

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 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行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	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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
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	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
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	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	58
7.1 期末基金资产组合情况	58
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	59
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	71
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	71
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	72
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	72

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12 市场中性策略执行情况.....	72
7.13 投资组合报告附注.....	72
§ 8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
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.....	75
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	75
§ 9 开放式基金份额变动	75
§ 10 重大事件揭示	75
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
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.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
10.4 基金投资策略的改变.....	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
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.....	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件.....	80
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
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.....	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
§ 12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录.....	81
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	汇添富绝对收益定开混合	
基金主代码	000762	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 03 月 15 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）	17,392,997,629.10	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
下属分级基金的交易代码	000762	008140
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	14,905,331,753.39	2,487,665,875.71

2.2 基金产品说明

投资目标	基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。
投资策略	本基金采用包括市场中性投资策略在内的多种绝对收益策略，力争实现基金资产长期持续稳定的绝对回报。绝对收益策略包括：市场中性投资策略、其他绝对收益策略。其他投资策略包括：债券投资策略、中小企业私募债投资策略、衍生品投资策略。
业绩比较基准	一年期定期存款税后利率
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，采用多种绝对收益策略，其中市场中性策略采用股指期货对冲市场风险，使得多空组合的收益波动与市场相关性较低。本基金属于中低风险水平追求绝对收益的投资品种，其预期风险低于股票型基金和一般的混合型基金。

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 负责人	姓名	李鹏	张燕
	联系电话	021-28932888	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	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	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	《上海证券报》
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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

§ 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)	
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
本期已实现收益	612,784,568.30	83,256,466.51
本期利润	635,457,682.88	87,974,268.68
加权平均基金份额本期利润	0.0485	0.0434
本期加权平均净值利润率	3.45%	3.12%
本期基金份额净值增长率	3.36%	2.89%
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	5,392,896,162.76	821,486,965.87
期末可供分配基金份额利润	0.3618	0.3302
期末基金资产净值	21,523,366,071.97	3,545,677,384.11
期末基金份额净值	1.444	1.425
3.1.3 累计期末指	报告期末(2021 年 06 月 30 日)	

标		
基金份额累计净值增长率	44.40%	11.76%

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

汇添富绝对收益定开混合 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	0.42%	0.31%	0.12%	0.00%	0.30%	0.31%
过去三个月	4.18%	0.34%	0.37%	0.00%	3.81%	0.34%
过去六个月	3.36%	0.44%	0.74%	0.00%	2.62%	0.44%
过去一年	6.96%	0.39%	1.50%	0.00%	5.46%	0.39%
过去三年	24.81%	0.32%	4.50%	0.00%	20.31%	0.32%
自基金合同生效日起至今	44.40%	0.33%	6.44%	0.00%	37.96%	0.33%
汇添富绝对收益定开混合 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	0.28%	0.30%	0.12%	0.00%	0.16%	0.30%
过去三	4.01%	0.34%	0.37%	0.00%	3.64%	0.34%

个月						
过去六个月	2.89%	0.44%	0.74%	0.00%	2.15%	0.44%
过去一年	6.11%	0.40%	1.50%	0.00%	4.61%	0.40%
自基金合同生效日起至今	11.76%	0.35%	2.45%	0.00%	9.31%	0.35%

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

汇添富绝对收益定开混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富绝对收益定开混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 03 月 15 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。

2、本基金于 2019 年 11 月 11 日新增 C 类份额，新增份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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，公司注册资本金为 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		
顾耀强	本基金的基金经理，增强收益部总监	2017 年 03 月 15 日		17	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 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。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。
吴江宏	本基金的基金经理，股债混合部主管	2017 年 03 月 15 日		10	国籍:中国。学历:厦门大学经济学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益分析师，现任股债混合部主管。2015 年 7 月 17 日至今任汇

					添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月 19 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月 3 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 13 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫利定期开放债券型发起式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。2017 年 4 月 20 日至 2019 年 9 月 4 日任汇添富鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月 23 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金的
--	--	--	--	--	--

					基金经理。2017 年 9 月 27 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月 25 日至 2019 年 8 月 29 日任汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至 2020 年 6 月 4 日任汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至今任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 4 月 20 日任汇添富添福吉祥混合
--	--	--	--	--	--

					型证券投资基金的基金经理。 2019 年 8 月 28 日至 2021 年 5 月 20 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 4 日至今任汇添富稳健睿选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 2021 年 3 月 23 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 25 日至今任汇添富稳健鑫添益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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内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

上半年市场大幅震荡。春节前后受流动性转向预期影响，核心资产先是系统性上涨又随后暴跌。二季度市场逐步稳定，但出现显著分化。一些相对稀缺、空间大、增速快的细分行业如新能源、半导体、CXO、次高端白酒等受到投资者的追捧表现强劲。此外，经济复苏预期及疫情反复导致的供求错配等推动部分上游资源价格上行，相关行业亦有较好表现。

上半年本基金坚持基本面选股对冲策略，依托汇添富强大投研支持，不断挖掘各行业有超额收益的优质公司动态优化组合，并用股指期货剥离组合贝塔，以获取相对稳定的阿尔法收益。虽然在春节后市场的剧烈波动中净值出现阶段性较大回撤，但经过积极的组合调整后，二季度收益得以恢复，净值创出新高。本基金管理人亦总结分析了此前市场波动中基金净值回撤控制的经验教训，并进一步优化投资策略体系，力争做好波动和收益的平衡。

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 3.36%；C 类基金份额净值增长率为 2.89%。同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

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，本基金管理人维持对市场谨慎乐观的观点。影响市场的关键因素仍然是疫情进展及地缘博弈：全球疫情的控制节奏会影响经济复苏进程和流动性预期，而大国关系则影响市场风险溢价。但自下而上来看，越来越多由优秀企业家领导的、竞争力日益增强，且持续增长前景确定的上市公司是我们对市场乐观的基础。考虑到市场风格分化愈加极致，下半年的波动率有可能仍然较大。

