

# 汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证 券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 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 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
§ 5 托管人报告 .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	15
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	20
§ 7 投资组合报告 .....	56
7.1 期末基金资产组合情况 .....	56
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	56
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	58
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	81
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	83
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	83
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	84
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 .....	84
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	84

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	84
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	84
7.12 投资组合报告附注.....	84
§ 8 基金份额持有人信息 .....	85
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	85
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	86
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	86
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	86
§ 9 开放式基金份额变动 .....	87
§ 10 重大事件揭示 .....	87
10.1 基金份额持有人大会决议.....	87
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.....	87
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	87
10.4 基金投资策略的改变.....	87
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	88
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	88
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	88
10.8 其他重大事件.....	92
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	93
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.....	94
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	94
§ 12 备查文件目录 .....	94
12.1 备查文件目录.....	94
12.2 存放地点 .....	94
12.3 查阅方式 .....	94

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证沪港深 500ETF
场内简称	HGS500
基金主代码	517080
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 02 月 01 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	717,166,000.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 02 月 22 日

注：扩位证券简称：沪港深 500ETF 基金。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证沪港深 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		李文	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日 - 2022年06月30日)
本期已实现收益	-20,753,857.87
本期利润	-42,499,105.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0572
本期加权平均净值利润率	-7.25%
本期基金份额净值增长率	-6.22%

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	-130,365,020.38
期末可供分配基金份额利润	-0.1818
期末基金资产净值	586,800,979.62
期末基金份额净值	0.8182
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	-18.18%

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。

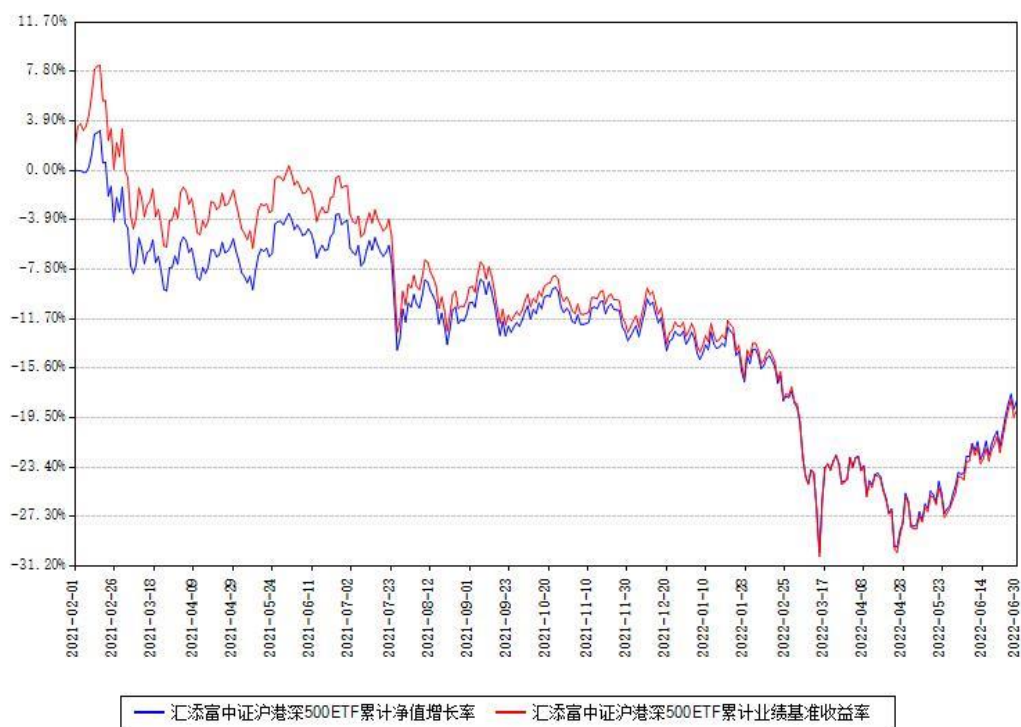
### 3.2 基金净值表现

#### 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	7.38%	1.10%	6.87%	1.13%	0.51%	-0.03%
过去三个月	6.72%	1.38%	5.93%	1.36%	0.79%	0.02%
过去六个月	-6.22%	1.51%	-7.78%	1.55%	1.56%	-0.04%
过去一年	-14.73%	1.28%	-17.88%	1.31%	3.15%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	-18.18%	1.23%	-18.90%	1.29%	0.72%	-0.06%

