

汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
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	69
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	69

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
7.12 投资组合报告附注.....	70
§ 8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	71
§ 9 开放式基金份额变动	71
§ 10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4 基金投资策略的改变.....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
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.....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8 其他重大事件.....	76
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
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.....	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§ 12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	汇添富 3 年封闭竞争优势混合
基金主代码	007639
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 09 月 04 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）	1,153,976,912.81
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选优质个股进行中长期投资，为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘股票市场中行业背景良好、商业模式清晰、公司治理优良、竞争优势突出且估值相对合理的上市公司。本基金的投资策略还包括：债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、权证投资策略、融资投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*20%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95555
传真	021-28932998	0755-83195201

注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	李文	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日 - 2022 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	-177,599,027.91
本期利润	-195,145,706.14
加权平均基金份额本期利润	-0.1691
本期加权平均净值利润率	-14.30%
本期基金份额净值增长率	-12.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	197,265,000.99
期末可供分配基金份额利润	0.1709
期末基金资产净值	1,394,195,406.76
期末基金份额净值	1.2082
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	20.82%

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

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

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

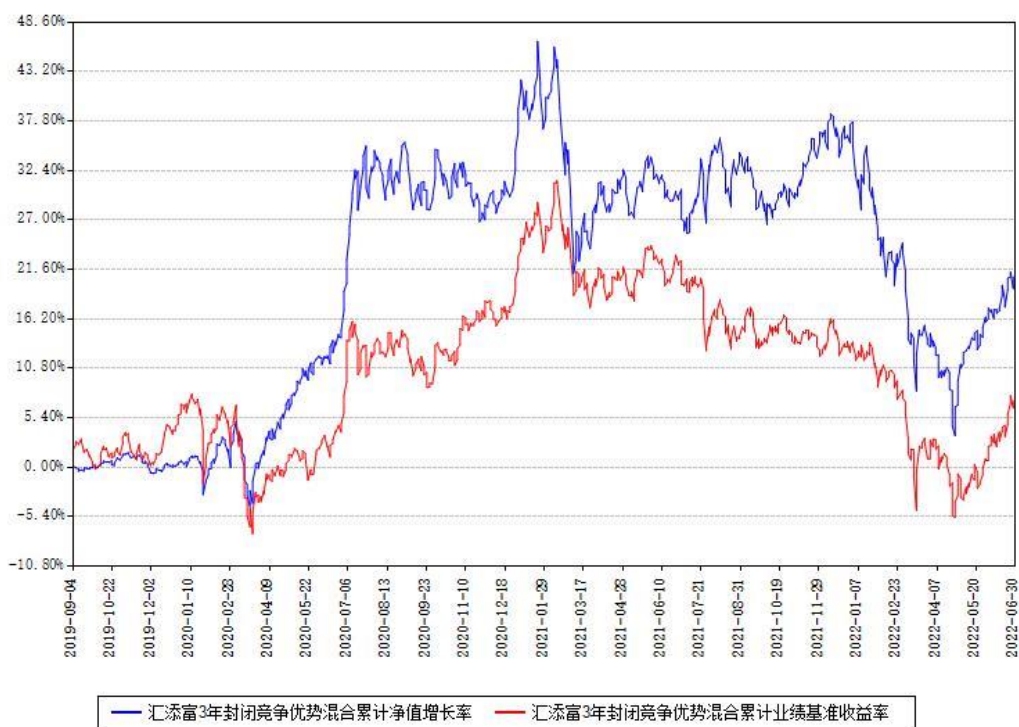
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.79%	0.84%	6.26%	0.91%	-2.47%	-0.07%
过去三个月	6.71%	1.08%	4.91%	1.14%	1.80%	-0.06%
过去六个月	-12.28%	1.33%	-5.63%	1.21%	-6.65%	0.12%
过去一年	-6.76%	1.16%	-12.36%	1.02%	5.60%	0.14%
自基金合同生效日起至今	20.82%	1.06%	7.28%	0.99%	13.54%	0.07%

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3年封闭竞争优势混合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（2019年09月04日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准，于2005年2月3日正式成立。目前，公司注册资本为132,724,224元人民币。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人、QFII基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
赵鹏飞	本基金的基金经理	2019 年 09 月 04 日		14	国籍：中国。学历：北京大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任职于日信证券、光大证券和太平洋资产，担任高级投资经理等岗位。2015 年 8 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2016 年 6 月 3 日至今任汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 20 日至今任汇添富中国高端制造股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 9 月 27 日至 2021 年 9 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。2017 年 9 月 29 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富弘安混合型证

				<p>券投资基金的基金经理。2017 年 9 月 29 日至 2019 年 9 月 17 日任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 19 日至 2019 年 9 月 17 日任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月 23 日至 2021 年 1 月 11 日任汇添富智能制造股票型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月 31 日至今任汇添富悦享定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 31 日至 2021 年 8 月 19 日任汇添富内需增长股票型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 4 日至今任汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 5 月 22 日至今任汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 23</p>
--	--	--	--	--