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

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

4.7 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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；封闭期，基金收益分配采用现金分红；开放期，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 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

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：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

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	497,750,635.99	98,867,702.87
结算备付金		1,271,243,593.56	370,455,044.12
存出保证金		1,416,333,616.64	1,316,595,212.64
交易性金融资产	6.4.7.2	20,272,842,111.36	19,147,335,460.40
其中：股票投资		13,273,109,555.98	12,839,140,520.78
基金投资		-	-
债券投资		6,907,820,955.38	6,222,125,810.85
资产支持证券投资		91,911,600.00	86,069,128.77
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	1,600,000,000.00	-
应收证券清算款		6,600,928.52	57,937,256.71
应收利息	6.4.7.5	64,451,084.79	89,723,392.24
应收股利		-	-
应收申购款		388,631,366.40	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		25,517,853,337.26	21,080,914,068.98
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		239,407,656.07	-
应付赎回款		158,110,175.78	-
应付管理人报酬		27,094,356.67	27,805,170.75
应付托管费		4,515,726.11	4,634,195.14
应付销售服务费		1,937,890.42	2,034,001.02
应付交易费用	6.4.7.7	16,953,854.19	14,919,748.46
应交税费		422,892.55	460,609.53
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	367,329.39	210,000.00
负债合计		448,809,881.18	50,063,724.90
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	17,392,997,629.10	15,067,356,257.54
未分配利润	6.4.7.10	7,676,045,826.98	5,963,494,086.54
所有者权益合计		25,069,043,456.08	21,030,850,344.08
负债和所有者权益总计		25,517,853,337.26	21,080,914,068.98

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 17,392,997,629.10 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.444 元，基金份额总额 14,905,331,753.39 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.425 元，基金份额总额 2,487,665,875.71 份。

6.2 利润表

会计主体：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

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		976,380,560.68	735,303,689.74
1. 利息收入		113,599,926.02	71,415,941.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,305,825.67	4,257,327.09
债券利息收入		102,071,528.39	61,871,435.22
资产支持证券利息收入		1,673,624.01	61,412.26
买入返售金融资产收入		548,947.95	5,225,766.52
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		830,825,111.60	175,578,748.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,635,041,689.63	279,407,203.95
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	12,396,760.71	11,777,550.50
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-69,128.77	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-901,310,964.52	-186,330,380.00
股利收益	6.4.7.17	84,766,754.55	70,724,374.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	27,390,916.75	483,965,667.96
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	4,564,606.31	4,343,331.97
减：二、费用		252,948,609.12	128,892,454.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	158,238,829.05	89,266,929.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,373,138.12	14,877,821.54
3. 销售服务费		11,203,022.10	6,525,788.63

4. 交易费用	6. 4. 7. 20	56,692,896.45	17,935,152.63
5. 利息支出		3,664.18	45,296.07
其中：卖出回购金融资产支出		3,664.18	45,296.07
6. 税金及附加		293,964.70	96,398.61
7. 其他费用	6. 4. 7. 21	143,094.52	145,067.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		723,431,951.56	606,411,235.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		723,431,951.56	606,411,235.09

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	15,067,356,257.54	5,963,494,086.54	21,030,850,344.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	723,431,951.56	723,431,951.56
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）	2,325,641,371.56	989,119,788.88	3,314,761,160.44
其中：1. 基金申购款	7,647,734,107.33	3,261,374,571.08	10,909,108,678.41
2. 基金赎回款	-5,322,092,735.77	-2,272,254,782.20	-7,594,347,517.97
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）	17,392,997,629.10	7,676,045,826.98	25,069,043,456.08

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)	7,440,898,238.87	2,115,827,212.09	9,556,725,450.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	606,411,235.09	606,411,235.09
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)	10,252,601,864.50	3,453,043,077.68	13,705,644,942.18
其中：1. 基金申购款	13,282,460,473.62	4,469,633,413.97	17,752,093,887.59
2. 基金赎回款	-3,029,858,609.12	-1,016,590,336.29	-4,046,448,945.41
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)	17,693,500,103.37	6,175,281,524.86	23,868,781,628.23

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

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]741 号文《关于核准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募集的批复》的核准，以及中国证监会机构部函[2016]2980 号文《关于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延期募集备案的回函》准予延期募集，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发行募集，基金合同于 2017 年 3 月 15 日生效，首次设立募集规模为

493,313,864.49 份基金份额。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。

根据 2019 年 10 月 30 日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于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增设基金份额并修改基金合同的公告》，自 2019 年 11 月 11 日起对本基金增设 C 类基金份额类别。增设基金份额后，本基金将分设为 A 类基金份额和 C 类基金份额。其中，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，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）。本基金基于基金管理人对于市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。本基金的业绩比较基准为：一年期定期存款税后利率。

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	497,750,635.99
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	497,750,635.99

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		11,908,507,033.87	13,273,109,555.98	1,364,602,522.11
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	1,333,062,583.41	1,330,055,955.38	-3,006,628.03
	银行间市场	5,584,171,906.56	5,577,765,000.00	-6,406,906.56
	其他	—	—	—
	合计	6,917,234,489.97	6,907,820,955.38	-9,413,534.59
资产支持证券		91,851,500.00	91,911,600.00	60,100.00
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		18,917,593,023.	20,272,842,111.	1,355,249,087.