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

汇添富中证沪港深500ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2021年02月01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		
董瑾	本基金的基金经理	2021 年 02 月 01 日		13	国籍：中国。学历：北京大学西方经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证

					<p>全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017年12月18日至2019年12月31日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019年12月4日至今任汇添富沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年12月31日至今任汇添富沪深300指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019年12月31日至今任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019年12月31日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020年3月5日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021年2月1日至今</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 9 日至今任汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日任汇添富中证电池主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 26 日至今任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 3 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 23 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至今任汇添富中证</p>
--	--	--	--	--	--

					国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------------

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事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，国内外经济形势较为复杂多变，经济增长压力较大。国家统计局数据显示，一季度我国 GDP 同比增长 4.8%，实现平稳开局；二季度 GDP 同比增长 0.4%，经济顶住压力实现正增长。二季度以来，消费延续恢复态势；稳投资持续加力，基础设施建设提速推进，投资需求平稳增长；产业链供应链不断修复，外贸保持较快增长态势。总体看，一系列稳经济大盘政策扎实推进落地显效，5、6 月份工业生产恢复加快，工业经济呈企稳恢复态势。

政策方面，稳增长仍处于重要位置。6 月 29 日国常会决定，运用政策性、开发性金融工具，通过发行金融债券等筹资 3000 亿元，用于补充包括新型基础设施在内的重大项目资本金。央行二季度例会强调要强化跨周期和逆周期调节，加大稳健货币政策实施力度；发挥好货币政策工具的总量和结构双重功能，主动应对提振信心，为实体经济提供更有力的支持，稳定宏观经济大盘；进一步疏通货币政策传导机制，保持流动性合理充裕，增强信贷总量增长的稳定性，保持货币供应量和社会融资规模增速同名义经济增速基本匹配。

上半年权益市场整体波动较大，在经历一季度较大幅度的调整后，二季度以来估值修复明显。资金持续流入，投资者情绪偏暖，风险偏好逐步恢复。从行业主题层面来看，前期调整幅度较大的新能源板块估值修复的力度也较大。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-6.22%。同期业绩比较基准收益率为-7.78%。

#### 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，全球形势仍在持续演变，外部环境不确定性仍在。国内经济持续温和复苏，

受益于稳增长和流动性宽松的各项政策，经济形势可能趋于稳健。当前来看经济增长压力仍然较大，政策方面预计仍将以稳增长、稳就业、稳物价、稳信心为主。稳增长政策持续落地，货币政策大概率将维持宽松。

权益市场受到经济复苏预期和流动性等因素的影响，整体可能震荡向上。风格方面，如果流动性维持宽松，则大概率成长风格占优。行业主题方面，新能源板块经过前期的估值修复已经回到过去两年的估值中枢附近，后续需持续跟踪基本面对景气程度的验证情况。随着经济的逐步恢复，受益于稳增长政策的发力，基建、消费等板块预计也将有所表现。

目前来看港股科技股的估值已经回到较为合理的区间，科技股仍然是港股市场最具特色的资产，在后续监管合规要求逐步落地实施后，具备长期的配置价值。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期

增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	38,236,248.32	41,645,701.38
结算备付金		7,653,687.57	6,519,378.63
存出保证金		2,576,015.57	2,863,212.75

交易性金融资产	6.4.7.2	539,097,489.84	627,301,640.11
其中：股票投资		539,046,486.04	626,737,640.11
基金投资		-	-
债券投资		51,003.80	564,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	73,034.88
应收股利		1,548,314.19	44,679.11
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	6,785.15
资产总计		589,111,755.49	678,454,432.01
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,998,191.54	53.25
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		70,247.15	87,243.40
应付托管费		23,415.71	29,081.13
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	17,510.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	218,921.13	257,379.98
负债合计		2,310,775.87	391,267.98
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	717,166,000.00	777,166,000.00
未分配利润	6.4.7.9	-130,365,020.38	-99,102,835.97
净资产合计		586,800,979.62	678,063,164.03
负债和净资产总计		589,111,755.49	678,454,432.01

注：1、报告截止日2022年06月30日，基金份额净值0.8182元，基金份额总额717,166,000.00



份。

2、本基金合同生效日为 2021 年 02 月 01 日，上年度实际报告期间为 2021 年 02 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日，特此说明。