					日至 2021 年 8 月 3 日任汇添富稳健收益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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3日内、5日内)下,对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易,再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析,进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易,根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 18 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A 股市场上半年可谓跌宕起伏。俄乌冲突引发全球能源危机，全球面临通胀压力引发各国央行采取货币紧缩政策。国内疫情导致许多区域经济停摆，对制造业产业链影响很大，一定程度影响了居民收入预期与消费能力。在此背景下，前四个月大部分行业面临巨大压力，股票大幅下跌。随着五月份国内疫情好转，投资者信心逐步恢复，景气度最高的新能源和军工为代表的制造业大幅反弹。指数来看，上半年上证 50 下跌 6.6%，沪深 300 下跌 9.2%，中证 500 下跌 12.3%，创业板指下跌 15.4%。行业来看，表现最好的是煤炭、交运和地产等，表现最差是电子、计算机、传媒和军工等。

我们去年底的判断是今年经济压力大，货币政策宽松，因此流动性宽裕会导致资金偏好成长股。目前看有对有错。经济压力之大超出我们预期，疫情对出口和消费影响很大，稳增长力度需要观察。基金销售遇冷也超出我们预期，因此股市资金流动性偏弱。但是市场表现最好的确实是今年景气度最高的行业，全球能源危机使得新旧能源股票表现强劲。

我们年初仓位主要配置在中小盘股，配置方向是军工、新能源、计算和汽车零部件。年初持仓遭遇较大的回撤之后，我们根据基本面逐步对持仓做出调整。一季度我们做了几个方面的调整：减持质地不够硬的制造业，减持估值过高的成长股，减持需求存在下行风险的行业；增持商业模式好的核心资产，增持上游资源类股票。四月份市场大跌之后，我们适度增加制造业的比例，但是遗憾的是，我们买入新能源较少，我们低估了欧洲分布式光伏需求的景气度，也低估了国内新能源汽车的销量反弹幅度。我们对本组合采用相对保守策略，仓位始终在中等水平，更多偏好消费和医药，对净值有一定的拖累。基于对全球流动性的判断，我们上半年进一步降低了港股的持仓比例。目前我们配置相对更加均衡，目前持仓主要分布在军工、新能源汽车、医药和消费等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-12.28%。同期业绩比较基准收益率为-5.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们重点关注几个方面的宏观问题。第一是全球是否会陷入衰退。全球面临通胀压力，各国央行必须采取紧缩政策，对经济负面影响会逐步显现。美国联储加息缩表对经济负面影响较大，欧洲深受高能源价格之害，中国居民消费现在面临下行压力。现在不同于 2011 年或者 2015 年，当时全球处于紧缩周期，货币政策空间较大。第二是全球疫情未来走向。第三是国内刺激政策力度。目前国内消费低迷，地产销售面临压力，政府下半年财政政策与货币政策力度是我们强烈关注的。第四是中美关系的走向。这是一个长期的重要因素，怎么强调都不为过。

关于下半年 A 股市场，我们预计将会维持成长股风格。全球经济面临衰退风险，国内经济复苏力度估计有限。未来三年需求能够持续增长的行业和个股是非常稀缺的，我们将会重点关注各个细分的行业的成长股。行业来看，未来三年可以维持高速增长的是光伏、军工和新能源汽车，以及医美等新兴消费行业。我们也会更加关注前沿科技，比如碳化硅、人形机器人，钠电池、网络安全、合成生物等领域。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

与基金会计账务的核对同时进行。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	432,581,796.31	354,708,771.91
结算备付金		920,873.42	3,328,002.64
存出保证金		226,986.29	475,784.78
交易性金融资产	6.4.7.2	941,018,904.70	1,239,620,722.66
其中：股票投资		941,018,904.70	1,239,620,722.66
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		33,374,933.17	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	43,199.53
资产总计		1,408,123,493.89	1,598,176,481.52
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		11,122,585.13	4,830,176.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,678,547.89	2,007,161.34
应付托管费		279,757.97	334,526.88
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.7	847,196.14	1,663,504.02
负债合计		13,928,087.13	8,835,368.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,153,976,912.81	1,153,976,912.81
未分配利润	6.4.7.9	240,218,493.95	435,364,200.09
净资产合计		1,394,195,406.76	1,589,341,112.90
负债和净资产总计		1,408,123,493.89	1,598,176,481.52

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2082 元，基金份额总额 1,153,976,912.81 份。

比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年末”余额。

6.2 利润表

会计主体：汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-183,170,395.56	-38,957,857.85
1. 利息收入		820,583.92	832,060.53
其中：存款利息收入	6.4.7.10	820,583.92	832,060.53
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-166,444,301.25	141,277,638.52
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-174,936,680.37	136,859,812.06
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	8,492,379.12	4,417,826.46
以摊余成本计量的金融		-	-

资产终止确认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-17,546,678.23	-181,067,556.90
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	-	-
减：二、营业总支出		11,975,310.58	18,855,609.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,172,843.07	11,419,677.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,695,473.85	1,903,279.60
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.21	106,993.66	5,532,652.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-195,145,706.14	-57,813,467.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-195,145,706.14	-57,813,467.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-195,145,706.14	-57,813,467.32

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,153,976,912.81	435,364,200.09	1,589,341,112.90
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,153,976,912.81	435,364,200.09	1,589,341,112.90