	84	36	52
--	----	----	----

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			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-11,197,498,337.86	-	-	-
（股指期货投资）	-11,197,498,337.86			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-11,197,498,337.86	-	-	-

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
IC2109	-1,920.00	-2,489,342,360.00	-2,560,128,000.00	-70,785,640.00
IF2107	-2,056.00	-3,171,544,020.00	-3,201,932,160.00	-30,388,140.00
IF2109	-2,727.00	-4,168,905,011.20	-4,226,631,840.00	-57,726,828.80
IH2109	-1,300.00	-1,367,706,946.66	-1,349,478,000.00	18,228,946.66
总额合计：		-140,671,662.14		

减：可抵销期货暂收款 -140,671,662.14

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,600,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,600,000,000.00	-

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	160,621.48
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	592,371.93
应收债券利息	62,203,381.30
应收资产支持证券利息	1,362,630.98
应收买入返售证券利息	130,031.30
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	2,047.80
合计	64,451,084.79

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	16,935,604.19
银行间市场应付交易费用	18,250.00
合计	16,953,854.19

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	263,191.04
应付证券出借违约金	-
应付审计费	44,630.98
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	367,329.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富绝对收益定开混合 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	13,052,787,114.56	13,052,787,114.56
本期申购	6,090,463,027.55	6,090,463,027.55
本期赎回（以“-”号填列）	-4,237,918,388.72	-4,237,918,388.72
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	14,905,331,753.39	14,905,331,753.39
汇添富绝对收益定开混合 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	2,014,569,142.98	2,014,569,142.98
本期申购	1,557,271,079.78	1,557,271,079.78
本期赎回（以“-”号填列）	-1,084,174,347.05	-1,084,174,347.05
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,487,665,875.71	2,487,665,875.71

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

汇添富绝对收益定开混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	4,113,470,863.05	1,074,752,910.07	5,188,223,773.12
本期利润	612,784,568.30	22,673,114.58	635,457,682.88
本期基金份额交易产生的变动数	666,640,731.41	127,712,131.17	794,352,862.58
其中：基金申购款	2,169,385,404.91	450,112,259.21	2,619,497,664.12
基金赎回款	-1,502,744,673.50	-322,400,128.04	-1,825,144,801.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,392,896,162.76	1,225,138,155.82	6,618,034,318.58
汇添富绝对收益定开混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	583,517,299.97	191,753,013.45	775,270,313.42
本期利润	83,256,466.51	4,717,802.17	87,974,268.68
本期基金份额交易产生的变动数	154,713,199.39	40,053,726.91	194,766,926.30
其中：基金申购款	505,713,940.22	136,162,966.74	641,876,906.96
基金赎回款	-351,000,740.83	-96,109,239.83	-447,109,980.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	821,486,965.87	236,524,542.53	1,058,011,508.40

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	815,210.66
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	8,454,839.52
其他	35,775.49
合计	9,305,825.67

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 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	18,662,744,733.92
减：卖出股票成本总额	17,027,703,044.29
买卖股票差价收入	1,635,041,689.63

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	3,988,153,547.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,909,528,663.18
减：应收利息总额	66,228,123.24
买卖债券差价收入	12,396,760.71

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
卖出资产支持证券成交总额	45,366,302.09
减：卖出资产支持证券成本总额	44,217,628.77
减：应收利息总额	1,217,802.09
资产支持证券投资收益	-69,128.77

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
买卖权证差价收入应缴纳增值税	-
卖出权证成本总额	-
国债期货投资收益	-
买卖权证差价收入	-
股指期货投资收益	-901,310,964.52

外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

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	84,766,754.55
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	84,766,754.55

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	-439,039,367.77
——股票投资	-455,940,352.58
——债券投资	16,840,884.81
——资产支持证券投资	60,100.00
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	466,430,284.52
——权证投资	-
——期货投资	466,430,284.52
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	27,390,916.75

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	4,564,606.31
替代损益	-
其他	-
合计	4,564,606.31

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	56,667,896.45
银行间市场交易费用	25,000.00
合计	56,692,896.45

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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	16,050.00
银行费用	22,874.31
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	31.86
合计	143,094.52

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, 基金发起人
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, 基金代销机构
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 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	8,391,267,202.10	22.94	1,867,380,900.25	13.99

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 (%)
东方证券	1,585,707,483.70	96.82	1,458,771,926.54	92.15

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 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	-	-	11,367,700,000.00	16.59

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 (%)
东方证券	7,703,450.00	22.91	4,623,362.11	27.30
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 (%)
东方证券	1,720,398.51	14.01	1,238,333.08	14.85

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	158,238,829.05	89,266,929.22
其中：支付销售机构的客户维护费	34,380,309.80	27,365,999.20

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月前三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 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	26,373,138.12	14,877,821.54

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月前三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 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		
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	155,770.42	155,770.42
招商银行股份有限公司	-	7,098,860.52	7,098,860.52
东方证券股份有限公司	-	204,646.59	204,646.59
合计	-	7,459,277.53	7,459,277.53
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		
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	223,104.15	223,104.15
招商银行股份有限公司	-	2,681,300.19	2,681,300.19
东方证券股份有限公司	-	204,175.54	204,175.54
合计	-	3,108,579.88	3,108,579.88

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值的 0.80% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，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

份额单位：份

汇添富绝对收益定开混合 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 03 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,000.00	10,001,000.00
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	10,001,000.00	-

总份额		
报告期末持有的基金份额	-	10,001,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%)	-	0.07
汇添富绝对收益定开混合 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 03 月 15 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 (%)	-	-

注: 基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位: 份

汇添富绝对收益定开混合 A				
关联方名称	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
汇添富资本管理有限公司	-	-	36,567,156.72	0.28
汇添富绝对收益定开混合 C				
关联方名称	本期末 2021 年 06 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)

	-	-	-	-
--	---	---	---	---

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	497,750,635.99	815,210.66	165,780,700.45	747,854.40

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（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
301010	晶雪节能	2021 年 06 月 09	2021 年 12 月 20	新股流通受	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	

		日	日	限						
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	
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	
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	853	40,372.49	214,921.88	
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	
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	
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	
30099	泰	202	202	新	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	

2	福 泵 业	1 年 05 月 17 日	1 年 11 月 25 日	股 流 通 受 限						
301013	利 和 兴	2021 年 06 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新 股 流 通 受 限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	
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	
688319	欧 林 生 物	2021 年 05 月 31 日	2021 年 12 月 08 日	新 股 流 通 受 限	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	
688468	科 美 诊 断	2021 年 03 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新 股 流 通 受 限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	
301018	申 菱 环 境	2021 年 06 月 28 日	2021 年 07 月 07 日	新 股 流 通 受 限	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	
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	
688619	罗 普 特	2021 年 02 月	2021 年 08 月	新 股 流	19.31	26.74	5,856	113,079.36	156,589.44	

