200	166,704.00	0.05
468	600871	石化油服	84,500	166,465.00	0.05
469	000046	泛海控股	69,300	159,390.00	0.05
470	002653	海思科	7,100	152,792.00	0.05
471	603379	三美股份	8,100	151,551.00	0.05
472	601568	北元集团	17,600	150,656.00	0.05
473	603056	德邦股份	13,701	150,573.99	0.05
474	603786	科博达	1,900	143,450.00	0.05
475	002419	天虹股份	21,300	139,728.00	0.05
476	002901	大博医	1,900	138,491.00	0.05

		疗			
477	601003	柳钢股份	22,800	134,520.00	0.04
478	601512	中新集团	13,300	132,468.00	0.04
479	600657	信达地产	38,000	132,240.00	0.04
480	601869	长飞光纤	5,400	131,544.00	0.04
481	000537	广宇发展	24,800	129,704.00	0.04
482	601801	皖新传媒	26,500	125,080.00	0.04
483	601187	厦门银行	12,900	122,292.00	0.04
484	603983	丸美股份	2,300	119,853.00	0.04
485	002946	新乳业	7,700	116,655.00	0.04
486	600917	重庆燃气	13,902	113,579.34	0.04
487	603719	良品铺子	2,400	108,000.00	0.04
488	600903	贵州燃气	10,100	92,920.00	0.03
489	603868	飞科电器	2,100	88,326.00	0.03
490	002818	富森美	6,610	79,716.60	0.03
491	002423	中粮资本	8,200	74,210.00	0.02
492	600956	新天绿能	6,233	72,988.43	0.02
493	603256	宏和科技	7,800	71,292.00	0.02
494	601068	中铝国际	13,600	46,920.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
----	------	------	--------	----------	----------------------

1	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.13
2	688680	海优新材	1,297	315,962.17	0.10
3	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.09
4	301015	百洋医药	4,588	249,707.61	0.08
5	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.07
6	688161	威高骨科	1,783	189,087.15	0.06
7	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.06
8	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.06
9	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.06
10	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.05
11	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.05
12	688315	诺禾致源	3,162	154,305.60	0.05
13	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.05
14	300884	狄耐克	5,227	140,501.76	0.05
15	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.04
16	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.04
17	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.04
18	300996	普联软件	2,169	119,237.19	0.04
19	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.04
20	688345	博力威	1,565	115,105.75	0.04
21	300962	中金辐照	4,957	114,573.12	0.04
22	300966	共同药业	2,558	112,873.56	0.04
23	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.04
24	688660	电气风电	14,483	105,146.58	0.03
25	688636	智明达	918	97,583.40	0.03
26	300955	嘉亨家化	1,825	91,295.65	0.03
27	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.03
28	688667	菱电电控	858	89,129.04	0.03
29	300933	中辰股份	8,117	85,722.18	0.03
30	688499	利元亨	2,116	82,206.60	0.03
31	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.03
32	605117	德业股份	627	80,005.20	0.03
33	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.03
34	300945	曼卡龙	4,031	79,128.73	0.03
35	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.03
36	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.03
37	300958	建工修复	2,593	75,075.74	0.02
38	300971	博亚精工	2,145	73,925.05	0.02
39	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.02
40	688663	新风光	3,279	71,023.14	0.02
41	300967	晓鸣股份	4,361	70,019.88	0.02
42	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.02
43	688611	杭州柯林	1,400	68,726.00	0.02

44	688685	迈信林	2,612	67,781.40	0.02
45	300930	屹通新材	2,620	65,079.78	0.02
46	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
47	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.02
48	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.02
49	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.02
50	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.02
51	688191	智洋创新	2,740	59,184.00	0.02
52	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.02
53	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.02
54	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.02
55	300929	华骐环保	1,827	54,892.05	0.02
56	300943	春晖智控	2,242	52,860.10	0.02
57	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.02
58	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.02
59	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
60	300957	贝泰妮	179	45,100.84	0.01
61	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.01
62	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.01
63	688087	英科再生	1,777	39,022.92	0.01
64	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.01
65	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
66	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.01
67	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
68	605089	味知香	370	32,197.40	0.01
69	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.01
70	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
71	605296	神农集团	569	26,856.80	0.01
72	603324	盛剑环境	733	26,666.54	0.01
73	300973	立高食品	219	25,340.49	0.01
74	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.01
75	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.01
76	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
77	605378	野马电池	473	21,729.62	0.01
78	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.01
79	001206	依依股份	321	20,389.92	0.01
80	605305	中际联合	368	19,364.16	0.01
81	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.01
82	601279	英利汽车	1,804	18,815.72	0.01
83	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.01
84	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.01
85	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
86	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.01