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-195,145,706.14	-195,145,706.14
（一）、综合收益总额	-	-195,145,706.14	-195,145,706.14
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,153,976,912.81	240,218,493.95	1,394,195,406.76
项目	上年度可比期间		
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,153,976,912.81	399,158,960.63	1,553,135,873.44
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,153,976,912.81	399,158,960.63	1,553,135,873.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-57,813,467.32	-57,813,467.32
（一）、综合收益总额	-	-57,813,467.32	-57,813,467.32
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产（基金净值）	1,153,976,912.81	341,345,493.31	1,495,322,406.12

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>张暉</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 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]186 号文《关于准予汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2019 年 9 月 4 日正式生效，首次设立募集规模为 1,153,976,912.81 份基金份额。本基金为契约型，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选优质个股进行中长期投资，为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数

收益率×60% + 恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+ 中债综合指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

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

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

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

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

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后

金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 354,708,771.91 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 41,316.66 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 354,750,088.57 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,328,002.64 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,647.36 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,329,650.00 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 475,784.78 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 235.51 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 476,020.29 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 43,199.53 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 41,316.66 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 1,647.36 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 235.51 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

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

2. 增值税

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

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从

公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6. 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
活期存款	432,581,796.31
等于：本金	432,537,323.55
加：应计利息	44,472.76
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	432,581,796.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	898,065,411.74	-	941,018,904.70	42,953,492.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	898,065,411.74	-	941,018,904.70	42,953,492.96

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	662,976.59
其中：交易所市场	662,976.59
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	124,712.18
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-

应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	847,196.14

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,153,976,912.81	1,153,976,912.81
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	1,153,976,912.81	1,153,976,912.81

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	374,864,028.90	60,500,171.19	435,364,200.09
本期利润	-177,599,027.91	-17,546,678.23	-195,145,706.14
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	197,265,000.99	42,953,492.96	240,218,493.95

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	779,710.39
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	35,422.32
其他	5,451.21
合计	820,583.92

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,458,499,616.39
减：卖出股票成本总额	1,629,388,060.96
减：交易费用	4,048,235.80
买卖股票差价收入	-174,936,680.37

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,492,379.12
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	8,492,379.12

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-17,546,678.23
——股票投资	-17,546,678.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-17,546,678.23

6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	9,121.35
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	3,652.76
合计	106,993.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	78,551,157.10	2.81	171,214,346.23	5.15

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	55,872.00	2.67	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	149,567.80	5.11	17,885.73	1.54

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,172,843.07	11,419,677.74
其中：支付销售机构的客户维护费	4,178,713.70	4,723,339.00

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,695,473.85	1,903,279.60

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 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 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，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自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	432,581,796.31	779,710.39	471,918,756.47	764,041.68

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（2022 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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

	称	购日		限类型			股)			
300834	星辉环材	2022年01月06日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	
301103	何氏眼科	2022年03月14日	6个月	新股流通受限	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	
301109	军信股份	2022年04月06日	6个月	新股流通受限	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	
301110	青木股份	2022年03月04日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	
301116	益客食品	2022年01月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	
301117	佳缘科技	2022年01月07日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	
301123	奕东电子	2022年01月14日	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	

		日		限					
301135	瑞德智能	2022年04月01日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88
301139	元道通信	2022年06月30日	6个交易日	新股流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10
301139	元道通信	2022年06月30日	6个月	新股流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36
301148	嘉戎技术	2022年04月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40
301162	国能日新	2022年04月19日	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74
301175	中科环保	2022年06月30日	6个交易日	新股流通受限	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68
301175	中科环保	2022年06月30日	6个月	新股流通受限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40
30118	标	202	6	新	40.2	30.5	257	10,344.25	7,861.63

1	榜股份	2022年02月11日	个月	股流通受限	5	9				
301187	欧圣电气	2022年04月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	
301196	唯科科技	2022年01月04日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	
301200	大族数控	2022年02月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	834	63,851.04	43,301.28	
301201	诚达药业	2022年01月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	
301207	华兰疫苗	2022年02月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	
301212	联盛化学	2022年04月07日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	
301233	盛帮股	2022年06	8个交	新股流	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	

	份	月	易	通						
		24	日	受						
		日		限						
301233	盛帮股份	2022年06月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	
301235	华康医疗	2022年01月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	
301239	普瑞眼科	2022年06月22日	9个交易日	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	
301239	普瑞眼科	2022年06月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	
301263	泰恩康	2022年03月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	
301268	铭利达	2022年03月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	
301286	侨源股份	2022年06月06日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	

600941	中国移动	2021年12月24日	6个月	新股流通受限	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38	
688153	唯捷创芯	2022年04月01日	6个月	新股流通受限	66.60	44.24	7,496	499,233.60	331,623.04	
688237	超卓航科	2022年06月24日	5个交易日	新股流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	
688262	国芯科技	2021年12月28日	6个月	新股流通受限	41.98	47.75	7,129	299,275.42	340,409.75	
688400	凌云光	2022年06月27日	6个月	新股流通受限	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购	受限期	流通受限	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