		月 08 日	月 23 日	通 受 限						
688067	爱威科技	2021年06月07日	2021年12月16日	新股流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	
688315	诺禾致源	2021年04月02日	2021年10月13日	新股流通受限	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	
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	360	10,180.80	41,655.60	
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	
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	
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	

		日	日	限						
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	241	5,015.21	10,177.43	
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	2,149	83,488.65	83,488.65	
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	
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	
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	
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	
300968	格林精密	2021年04月06日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	
30098	志	202	202	新	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	

6	特 新材	1 年 04 月 21 日	1 年 11 月 01 日	股 流 通 受 限						
30101 5	百 洋 医 药	202 1 年 06 月 22 日	202 1 年 12 月 30 日	新 股 流 通 受 限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	
30099 3	玉 马 遮 阳	202 1 年 05 月 17 日	202 1 年 11 月 24 日	新 股 流 通 受 限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	
30098 2	苏 文 电 能	202 1 年 04 月 19 日	202 1 年 10 月 27 日	新 股 流 通 受 限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	
30095 8	建 工 修 复	202 1 年 03 月 18 日	202 1 年 09 月 29 日	新 股 流 通 受 限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	
30098 1	中 红 医 疗	202 1 年 04 月 19 日	202 1 年 10 月 27 日	新 股 流 通 受 限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	
68808 7	英 科 再 生	202 1 年 06 月 30 日	202 1 年 07 月 09 日	新 股 流 通 受 限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	
30102 1	英 诺 激	202 1 年 06 月	202 2 年 01 月	新 股 流 通	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	

	光	月	月	通						
		28	06	受						
		日	日	限						
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	
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	
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	
688383	新益昌	2021年04月21日	2021年10月28日	新股流通受限	19.58	106.24	2,701	52,885.58	286,954.24	
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	232	3,834.96	10,688.24	
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	
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	

		日	日	限						
688639	华恒生物	2021年04月14日	2021年10月22日	新 股 流 通 受 限	23.16	42.28	2,302	53,314.32	97,328.56	
300979	华利集团	2021年04月15日	2021年10月26日	新 股 流 通 受 限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	
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	
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	
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	
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	
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	
30099	创	202	202	新	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	

1	益通	1 年 05 月 12 日	1 年 11 月 22 日	股 流 通 受 限						
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	
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	
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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021 年 06 月 16 日	2021 年 07 月 01 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	348,380	34,838,000.00	34,838,000.00	
127038	国微转债	2021 年 06 月 10 日	2021 年 07 月 14 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.00	14,902	1,490,200.00	1,490,200.00	

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688368	晶丰明源	2021年06月21日	重大事項停牌	335.26	2021年07月05日	402.31	1,695	562,596.82	568,265.70	

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于约定开放日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 20 21 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	497,750,635.99	-	-	-	-	-	497,750,635.99
结 算 备 付 金	1,271,243,593.56	-	-	-	-	-	1,271,243,593.56
存 出 保 证 金	4,550,656.64	-	-	-	-	1,411,782,960.00	1,416,333,616.64
交 易 性 金 融 资 产	151,603,373.28	159,226,000.00	3,468,126,015.43	3,208,818,366.67	11,958,800.00	13,273,109,555.98	20,272,842,111.36
应 收 股 利	-	-	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	-	-	64,451,084.79	64,451,084.79
应收申购款	-	-	-	-	-	388,631,366.40	388,631,366.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,600,928.52	6,600,928.52
买入返售金融资产	1,600,000,000.00	-	-	-	-	-	1,600,000,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,525,148,259.47	159,226,000.00	3,468,126,015.43	3,208,818,366.67	11,958,800.00	15,144,575,895.69	25,517,853,337.26
负债							
应付赎回	-	-	-	-	-	158,110,175.78	158,110,175.78

款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,094,356.67	27,094,356.67
应付托管费	-	-	-	-	-	4,515,726.11	4,515,726.11
应付证券清算款	-	-	-	-	-	239,407,656.07	239,407,656.07
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,937,890.42	1,937,890.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,953,854.19	16,953,854.19
应交	-	-	-	-	-	422,892.55	422,892.55

税费							
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	367,329.39	367,329.39
负债总计	-	-	-	-	-	448,809,881.18	448,809,881.18
利率敏感度缺口	3,525,148,259.47	159,226,000.00	3,468,126,015.43	3,208,818,366.67	11,958,800.00	14,695,766,014.51	25,069,043,456.08
上年度末 2020 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	98,867,702.87	-	-	-	-	-	98,867,702.87
结算	370,455,044.12	-	-	-	-	-	370,455,044.12

备付金							
存出保证金	4,321,261.44	-	-	-	-	1,312,273,951.20	1,316,595,212.64
交易性金融资产	17,441,350.17	458,437,669.60	2,248,722,053.18	3,563,864,266.67	19,729,600.00	12,839,140,520.78	19,147,335,460.40
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	89,723,392.24	89,723,392.24
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	57,937,256.71	57,937,256.71
买入返	-	-	-	-	-	-	-

售金融资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	491,085,358.60	458,437,669.60	2,248,722,053.18	3,563,864,266.67	19,729,600.00	14,299,075,120.93	21,080,914,068.98
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,805,170.75	27,805,170.75
应付托管费	-	-	-	-	-	4,634,195.14	4,634,195.14
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金	-	-	-	-	-	-	-

融 资 产 款							
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	2,034,001 .02	2,034,001 .02
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	14,919,74 8.46	14,919,74 8.46
应交 税费	-	-	-	-	-	460,609.5 3	460,609.5 3
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	210,000.0 0	210,000.0 0
负债 总计	-	-	-	-	-	50,063,72 4.90	50,063,72 4.90
利率 敏感 度缺 口	491,085,3 58.60	458,437, 669.60	2,248,722 ,053.18	3,563,864 ,266.67	19,729, 600.00	14,249,01 1,396.03	21,030,85 0,344.08