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

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 02 月 01 日 (基金合同生效 日)至 2021 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-41,812,367.22</b>	<b>-41,757,622.99</b>
1. 利息收入		111,865.28	524,411.12
其中：存款利息收入	6.4.7.10	110,491.34	524,263.71
债券利息收入		-	147.41
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		1,373.94	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-20,334,806.79	-3,545,080.23
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-22,937,971.34	-11,842,543.83
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	165,733.98	165,336.38
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	-3,696,322.45	-
股利收益	6.4.7.17	6,133,753.02	8,132,127.22
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	-21,745,247.44	-39,032,855.51
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	155,821.73	295,901.63
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>686,738.09</b>	<b>3,197,972.75</b>
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	437,537.86	641,644.38
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	145,845.96	213,881.45
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		35.20	0.24
8. 其他费用	6. 4. 7. 21	103,319.07	2,342,446.68
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-42,499,105.31</b>	<b>-44,955,595.74</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-42,499,105.31</b>	<b>-44,955,595.74</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-42,499,105.31</b>	<b>-44,955,595.74</b>

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：汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金

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)	777,166,000.00	-99,102,835.97	678,063,164.03
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	777,166,000.00	-99,102,835.97	678,063,164.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-60,000,000.00	-31,262,184.41	-91,262,184.41
(一)、综合收益总额	-	-42,499,105.31	-42,499,105.31

(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)	-60,000,000.00	11,236,920.90	-48,763,079.10
其中: 1. 基金申购款	16,000,000.00	-2,808,100.26	13,191,899.74
2. 基金赎回款	-76,000,000.00	14,045,021.16	-61,954,978.84
(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)	717,166,000.00	-130,365,020.38	586,800,979.62
项目	上年度可比期间 2021年02月01日(基金合同生效日)至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,089,166,000.00	-	1,089,166,000.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-136,000,000.00	-38,626,062.73	-174,626,062.73
(一)、综合收益总额	-	-44,955,595.74	-44,955,595.74
(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)	-136,000,000.00	6,329,533.01	-129,670,466.99
其中: 1. 基金申购款	184,000,000.00	-6,996,097.88	177,003,902.12
2. 基金赎回款	-320,000,000.00	13,325,630.89	-306,674,369.11
(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)	953,166,000.00	-38,626,062.73	914,539,937.27
-----------------	----------------	----------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）[2020]3528 号《关于准予汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2021 年 2 月 1 日生效，首次设立募集规模为 1,089,166,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为：中证沪港深 500 指数收益率。

### 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（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 41,645,701.38 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 4,068.67 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 41,649,770.05 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 6,519,378.63 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,695.82 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 6,522,074.45 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 2,863,212.75 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 8.30 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 2,863,221.05 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 6,785.15 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 4,068.67 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 2,695.82 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 8.30 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 12.36 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 627,301,640.11 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 12.36 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 627,301,652.47 元。

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

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 1. 印花税

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

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

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

### 2. 增值税

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

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

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

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

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

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4. 企业所得税

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

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

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

### 5. 个人所得税

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

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

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

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

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

#### 6. 境外投资

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日
活期存款	38,236,248.32
等于：本金	38,233,006.48
加：应计利息	3,241.84
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	38,236,248.32

#### 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	662,599,340.62	-	539,046,486.04	123,552,854.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	51,000.00	3.80	51,003.80
	银行间市场	-	-	-

	其他	-	-	-	-
	合计	51,000.00	3.80	51,003.80	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		662,650,340.62	3.80	539,097,489.84	123,552,854.58

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	19,576,800.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	19,576,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	19,576,800.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2212	IF2212	16	21,283,200.00	1,706,400.00
合计				1,706,400.00
减：可抵销期货暂收款				1,706,400.00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 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	44,701.58
其中：交易所市场	44,701.58
银行间市场	-
应付利息	-

应付审计费	114,712.18
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	218,921.13

#### 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	777,166,000.00	777,166,000.00
本期申购	16,000,000.00	16,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-76,000,000.00	-76,000,000.00
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	717,166,000.00	717,166,000.00

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	-19,685,594.49	-79,417,241.48	-99,102,835.97
本期利润	-20,753,857.87	-21,745,247.44	-42,499,105.31
本期基金份额交易产生的变动数	2,219,075.70	9,017,845.20	11,236,920.90
其中：基金申购款	-482,988.88	-2,325,111.38	-2,808,100.26
基金赎回款	2,702,064.58	11,342,956.58	14,045,021.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-38,220,376.66	-92,144,643.72	-130,365,020.38