		日		类型						
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“何氏眼科”（证券代码：301103）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 117 股（根据何氏眼科 2021 年年度权益分派实施公告，何氏眼科以公司现有总股本 121,558,824 股为基数，向全体股东每 10 股派 6 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股，除权除息日为 2022 年 6 月 1 日。）。本基金持有的流通受限股票“军信股份”（证券代码：301109）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 613 股（根据军信股份 2021 年年度权益分派实施公告，军信股份以公司现有总股本 273,340,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 3.80 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股，除权除息日为 2022 年 6 月 17 日。）。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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。

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

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

本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	432,581,796.31	-	-	-	-	-	432,581,796.31
结算备付金	920,873.42	-	-	-	-	-	920,873.42
存出保证金	226,986.29	-	-	-	-	-	226,986.29
交易性金融资产	-	-	-	-	-	941,018,904.70	941,018,904.70
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	33,374,933.17	33,374,933.17
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收 申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	433,729,656.02	-	-	-	-	974,393,837.87	1,408,123,493.89
负债							
短期 借款	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融负 债	-	-	-	-	-	-	-
衍生 金融 负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 清算 款	-	-	-	-	-	11,122,585.13	11,122,585.13
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	1,678,547.89	1,678,547.89
应付 托管 费	-	-	-	-	-	279,757.97	279,757.97
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	-	-

投资顾问费							
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	847,196.14	847,196.14
负债总计	-	-	-	-	-	13,928,087.13	13,928,087.13
利率敏感度缺口	433,729,656.02	-	-	-	-	960,465,750.74	1,394,195,406.76
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	354,708,771.91	-	-	-	-	-	354,708,771.91
结算备付金	3,328,002.64	-	-	-	-	-	3,328,002.64
存出保证金	475,784.78	-	-	-	-	-	475,784.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,239,620,722.66	1,239,620,722.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	43,199.53	43,199.53
资产总计	358,512,559.33	-	-	-	-	1,239,663,922.19	1,598,176,481.52
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	4,830,176.38	4,830,176.38
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,007,161.34	2,007,161.34

应付托管费	-	-	-	-	-	334,526.88	334,526.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,663,504.02	1,663,504.02
负债总计	-	-	-	-	-	8,835,368.62	8,835,368.62
利率敏感度缺口	358,512,559.33	-	-	-	-	1,230,828,553.57	1,589,341,112.90

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

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	61,305,064.82	-	61,305,064.82
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	61,305,064.82	-	61,305,064.82
以外币计价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管	-	-	-	-

费				
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	61,305,064.82	-	61,305,064.82
	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
项目	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	187,755,299.20	-	187,755,299.20
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	187,755,299.20	-	187,755,299.20
以外币计				

价的负债				
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	187,755,299.20	-	187,755,299.20

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	1. 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	3,065,253.24	9,387,764.96
港币相对人民	-3,065,253.24	-9,387,764.96	

	币贬值 5%		
--	--------	--	--

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	941,018,904.70	67.50	1,239,620,722.66	78.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	941,018,904.70	67.50	1,239,620,722.66	78.00

本基金封闭期内，投资于股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-100%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）。本基金封闭期届满转为开放式运作后，股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）。本基金封闭期内，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；封闭期届满转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有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 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数 上涨 5%	49,949,493.96	63,570,950.44
沪深 300 指数 下跌 5%	-49,949,493.96	-63,570,950.44	

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 06 月 30 日
第一层次	933,573,647.47
第二层次	1,126,306.41
第三层次	6,318,950.82
合计	941,018,904.70

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资

的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	941,018,904.70	66.83
	其中：股票	941,018,904.70	66.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	433,502,669.73	30.79
8	其他各项资产	33,601,919.46	2.39
9	合计	1,408,123,493.89	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 61,305,064.82 元，占期末净值比例为 4.4%。

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	146,675.07	0.01
B	采矿业	45,683,991.70	3.28
C	制造业	722,416,195.23	51.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,594.32	0.00
E	建筑业	126,488.48	0.01
F	批发和零售业	838,409.70	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	100,827.18	0.01
H	住宿和餐饮业	148,942.32	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,121,168.44	3.59
J	金融业	24,036,591.24	1.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,739.45	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,370,246.98	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	753,692.62	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	33,784,866.17	2.42
R	文化、体育和娱乐业	127,410.98	0.01
S	综合	-	-
	合计	879,713,839.88	63.10

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	17,981,139.42	1.29
20 工业	-	-
25 可选消费	-	-
30 日常消费	13,392,275.40	0.96
35 医疗保健	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	29,931,650.00	2.15
合计	61,305,064.82	4.40

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	2,938,300	114,446,785.00	8.21
2	300855	图南股份	2,242,200	93,701,538.00	6.72
3	600519	贵州茅台	40,000	81,800,000.00	5.87
4	000858	五粮液	367,300	74,168,889.00	5.32
5	600690	海尔智家	2,139,367	58,747,017.82	4.21
6	002332	仙琚制药	5,022,100	49,317,022.00	3.54
7	688239	航宇科技	900,000	47,970,000.00	3.44
8	600941	中国移动	787,363	47,614,494.38	3.42
9	600529	山东药玻	1,689,842	47,231,083.90	3.39
10	600399	抚顺特钢	1,900,000	34,010,000.00	2.44
11	002044	美年健康	6,000,000	33,420,000.00	2.40
12	002594	比亚迪	100,000	33,349,000.00	2.39
13	002155	湖南黄金	2,635,600	31,996,184.00	2.29
14	06049	保利物业	700,000	29,931,650.00	2.15
15	002484	江海股份	1,200,000	28,008,000.00	2.01
16	601398	工商银行	5,000,000	23,850,000.00	1.71
17	01818	招金矿业	3,065,000	17,981,139.42	1.29
18	000975	银泰黄	1,400,900	13,644,766.00	0.98