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和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	25,106,293.14	23,411,105.17
	基准利率增加 25 个基点	-24,919,326.59	-23,227,386.88

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	13,273,109.55 55.98	52.95	12,839,140.52 20.78	61.05
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	6,907,820.95 5.38	27.56	6,222,125.81 0.85	29.59
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	91,911,600.00 0	0.37	86,069,128.77	0.41
合计	20,272,842.11 11.36	80.87	19,147,335.46 60.40	91.04

注：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120% 之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。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
	沪深 300 指数下跌 5%	-222,759,883.60	-102,290,469.82
	沪深 300 指数	222,759,883.60	102,290,469.82

	上涨 5%		
--	-------	--	--

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	13,273,109,555.98	52.01
	其中：股票	13,273,109,555.98	52.01
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	6,999,732,555.38	27.43
	其中：债券	6,907,820,955.38	27.07
	资产支持证券	91,911,600.00	0.36
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	1,600,000,000.00	6.27
	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	1,768,994,229.55	6.93
8	其他资产	1,876,016,996.35	7.35
9	合计	25,517,853,337.26	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	322,692,832.21	1.29
C	制造业	8,093,888,711.72	32.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	103,419,420.39	0.41
E	建筑业	27,535,371.37	0.11
F	批发和零售业	119,776,796.54	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	138,566,029.00	0.55
H	住宿和餐饮业	90,265,750.00	0.36

I	信息传输、软件和信息技术服务业	449,763,402.59	1.79
J	金融业	2,458,295,200.18	9.81
K	房地产业	257,901,787.14	1.03
L	租赁和商务服务业	345,738,800.64	1.38
M	科学研究和技术服务业	173,797,471.20	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	148,257,731.82	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	323,681,802.90	1.29
R	文化、体育和娱乐业	219,517,158.00	0.88
S	综合	-	-
	合计	13,273,109,555.98	52.95

7.2.2 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	600519	贵州茅台	268,770	552,779,259.00	2.21
2	000858	五粮液	1,689,933	503,414,141.37	2.01
3	300059	东方财富	10,662,720	349,630,588.80	1.39
4	000001	平安银行	12,000,000	271,440,000.00	1.08
5	601166	兴业银行	11,807,525	242,644,638.75	0.97
6	002415	海康威视	3,179,920	205,104,840.00	0.82
7	601318	中国平安	3,189,991	205,052,621.48	0.82
8	601888	中国中免	681,703	204,579,070.30	0.82
9	601398	工商银行	39,000,000	201,630,000.00	0.80
10	601658	邮储银行	39,999,910	200,799,548.20	0.80
11	603501	韦尔股	589,931	189,957,782.00	0.76

		份			
12	600919	江苏银行	25,974,750	184,420,725.00	0.74
13	000333	美的集团	2,579,628	184,108,050.36	0.73
14	603799	华友钴业	1,588,857	181,447,469.40	0.72
15	601009	南京银行	16,999,920	178,839,158.40	0.71
16	300122	智飞生物	879,969	164,316,611.37	0.66
17	002179	中航光电	2,000,000	158,040,000.00	0.63
18	002304	洋河股份	760,000	157,472,000.00	0.63
19	600426	华鲁恒升	5,000,000	154,750,000.00	0.62
20	603260	合盛硅业	1,999,972	153,817,846.52	0.61
21	002142	宁波银行	3,879,909	151,200,053.73	0.60
22	300124	汇川技术	2,000,000	148,520,000.00	0.59
23	002271	东方雨虹	2,589,771	143,266,131.72	0.57
24	603369	今世缘	2,589,692	140,257,718.72	0.56
25	002475	立讯精密	2,999,977	137,998,942.00	0.55
26	002601	龙蟠佰利	3,875,700	134,021,706.00	0.53
27	300347	泰格医药	680,000	131,444,000.00	0.52
28	600309	万华化学	1,200,000	130,584,000.00	0.52
29	603882	金域医学	800,000	127,816,000.00	0.51
30	603568	伟明环保	5,589,680	127,612,394.40	0.51
31	603259	药明康德	800,000	125,272,000.00	0.50
32	300142	沃森生物	2,000,000	123,400,000.00	0.49
33	002460	赣锋锂	1,000,000	121,090,000.00	0.48

		业			
34	000157	中联重科	12,999,942	120,119,464.08	0.48
35	002624	完美世界	5,000,000	119,550,000.00	0.48
36	601865	福莱特	2,999,906	118,586,284.18	0.47
37	601799	星宇股份	519,507	117,263,120.04	0.47
38	002812	恩捷股份	500,000	117,050,000.00	0.47
39	000661	长春高新	299,913	116,066,331.00	0.46
40	002568	百润股份	1,205,195	114,240,434.05	0.46
41	601688	华泰证券	7,010,000	110,758,000.00	0.44
42	300144	宋城演艺	6,580,000	110,544,000.00	0.44
43	300413	芒果超媒	1,588,530	108,973,158.00	0.43
44	601899	紫金矿业	10,800,000	104,652,000.00	0.42
45	300014	亿纬锂能	1,000,000	103,930,000.00	0.41
46	600900	长江电力	5,010,000	103,406,400.00	0.41
47	600383	金地集团	10,000,000	102,400,000.00	0.41
48	600690	海尔智家	3,889,930	100,788,086.30	0.40
49	601939	建设银行	15,005,772	99,788,383.80	0.40
50	600030	中信证券	3,999,975	99,759,376.50	0.40
51	002027	分众传媒	10,000,000	94,100,000.00	0.38
52	601601	中国太保	3,185,986	92,298,014.42	0.37
53	600754	锦江酒店	1,585,000	90,265,750.00	0.36
54	300274	阳光电源	781,781	89,951,721.86	0.36
55	001914	招商积	5,078,402	87,246,946.36	0.35