87	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.01
88	605299	舒华体育	738	15,874.38	0.01
89	300981	中红医疗	163	14,733.57	0.00
90	300909	汇创达	333	14,352.30	0.00
91	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
92	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
93	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
94	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
95	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
96	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
97	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
98	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
99	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
100	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
101	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
102	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
103	003033	征和工业	301	9,538.69	0.00
104	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
105	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
106	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
107	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
108	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
109	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
110	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
111	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
112	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	000799	酒鬼酒	2,514,682.00	0.74
2	300274	阳光电源	1,719,173.92	0.50
3	601636	旗滨集团	1,283,881.00	0.38
4	300253	卫宁健康	1,242,074.00	0.36
5	300037	新宙邦	1,199,886.00	0.35
6	002422	科伦药业	1,027,647.00	0.30
7	002439	启明星辰	1,024,544.00	0.30
8	300308	中际旭创	999,596.00	0.29
9	600177	雅戈尔	923,227.00	0.27

10	600988	赤峰黄金	879,961.00	0.26
11	600536	中国软件	879,156.00	0.26
12	300012	华测检测	870,929.00	0.25
13	600068	葛洲坝	861,537.00	0.25
14	002340	格林美	814,366.92	0.24
15	002127	南极电商	812,951.87	0.24
16	600066	宇通客车	802,675.00	0.23
17	600637	东方明珠	795,946.00	0.23
18	002180	纳思达	771,937.00	0.23
19	601117	中国化学	768,101.00	0.22
20	600369	西南证券	759,456.00	0.22

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	300274	阳光电源	6,850,471.31	2.00
2	300012	华测检测	3,796,522.00	1.11
3	600426	华鲁恒升	3,347,539.14	0.98
4	300496	中科创达	2,874,652.65	0.84
5	300595	欧普康视	2,747,396.00	0.80
6	603882	金域医学	2,693,754.00	0.79
7	600132	重庆啤酒	2,564,238.51	0.75
8	600143	金发科技	2,558,707.40	0.75
9	603806	福斯特	2,209,761.08	0.65
10	601966	玲珑轮胎	2,192,044.00	0.64
11	600079	人福医药	2,109,285.70	0.62
12	002568	百润股份	2,018,996.95	0.59
13	601799	星宇股份	1,888,836.00	0.55
14	600739	辽宁成大	1,745,989.52	0.51
15	603345	安井食品	1,734,212.00	0.51
16	002791	坚朗五金	1,506,204.00	0.44
17	603816	顾家家居	1,466,750.00	0.43
18	300896	爱美客	1,465,085.18	0.43
19	002064	华峰化学	1,219,878.00	0.36
20	002920	德赛西威	1,198,235.00	0.35

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	126,582,675.50
卖出股票收入（成交）总额	189,753,950.65

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

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	9,418,460.00	3.09
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）	80,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,498,460.00	3.12

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	019645	20 国债 15	66,000	6,620,460.00	2.17
2	019640	20 国债 10	27,980	2,798,000.00	0.92
3	113051	节能转债	800	80,000.00	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2112	IC2112	7.00	9,129,680.00	323,680.00	
公允价值变动总额合计					323,680.00
股指期货投资本期收益					891,223.30
股指期货投资本期公允价值变动					220,560.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查,或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

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	1,582,900.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	179,299.87
5	应收申购款	4,503,933.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	6,266,134.16

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	2,000,425.00	0.66	重大资产重组

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688680	海优新材	315,962.17	0.10	新股流通受限
2	301015	百洋医药	17,822.97	0.01	新股流通受限

§ 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 (%)
汇添富中证 500 指数 (LOF) A	15,738	10,199.37	13,131,387.05	8.18	147,386,365.77	91.82
汇添富中证 500 指	20,181	4,675.82	0.00	0.00	94,362,647.38	100.00

数 (LOF) C						
合计	35,919	7,095.98	13,131,387.05	5.15	241,749,013.15	94.85

8.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	高倩	198,824.00	3.14
2	钟爱民	166,061.00	2.62
3	高明英	137,684.00	2.17
4	余建萍	128,822.00	2.03
5	王轶轮	104,512.00	1.65
6	王正旺	102,600.00	1.62
7	李峰	101,125.00	1.59
8	闫丽京	99,412.00	1.57
9	陈靖	99,412.00	1.57
10	沈雯	99,407.00	1.57
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	李先禄	204,800.00	5.44
2	顾奔驰	201,018.00	5.34
3	欧阳东	200,200.00	5.32
4	虞永金	200,117.00	5.31
5	赵丽妹	200,018.00	5.31
6	于文华	150,175.00	3.99
7	陈丹	130,100.00	3.46
8	任小疆	128,716.00	3.42
9	覃彩霞	113,710.00	3.02
10	王建伟	106,572.00	2.83

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有 从业人员持有本 基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	406,473.89	0.25
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	783.44	0.00

	合计	407,257.33	0.16
--	----	------------	------

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2017 年 08 月 10 日) 基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份额总额	188,653,666.27	125,199,637.52
本报告期基金总申购份额	115,327,269.08	211,014,015.36
减：本报告期基金总赎回份额	143,463,182.53	241,851,005.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	160,517,752.82	94,362,647.38

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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

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。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 (%)	
招商证券	2	311,825,759.78	100.00	287,114.45	100.00	

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

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 (%)
招商证券	12,924,698.92	100.00	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

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	上交所,上证报,公司	2021年01月09日

	于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告	网站, 深交所	
2	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 01 月 22 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 03 月 30 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 03 月 31 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金修订的招募说明书、产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 02 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 22 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 06 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注: 无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 08 月 31 日