		金			
19	02319	蒙牛乳业	400,000	13,392,275.40	0.96
20	002036	联创电子	800,000	12,288,000.00	0.88
21	688311	盟升电子	199,875	12,080,445.00	0.87
22	603520	司太立	400,047	11,249,321.64	0.81
23	002013	中航机电	800,047	9,880,580.45	0.71
24	688349	三一重能	26,446	1,077,674.50	0.08
25	688048	长光华芯	6,790	826,207.20	0.06
26	688261	东微半导	2,645	639,984.20	0.05
27	688262	国芯科技	7,129	340,409.75	0.02
28	688153	唯捷创芯	7,496	331,623.04	0.02
29	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.02
30	301201	诚达药业	3,525	257,444.02	0.02
31	688800	瑞可达	1,967	248,451.77	0.02
32	688325	赛微微电	4,039	247,186.80	0.02
33	605117	德业股份	878	245,743.42	0.02
34	301268	铭利达	6,407	243,766.07	0.02
35	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
36	301058	中粮工科	13,860	241,025.40	0.02
37	301263	泰恩康	6,813	234,514.72	0.02
38	301187	欧圣电气	8,759	228,329.22	0.02
39	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
40	688553	汇宇制药	8,928	216,861.12	0.02
41	301096	百诚医药	2,714	214,406.00	0.02
42	688209	英集芯	6,822	208,753.20	0.01

43	688246	嘉和美康	7,719	205,788.54	0.01
44	688269	凯立新材	1,941	205,746.00	0.01
45	301162	国能日新	3,331	201,609.02	0.01
46	301018	申菱环境	7,811	201,601.91	0.01
47	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
48	300834	星辉环材	6,349	191,974.69	0.01
49	301091	深城交	6,812	185,967.60	0.01
50	688206	概伦电子	6,000	182,400.00	0.01
51	300957	贝泰妮	818	177,939.54	0.01
52	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.01
53	301103	何氏眼科	5,065	171,479.62	0.01
54	301123	奕东电子	6,551	170,810.09	0.01
55	301082	久盛电气	9,144	169,621.20	0.01
56	688212	澳华内镜	3,496	163,612.80	0.01
57	688621	阳光诺和	1,485	162,459.00	0.01
58	301235	华康医疗	4,178	162,419.54	0.01
59	688766	普冉股份	986	160,846.18	0.01
60	301212	联盛化学	4,158	155,441.76	0.01
61	301073	君亭酒店	2,148	148,942.32	0.01
62	301117	佳缘科技	2,616	145,922.50	0.01
63	301136	招标股份	7,172	143,081.40	0.01
64	688087	英科再生	2,469	142,881.03	0.01
65	688173	希荻微	4,236	142,117.80	0.01

66	301093	华兰股份	4,088	138,542.32	0.01
67	300994	久祺股份	4,195	137,637.95	0.01
68	301180	万祥科技	6,536	136,929.20	0.01
69	301118	恒光股份	3,142	135,200.26	0.01
70	301148	嘉戎技术	5,153	133,358.10	0.01
71	301088	戎美股份	7,036	131,291.76	0.01
72	301199	迈赫股份	4,014	128,608.56	0.01
73	688259	创耀科技	1,595	128,509.15	0.01
74	688150	莱特光电	5,626	125,122.24	0.01
75	688626	翔宇医疗	3,652	121,465.52	0.01
76	301179	泽宇智能	2,941	120,022.21	0.01
77	301116	益客食品	5,764	119,695.02	0.01
78	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
79	688670	金迪克	2,310	116,932.20	0.01
80	688625	呈和科技	2,672	116,606.08	0.01
81	688257	新锐股份	2,899	114,858.38	0.01
82	688305	科德数控	1,496	114,249.52	0.01
83	300996	普联软件	3,855	113,915.25	0.01
84	688267	中触媒	3,390	113,327.70	0.01
85	688663	新风光	3,279	111,387.63	0.01
86	301078	孩子王	7,551	110,697.66	0.01
87	688636	智明达	918	104,092.02	0.01
88	301017	漱玉平民	5,550	102,897.00	0.01
89	301196	唯科科技	2,705	102,319.16	0.01