		余			
56	600031	三一重工	2,999,995	87,209,854.65	0.35
57	600298	安琪酵母	1,580,000	85,920,400.00	0.34
58	601100	恒立液压	999,973	85,917,680.16	0.34
59	000983	山西焦煤	10,299,906	85,592,218.86	0.34
60	688363	华熙生物	300,000	83,358,000.00	0.33
61	002371	北方华创	300,000	83,214,000.00	0.33
62	002311	海大集团	1,000,000	81,600,000.00	0.33
63	002212	天融信	3,989,918	78,880,678.86	0.31
64	000625	长安汽车	3,000,000	78,840,000.00	0.31
65	603392	万泰生物	299,900	77,728,082.00	0.31
66	000786	北新建材	1,980,000	77,715,000.00	0.31
67	002049	紫光国微	502,870	77,537,525.30	0.31
68	300715	凯伦股份	3,255,980	76,743,448.60	0.31
69	000825	太钢不锈	10,000,000	74,900,000.00	0.30
70	603605	珀莱雅	380,000	74,749,800.00	0.30
71	600570	恒生电子	799,960	74,596,270.00	0.30
72	300628	亿联网络	888,087	74,421,690.60	0.30
73	000568	泸州老窖	300,520	70,904,688.80	0.28
74	600346	恒力石化	2,691,200	70,617,088.00	0.28
75	002847	盐津铺子	707,015	70,503,535.80	0.28
76	300037	新宙邦	699,928	70,062,792.80	0.28
77	600000	浦发银行	6,999,937	69,999,370.00	0.28
78	002352	顺丰控股	1,006,835	68,162,729.50	0.27

		股			
79	600587	新华医疗	3,000,000	67,950,000.00	0.27
80	002507	涪陵榨菜	1,790,935	67,446,612.10	0.27
81	300015	爱尔眼科	907,605	64,421,802.90	0.26
82	600703	三安光电	2,000,000	64,100,000.00	0.26
83	603290	斯达半导	200,000	64,000,000.00	0.26
84	002410	广联达	928,594	63,330,110.80	0.25
85	600066	宇通客车	5,000,000	62,450,000.00	0.25
86	300390	天华超净	1,286,200	61,776,186.00	0.25
87	603899	晨光文具	700,000	59,192,000.00	0.24
88	000538	云南白药	509,393	58,946,957.96	0.24
89	601088	中国神华	3,000,000	58,560,000.00	0.23
90	603939	益丰药房	999,902	56,084,503.18	0.22
91	600660	福耀玻璃	1,000,000	55,850,000.00	0.22
92	603345	安井食品	218,157	55,416,241.14	0.22
93	002511	中顺洁柔	2,000,000	55,100,000.00	0.22
94	300751	迈为股份	120,000	54,564,000.00	0.22
95	002612	朗姿股份	1,000,000	54,020,000.00	0.22
96	300782	卓胜微	100,000	53,750,000.00	0.21
97	300750	宁德时代	100,000	53,480,000.00	0.21
98	601857	中国石油	10,000,000	52,900,000.00	0.21
99	300760	迈瑞医疗	109,803	52,710,930.15	0.21
100	603806	福斯特	501,060	52,676,437.80	0.21
101	000799	酒鬼酒	200,000	51,120,000.00	0.20

102	002706	良信股份	2,200,000	49,588,000.00	0.20
103	002984	森麒麟	1,335,800	48,689,910.00	0.19
104	300662	科锐国际	776,307	47,059,730.34	0.19
105	002968	新大正	1,020,595	44,446,912.25	0.18
106	600160	巨化股份	5,000,000	44,200,000.00	0.18
107	688208	道通科技	500,000	43,495,000.00	0.17
108	002241	歌尔股份	1,000,000	42,740,000.00	0.17
109	600887	伊利股份	1,158,637	42,672,600.71	0.17
110	688200	华峰测控	89,246	42,242,809.18	0.17
111	002891	中宠股份	1,029,862	42,224,342.00	0.17
112	688680	海优新材	157,044	40,360,308.00	0.16
113	601111	中国国航	5,000,000	38,900,000.00	0.16
114	000338	潍柴动力	2,000,000	35,740,000.00	0.14
115	603708	家家悦	1,999,946	34,739,062.02	0.14
116	300763	锦浪科技	182,330	32,928,798.00	0.13
117	002508	老板电器	700,000	32,550,000.00	0.13
118	688276	百克生物	303,486	31,738,565.88	0.13
119	300748	金力永磁	999,960	31,628,734.80	0.13
120	300496	中科创达	200,000	31,412,000.00	0.13
121	002918	蒙娜丽莎	999,910	31,387,174.90	0.13
122	600315	上海家化	505,625	30,408,287.50	0.12
123	300168	万达信息	1,999,967	29,199,518.20	0.12
124	600859	王府井	999,902	28,877,169.76	0.12
125	002832	比音勒	1,090,112	27,895,966.08	0.11

		芬			
126	002120	韵达股份	2,035,400	27,538,962.00	0.11
127	600970	中材国际	3,000,000	27,510,000.00	0.11
128	688598	金博股份	100,000	26,900,000.00	0.11
129	300825	阿尔特	1,000,000	26,480,000.00	0.11
130	300327	中颖电子	300,000	25,569,000.00	0.10
131	000002	万科A	999,913	23,807,928.53	0.09
132	002541	鸿路钢构	389,768	22,742,962.80	0.09
133	002920	德赛西威	200,000	22,016,000.00	0.09
134	002967	广电计量	500,000	21,900,000.00	0.09
135	600702	舍得酒业	100,000	21,378,000.00	0.09
136	300408	三环集团	500,000	21,210,000.00	0.08
137	300685	艾德生物	202,500	21,076,200.00	0.08
138	688139	海尔生物	200,000	21,020,000.00	0.08
139	601666	平煤股份	2,951,985	20,988,613.35	0.08
140	000967	盈峰环境	2,999,941	20,609,594.67	0.08
141	300188	美亚柏科	999,940	17,398,956.00	0.07
142	600588	用友网络	500,000	16,630,000.00	0.07
143	300253	卫宁健康	999,976	16,269,609.52	0.06
144	600741	华域汽车	599,985	15,761,605.95	0.06
145	603833	欧派家居	109,987	15,613,754.52	0.06
146	003012	东鹏控股	768,800	12,792,832.00	0.05
147	600809	山西汾	25,505	11,426,240.00	0.05