90	301092	争光股份	3,230	101,615.80	0.01
91	301046	能辉科技	2,891	100,057.51	0.01
92	301015	百洋医药	4,614	99,570.12	0.01
93	601825	沪农商行	15,480	97,059.60	0.01
94	301135	瑞德智能	3,376	96,066.48	0.01
95	688359	三孚新科	2,213	93,277.95	0.01
96	301048	金鹰重工	8,424	92,748.24	0.01
97	688070	纵横股份	2,407	92,693.57	0.01
98	300967	晓鸣股份	5,061	91,148.61	0.01
99	300933	中辰股份	11,117	90,603.55	0.01
100	688163	赛伦生物	3,607	89,814.30	0.01
101	688121	卓然股份	3,681	89,485.11	0.01
102	300774	倍杰特	4,435	89,409.60	0.01
103	688193	仁度生物	1,635	88,453.50	0.01
104	688697	纽威数控	5,837	88,372.18	0.01
105	301021	英诺激光	2,899	87,549.80	0.01
106	688661	和林微纳	1,452	87,061.92	0.01
107	688115	思林杰	2,153	86,636.72	0.01
108	301110	青木股份	2,013	86,466.00	0.01
109	688793	倍轻松	1,454	85,800.54	0.01
110	301052	果麦文化	2,520	82,983.60	0.01
111	688611	杭州柯林	1,400	82,292.00	0.01
112	688456	有研粉材	3,396	82,217.16	0.01

113	688628	优利德	2,789	81,968.71	0.01
114	301181	标榜股份	2,564	81,939.40	0.01
115	688283	坤恒顺维	1,595	76,033.65	0.01
116	301026	浩通科技	2,027	74,755.76	0.01
117	603529	爱玛科技	1,427	74,746.26	0.01
118	688685	迈信林	2,612	74,703.20	0.01
119	688195	腾景科技	2,693	74,649.96	0.01
120	301098	金埔园林	3,069	74,423.25	0.01
121	301038	深水规院	3,458	71,891.82	0.01
122	301012	扬电科技	1,691	69,347.91	0.00
123	301027	华蓝集团	2,856	69,343.68	0.00
124	688768	容知日新	907	68,551.06	0.00
125	300979	华利集团	925	67,599.00	0.00
126	688229	博睿数据	1,643	66,541.50	0.00
127	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
128	688113	联测科技	1,415	64,453.25	0.00
129	301055	张小泉	3,541	62,958.98	0.00
130	688799	华纳药厂	1,917	61,631.55	0.00
131	301062	上海艾录	5,225	60,975.75	0.00
132	300971	博亚精工	2,445	60,269.25	0.00
133	300814	中富电路	3,280	60,024.00	0.00
134	300943	春晖智控	3,813	59,902.23	0.00
135	301177	迪阿股份	792	58,766.40	0.00

136	688355	明志科技	2,710	58,021.10	0.00
137	301072	中捷精工	1,802	57,718.06	0.00
138	301011	华立科技	1,750	57,557.50	0.00
139	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.00
140	688296	和达科技	2,173	57,041.25	0.00
141	688787	海天瑞声	817	56,658.95	0.00
142	688511	天微电子	1,490	55,785.60	0.00
143	688718	唯赛勃	3,145	55,414.90	0.00
144	301010	晶雪节能	2,172	55,060.20	0.00
145	688191	智洋创新	3,203	54,451.00	0.00
146	301057	汇隆新材	2,173	52,912.55	0.00
147	300948	冠中生态	3,229	51,244.23	0.00
148	301016	雷尔伟	2,747	51,231.55	0.00
149	688255	凯尔达	1,648	50,923.20	0.00
150	688071	华依科技	1,101	50,910.24	0.00
151	600955	维远股份	1,694	48,854.96	0.00
152	688117	圣诺生物	1,672	48,571.60	0.00
153	688607	康众医疗	1,890	48,535.20	0.00
154	688468	科美诊断	3,919	48,321.27	0.00
155	688260	昀冢科技	2,990	48,079.20	0.00
156	301032	新柴股份	5,124	47,653.20	0.00
157	301049	超越科技	1,954	46,329.34	0.00
158	301036	双乐股份	2,047	46,016.56	0.00

159	301007	德迈仕	3,022	45,541.54	0.00
160	301033	迈普医学	1,076	45,310.36	0.00
161	301200	大族数控	834	43,301.28	0.00
162	001203	大中矿业	3,809	43,041.70	0.00
163	301041	金百泽	2,150	42,376.50	0.00
164	301037	保立佳	1,923	41,998.32	0.00
165	601156	东航物流	2,090	41,382.00	0.00
166	300995	奇德新材	1,909	40,852.60	0.00
167	300854	中兰环保	2,026	40,276.88	0.00
168	688655	迅捷兴	3,083	39,585.72	0.00
169	001227	兰州银行	7,868	38,710.56	0.00
170	688328	深科达	1,499	37,699.85	0.00
171	688232	新点软件	1,000	37,620.00	0.00
172	300973	立高食品	360	37,422.00	0.00
173	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
174	301053	远信工业	1,544	36,067.84	0.00
175	688659	元琛科技	3,671	34,764.37	0.00
176	301068	大地海洋	1,436	34,679.40	0.00
177	301079	邵阳液压	1,396	34,620.80	0.00
178	688395	正弦电气	1,627	34,215.81	0.00
179	688517	金冠电气	2,892	33,662.88	0.00
180	688272	富吉瑞	1,263	33,545.28	0.00
181	688565	力源科技	3,450	33,534.00	0.00
182	688226	威腾电气	2,693	33,527.85	0.00
183	601665	齐鲁银	6,731	32,847.28	0.00

		行			
184	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
185	300867	圣元环保	1,498	31,338.16	0.00
186	001201	东瑞股份	802	30,941.16	0.00
187	300910	瑞丰新材	474	29,966.28	0.00
188	688038	中科通达	2,132	29,911.96	0.00
189	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
190	603071	物产环能	1,627	29,513.78	0.00
191	605507	国邦医药	1,202	29,028.30	0.00
192	605009	豪悦护理	741	28,810.08	0.00
193	001213	中铁特货	5,818	28,566.38	0.00
194	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
195	688701	卓锦股份	2,340	27,658.80	0.00
196	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.00
197	300981	中红医疗	1,082	27,288.04	0.00
198	688501	青达环保	1,759	27,071.01	0.00
199	688067	爱威科技	1,259	26,212.38	0.00
200	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
201	688681	科汇股份	1,899	25,313.67	0.00
202	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.00
203	600935	华塑股份	4,811	25,209.64	0.00
204	605089	味知香	370	24,978.70	0.00
205	301069	凯盛新	539	24,853.29	0.00

		材			
206	601921	浙版传媒	3,154	24,538.12	0.00
207	300869	康泰医学	862	24,360.12	0.00
208	605555	德昌股份	917	23,355.99	0.00
209	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.00
210	301039	中集车辆	2,064	22,353.12	0.00
211	605339	南侨食品	864	21,919.68	0.00
212	001208	华菱线缆	1,754	21,784.68	0.00
213	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.00
214	605020	永和股份	850	20,927.00	0.00
215	300872	天阳科技	1,568	20,901.44	0.00
216	001228	永泰运	383	20,739.45	0.00
217	605167	利柏特	2,471	19,595.03	0.00
218	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
219	605296	神农集团	740	19,025.40	0.00
220	603176	汇通集团	1,924	18,393.44	0.00
221	601528	瑞丰银行	2,230	17,973.80	0.00
222	603171	税友股份	637	17,823.26	0.00
223	300878	维康药业	722	16,902.02	0.00
224	001212	中旗新材	400	16,852.00	0.00
225	001217	华尔泰	1,239	16,776.06	0.00
226	001215	千味央厨	295	16,605.55	0.00
227	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
228	001319	铭科精	536	15,474.32	0.00

		技			
229	001317	三羊马	300	15,222.00	0.00
230	001216	华瓷股份	1,178	15,137.30	0.00
231	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.00
232	300930	屹通新材	420	15,086.40	0.00
233	300982	苏文电能	317	14,886.32	0.00
234	603230	内蒙新华	1,140	14,261.40	0.00
235	605056	咸亨国际	934	14,168.78	0.00
236	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
237	300986	志特新材	369	13,579.20	0.00
238	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
239	603216	梦天家居	772	12,498.68	0.00
240	605162	新中港	1,377	12,461.85	0.00
241	300997	欢乐家	928	12,398.08	0.00
242	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00
243	603213	镇洋发展	799	11,961.03	0.00
244	001218	丽臣实业	490	11,701.20	0.00
245	001207	联科科技	682	11,600.82	0.00
246	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
247	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
248	300898	熊猫乳品	496	11,160.00	0.00
249	605319	无锡振华	764	11,108.56	0.00
250	300908	仲景食品	285	10,724.55	0.00
251	605365	立达信	645	10,687.65	0.00

252	301185	鸥玛软件	578	10,687.22	0.00
253	605599	菜百股份	980	10,662.40	0.00
254	001206	依依股份	321	10,641.15	0.00
255	300968	格林精密	1,162	10,527.72	0.00
256	300942	易瑞生物	443	10,233.30	0.00
257	605598	上海港湾	553	9,987.18	0.00
258	605566	福莱蒾特	435	9,926.70	0.00
259	001296	长江材料	403	9,905.74	0.00
260	605567	春雪食品	629	9,850.14	0.00
261	605033	美邦股份	423	9,809.37	0.00
262	300993	玉马遮阳	738	9,431.64	0.00
263	605069	正和生态	608	9,326.72	0.00
264	605196	华通线缆	1,172	9,235.36	0.00
265	603048	浙江黎明	464	9,224.32	0.00
266	301013	利和兴	756	9,064.44	0.00
267	605138	盛泰集团	723	9,023.04	0.00
268	001234	泰慕士	333	9,017.64	0.00
269	605580	恒盛能源	654	8,815.92	0.00
270	605287	德才股份	349	8,798.29	0.00
271	300962	中金辐照	576	8,697.60	0.00
272	300966	共同药业	286	8,537.10	0.00
273	605011	杭州热电	525	8,526.00	0.00
274	605259	绿田机	295	8,425.20	0.00