		酒			
148	603027	千禾味业	419,900	11,039,171.00	0.04
149	603195	公牛集团	50,000	10,100,000.00	0.04
150	002557	洽洽食品	199,943	8,617,543.30	0.03
151	603517	绝味食品	100,000	8,429,000.00	0.03
152	688696	极米科技	10,000	8,320,000.00	0.03
153	600019	宝钢股份	999,920	7,639,388.80	0.03
154	300957	贝泰妮	20,853	5,648,721.88	0.02
155	000651	格力电器	100,000	5,210,000.00	0.02
156	601919	中远海控	114,000	3,481,560.00	0.01
157	600389	江山股份	100,000	3,439,000.00	0.01
158	603486	科沃斯	10,000	2,280,800.00	0.01
159	300896	爱美客	2,475	1,952,478.00	0.01
160	688521	芯原股份	21,442	1,671,832.74	0.01
161	300595	欧普康视	14,000	1,449,700.00	0.01
162	601012	隆基股份	14,000	1,243,760.00	0.00
163	688368	晶丰明源	1,695	568,265.70	0.00
164	600009	上海机场	10,000	481,300.00	0.00
165	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.00
166	688383	新益昌	2,701	286,954.24	0.00
167	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.00
168	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.00
169	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.00
170	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.00
171	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00

172	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
173	688590	新致软件	4,171	77,163.50	0.00
174	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
175	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.00
176	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
177	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
178	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
179	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
180	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
181	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
182	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
183	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
184	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
185	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
186	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
187	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
188	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
189	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
190	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
191	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
192	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
193	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
194	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00

195	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
196	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
197	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
198	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
199	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
200	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
201	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
202	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
203	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
204	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
205	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
206	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
207	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
208	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
209	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
210	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
211	600276	恒瑞医药	109	7,408.73	0.00
212	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
213	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
214	300357	我武生物	97	6,219.64	0.00
215	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
216	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
217	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
218	300972	万辰生	430	5,439.50	0.00

		物			
219	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
220	300601	康泰生物	34	5,066.00	0.00
221	603986	兆易创新	25	4,697.50	0.00
222	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
223	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
224	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
225	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
226	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
227	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
228	002245	蔚蓝锂芯	75	1,477.50	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	000858	五 粮 液	472,933,553.55	2.25
2	600809	山西汾酒	397,879,286.68	1.89
3	000001	平安银行	375,841,026.34	1.79
4	601166	兴业银行	370,706,391.65	1.76
5	601398	工商银行	344,234,482.19	1.64
6	300059	东方财富	336,794,296.20	1.60
7	000799	酒鬼酒	329,162,475.66	1.57
8	600519	贵州茅台	301,644,760.11	1.43
9	600030	中信证券	289,268,091.95	1.38
10	601601	中国太保	282,369,256.92	1.34
11	002142	宁波银行	272,261,489.70	1.29
12	600309	万华化学	259,439,681.95	1.23
13	300014	亿纬锂能	222,936,535.48	1.06
14	000568	泸州老窖	218,279,660.83	1.04
15	002714	牧原股份	217,125,614.69	1.03

16	601658	邮储银行	214,305,482.79	1.02
17	002271	东方雨虹	208,883,524.73	0.99
18	601888	中国中免	202,534,120.26	0.96
19	601939	建设银行	200,270,209.90	0.95
20	601688	华泰证券	196,817,595.68	0.94

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	601318	中国平安	687,194,301.56	3.27
2	600809	山西汾酒	417,143,907.96	1.98
3	002142	宁波银行	406,577,991.16	1.93
4	601601	中国太保	405,680,877.73	1.93
5	601166	兴业银行	379,543,334.61	1.80
6	300059	东方财富	376,503,296.45	1.79
7	601939	建设银行	353,493,497.79	1.68
8	600030	中信证券	334,299,134.35	1.59
9	000001	平安银行	324,901,696.45	1.54
10	300274	阳光电源	302,076,640.03	1.44
11	000799	酒鬼酒	286,050,733.80	1.36
12	000858	五粮液	251,235,710.55	1.19
13	601398	工商银行	241,311,341.27	1.15
14	002714	牧原股份	238,040,614.18	1.13
15	600519	贵州茅台	206,527,151.46	0.98
16	601818	光大银行	206,468,787.51	0.98
17	605111	新洁能	183,029,718.90	0.87
18	002821	凯莱英	182,861,023.98	0.87
19	000807	云铝股份	181,230,794.00	0.86
20	002460	赣锋锂业	180,288,284.76	0.86

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	17,917,612,432.07
卖出股票收入（成交）总额	18,662,744,733.92

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	100,390,000.00	0.40
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,397,019,000.00	5.57
	其中：政策性金融债	1,099,614,000.00	4.39
4	企业债券	1,544,909,500.00	6.16
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	1,855,196,000.00	7.40
7	可转债（可交换债）	47,504,455.38	0.19
8	同业存单	1,962,802,000.00	7.83
9	其他	—	—
10	合计	6,907,820,955.38	27.56

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	210206	21 国开 06	6,400,000	640,064,000.00	2.55
2	112104028	21 中国银行 CD028	5,000,000	485,900,000.00	1.94
3	210404	21 农发 04	3,300,000	329,472,000.00	1.31
4	112103054	21 农业银行 CD054	3,000,000	291,540,000.00	1.16
4	112108110	21 中信银行 CD110	3,000,000	291,540,000.00	1.16