		械			
275	001288	运机集团	537	8,382.57	0.00
276	300614	百川畅银	329	8,277.64	0.00
277	001219	青岛食品	353	8,066.05	0.00
278	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
279	001210	金房节能	311	7,790.55	0.00
280	300945	曼卡龙	474	7,621.92	0.00
281	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.00
282	001209	洪兴股份	450	6,849.00	0.00
283	300911	亿田智能	83	6,378.55	0.00
284	300958	建工修复	300	5,934.00	0.00
285	300952	恒辉安防	340	5,916.00	0.00
286	300991	创益通	406	5,838.28	0.00
287	300955	嘉亨家化	232	5,688.64	0.00
288	301025	读客文化	427	5,627.86	0.00
289	300972	万辰生物	430	5,559.90	0.00
290	300950	德固特	328	5,346.40	0.00
291	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
292	300992	泰福泵业	200	4,262.00	0.00
293	300929	华骐环保	293	4,028.75	0.00
294	001205	盛航股份	108	2,138.40	0.00
295	300865	大宏立	11	236.50	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	600887	伊利股份	113,650,919.24	7.15
2	000858	五粮液	82,442,771.03	5.19
3	600690	海尔智家	77,001,015.70	4.84
4	600519	贵州茅台	75,799,384.60	4.77
5	03690	美团-W	70,749,020.97	4.45
6	002594	比亚迪	68,196,394.98	4.29
7	600399	抚顺特钢	67,618,604.20	4.25
8	603982	泉峰汽车	57,918,155.69	3.64
9	000792	盐湖股份	48,466,806.87	3.05
10	002332	仙琚制药	47,988,788.91	3.02
11	300855	图南股份	45,251,978.30	2.85
12	600941	中国移动	44,073,254.00	2.77
13	600529	山东药玻	40,315,578.54	2.54
14	002985	北摩高科	38,119,694.48	2.40
15	601857	中国石油	35,152,195.00	2.21
16	603997	继峰股份	33,875,792.62	2.13
17	603179	新泉股份	32,052,111.00	2.02
18	002155	湖南黄金	27,766,119.41	1.75
19	002484	江海股份	26,008,565.46	1.64
20	600570	恒生电子	25,563,235.02	1.61

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	600690	海尔智家	86,692,418.28	5.45
1	06690	海尔智家	26,817,409.03	1.69
2	002594	比亚迪	92,480,425.04	5.82
3	002484	江海股份	89,603,485.39	5.64
4	600588	用友网络	86,782,205.35	5.46
5	600399	抚顺特钢	71,983,289.64	4.53
6	03690	美团-W	58,869,249.04	3.70
7	06049	保利物业	52,499,770.84	3.30
8	603997	继峰股份	52,085,395.66	3.28
9	000792	盐湖股份	49,903,247.37	3.14

10	603982	泉峰汽车	49,302,024.69	3.10
11	605123	派克新材	45,083,338.00	2.84
12	000858	五粮液	42,430,098.00	2.67
13	300193	佳士科技	42,402,810.00	2.67
14	603348	文灿股份	40,630,573.71	2.56
15	603501	韦尔股份	40,352,998.84	2.54
16	601857	中国石油	32,509,108.00	2.05
17	00700	腾讯控股	32,084,456.43	2.02
18	002985	北摩高科	30,274,573.00	1.90
19	603179	新泉股份	29,225,146.00	1.84
20	300990	同飞股份	27,129,410.00	1.71

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	1,348,332,921.23
卖出股票收入（成交）总额	1,458,499,616.39

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

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人民银行及其派出机构、银保监会及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、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	226,986.29
2	应收清算款	33,374,933.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,601,919.46

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

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	600941	中国移动	5,264,494.38	0.38	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

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（%）
16,763	68,840.72	850,823.35	0.07	1,153,126,089.46	99.93

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,542,665.47	0.13

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年09月04日）基金份额总额	1,153,976,912.81
本报告期期初基金份额总额	1,153,976,912.81
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,153,976,912.81

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

开源证券	2	454,836,565.38	16.30	325,014.15	15.55	
天风证券	2	389,346,450.69	13.95	290,633.64	13.91	
东方财富	2	342,163,632.19	12.26	263,342.81	12.60	
国泰君安	2	312,641,844.19	11.20	257,138.30	12.31	
安信证券	2	292,755,325.27	10.49	231,999.18	11.10	
东北证券	2	184,931,418.28	6.63	132,507.83	6.34	
广发证券	4	150,629,187.71	5.40	109,223.01	5.23	
华安证券	2	147,406,822.83	5.28	106,327.11	5.09	
中信证券	2	147,043,251.76	5.27	105,068.71	5.03	
中信建投证券	2	87,130,014.21	3.12	63,226.65	3.03	
东方证券	2	78,551,157.10	2.81	55,872.00	2.67	
国金证券	2	64,195,743.22	2.30	47,607.52	2.28	
申万宏源证券	2	63,239,702.26	2.27	47,395.86	2.27	
国信证券	2	40,090,797.00	1.44	28,640.81	1.37	
海通证券	2	35,753,895.59	1.28	25,707.30	1.23	
北京高华	2	-	-	-	-	
财达证券	2	-	-	-	-	
德邦证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
民生证券	2	-	-	-	-	
招商证券	3	-	-	-	-	

中原 证券	2	-	-	-	-	
----------	---	---	---	---	---	--

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商 名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交 金额	占当期债 券成交总 额的比例 (%)	成交 金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例 (%)	成交 金额	占当期权 证成交总 额的比例 (%)	成交 金额	占当期基 金成交总 额的比例 (%)
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京 高华	-	-	-	-	-	-	-	-
财达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

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

10.8 其他重大事件

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

- 2、《汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富 3 年封闭运作竞争优势灵活配置混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2022 年 08 月 31 日