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	169448	弘德 01A	560,000	56,061,600.00	0.22
2	2189113	21 京诚 1A1	500,000	35,850,000.00	0.14

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
IF2109	IF2109	-2,727.00	-4,226,631,840.00	-57,726,828.80	
IH2109	IH2109	-1,300.00	-1,349,478,000.00	18,228,946.66	
IF2107	IF2107	-2,056.00	-3,201,932,160.00	-30,388,140.00	
IC2109	IC2109	-1,920.00	-2,560,128,000.00	-70,785,640.00	
公允价值变动总额合计					-140,671,662.14
股指期货投资本期收益					-901,310,964.52
股指期货投资本期公允价值变动					466,430,284.52

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

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 市场中性策略执行情况

截止本报告期末，本基金持有的股票资产 13,273,109,555.98 元，占基金资产净值的比例为 52.95%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-11,338,170,000.00 元，占基金资产净值的比例为-45.23%，运用股指期货进行对冲的空头合约市值占股票资产的比例为-85.42%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 733,730,725.11 元，公允价值变动损益为 10,489,931.94 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、中国银行股份有限公司、中国农业发展银行、中信银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国邮政储蓄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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	1,416,333,616.64
2	应收证券清算款	6,600,928.52
3	应收股利	—
4	应收利息	64,451,084.79
5	应收申购款	388,631,366.40
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,876,016,996.35

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113607	伟 20 转债	3,544,571.20	0.01
2	128136	立讯转债	1,950,258.20	0.01
3	113044	大秦转债	1,744,324.50	0.01
4	127024	盈峰转债	1,539,919.98	0.01
5	123090	三诺转债	560,963.60	0.00
6	128064	司尔转债	171,857.40	0.00
7	113030	东风转债	30,878.40	0.00

7.13.5 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（%）
汇添富绝对收益定开混合 A	94,165	158,289.51	7,542,732,369.29	50.60	7,362,599,384.10	49.40
汇添富绝对收益定开混合 C	22,136	112,381.00	44,528,564.40	1.79	2,443,137,311.31	98.21
合计	116,301	149,551.57	7,587,260,933.69	43.62	9,805,736,695.41	56.38

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	汇添富绝对收益定开混合 A	4,433,216.37	0.03
	汇添富绝对收益	54,359.98	0.00

	定开混合 C		
	合计	4,487,576.35	0.03

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	汇添富绝对收益定开混合 A	0
	汇添富绝对收益定开混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	汇添富绝对收益定开混合 A	>100
	汇添富绝对收益定开混合 C	0
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,001,000.00 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 03 月 15 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	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
基金合同生效日 (2017 年 03 月 15 日) 基金份额总额	493,313,864.49	—
本报告期期初基金份 额总额	13,052,787,114.56	2,014,569,142.98
本报告期基金总申购 份额	6,090,463,027.55	1,557,271,079.78
减：本报告期基金总 赎回份额	4,237,918,388.72	1,084,174,347.05
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	14,905,331,753.39	2,487,665,875.71

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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，无涉及本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 (%)	
东方证券	2	8,391,267,202.10	22.94	7,703,450.00	22.91	
天风证券	2	5,966,985,311.24	16.32	5,494,601.39	16.34	
中信建投证券	2	3,642,097,115.28	9.96	3,354,906.69	9.98	
开源证券	2	3,153,374,305.22	8.62	2,873,714.44	8.55	
中信	2	2,371,916,224.02	6.49	2,181,069.09	6.49	

证券						
申万宏源证券	2	2,317,289,331.07	6.34	2,134,244.82	6.35	
国泰君安	2	2,312,039,094.15	6.32	2,128,868.24	6.33	
东方财富	2	2,261,868,211.64	6.18	2,085,543.84	6.20	
广发证券	3	1,762,521,669.97	4.82	1,626,205.47	4.84	
安信证券	2	1,279,669,673.46	3.50	1,175,314.72	3.50	
海通证券	2	1,278,660,036.32	3.50	1,179,159.95	3.51	
国信证券	2	958,758,317.74	2.62	880,503.31	2.62	
国金证券	2	689,001,096.48	1.88	637,164.52	1.89	
东北证券	2	187,729,188.57	0.51	173,400.29	0.52	
北京高华	2	-	-	-	-	
财达证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
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	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额的	成交金额	占当期基金成交总额的

		比例 (%)		额的 比例 (%)		比例 (%)		比例 (%)
东方 证券	1,585,707,483.70	96.82	-	-	-	-	-	-
天风 证券	26,001,718.38	1.59	1,300,000,000.00	23.01	-	-	-	-
中信 建投 证券	7,718,182.17	0.47	-	-	-	-	-	-
开源 证券	5,220,272.40	0.32	1,200,000,000.00	21.24	-	-	-	-
中信 证券	5,408,668.34	0.33	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	2,200,000,000.00	38.94	-	-	-	-
国泰 君安	7,760,755.95	0.47	300,000,000.00	5.31	-	-	-	-
东方 财富	-	-	600,000,000.00	10.62	-	-	-	-
广发 证券	-	-	50,000,000.00	0.88	-	-	-	-
安	-	-	-	-	-	-	-	-

信 证 券								
海 通 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国 信 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国 金 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
东 北 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
北 京 高 华	-	-	-	-	-	-	-	-
财 达 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华 泰 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:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告	上交所,上证报,公司网站,深交所	2021 年 01 月 09 日
2	汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告	上交所,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关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	公司网站	2021 年 02 月 08 日
4	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
5	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 04 月 20 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	上交所,公司网站,深交所	2021 年 04 月 21 日

	金产品资料概要		
7	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
8	关于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第八次自由开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	上证报, 公司网站	2021 年 05 月 20 日
9	关于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通过直销中心申购费率优惠的公告	上证报, 公司网站	2021 年 06 月 15 日
10	关于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在交通银行申购费率优惠规则的公告	上证报, 公司网站	2021 年 06 月 16 日
11	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绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《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基金合同》；
- 3、《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、报告期内汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金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