## 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	70,980.82
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	39,235.77
其他	274.75
合计	110,491.34

注：“其他”为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——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-19,884,853.54
股票投资收益——赎回差价收入	-3,053,117.80
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-22,937,971.34

## 6.4.7.11.2 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	63,575,934.31
减：卖出股票成本总额	83,280,644.67
减：交易费用	180,143.18
买卖股票差价收入	-19,884,853.54

## 6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	61,954,978.84
减：现金支付赎回款总额	39,743,542.84
减：赎回股票成本总额	25,264,553.80
减：交易费用	-



赎回差价收入	-3,053,117.80
--------	---------------

#### 6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	115.69
债券投资收益——买卖债券差价收入	165,618.29
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	165,733.98

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,173,245.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,007,500.00
减：应计利息总额	125.31
减：交易费用	1.83
买卖债券差价收入	165,618.29

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
卖出权证成交总额	95,792.08
减：卖出权证成本总额	87,170.40
减：交易费用	-
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	251.11
买卖权证差价收入	8,370.57

#### 6.4.7.16.2 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-3,704,693.02
外汇期货投资收益	-
国债期货投资收益	-
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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,133,753.02
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,133,753.02

#### 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	-23,585,147.44
——股票投资	-23,585,147.44
——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	1,839,900.00

——权证投资	-
——期货投资	1,839,900.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-21,745,247.44

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	155,821.73
其他	-
合计	155,821.73

#### 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	270.00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	8,829.52
合计	103,319.07

#### 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
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司

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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 02 月 01 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	39,071.57	0.04	816,968,439.71	56.40

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 02 月 01 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券成

		交总额的比例 (%)		交总额的比例 (%)
东方证券	90,955.10	7.75	70,492.69	6.86

#### 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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
东方证券	30.10	0.04	19.62	0.04
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例 (%)
东方证券	698,423.73	55.98	7,474.95	3.15

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 02 月 01 日（基 金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	437,537.86	641,644.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 02 月 01 日（基 金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	145,845.96	213,881.45

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	38,236,248.32	70,980.82	67,211,089.22	478,583.43

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	600958	东方证券	原股东优先配售	17,724.00	149,945.04
上年度可比期间 2021 年 02 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
				-	-

#### 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

本基金根据基金合同和招募书约定的投资策略，按照标的指数的成分股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券及基金托管人工商银行发行的股票工商银行。于本报告期

末,本基金按照指数权重比例持有东方证券 74,524.00 股,持有工商银行 1,842,600.00 股。

(于上年度可比期间,本基金按照指数权重比例持有东方证券 83,300.00 股,持有工商银行 2,513,000.00 股。)

#### 6.4.11 利润分配情况

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

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301103	何氏眼科	2022年03月14日	6个月	新股流通受限	32.82	32.02	101	3,315.00	3,234.02	
301109	军信股份	2022年04月06日	6个月	新股流通受限	23.27	16.14	184	4,281.63	2,969.76	
301110	青木股份	2022年03月04日	6个月	新股流通受限	63.10	39.85	37	2,334.70	1,474.45	
301135	瑞德智能	2022年04月01日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	106	3,389.88	2,783.56	



		日		限						
301148	嘉戎技术	2022 年 04 月 14 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	38.39	23.90	97	3,723.83	2,318.30	
301162	国能日新	2022 年 04 月 19 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	45.13	54.11	84	3,790.92	4,545.24	
301181	标榜股份	2022 年 02 月 11 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	
301187	欧圣电气	2022 年 04 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.33	22.54	234	4,991.22	5,274.36	
301200	大族数控	2022 年 02 月 18 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	76.56	51.92	229	17,532.24	11,889.68	
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	126	7,166.88	7,108.92	
301212	联	2022	6	新	29.67	33.28	139	4,124.13	4,625.92	

	盛化学	年 04 月 07 日	个 月	股 流 通 受 限						
301263	泰恩康	2022 年 03 月 22 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.93	31.38	195	3,886.35	6,119.10	
301268	铭利达	2022 年 03 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	28.50	34.87	92	2,622.00	3,208.04	
688163	赛伦生物	2022 年 03 月 02 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	33.03	23.56	802	26,490.06	18,895.12	

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
113060	浙22转债	2022 年 06 月 15 日	17 个 交 易 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.01	510	51,000.00	51,003.80	

6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

注：本基金持有的流通受限股票“何氏眼科”（证券代码：301103）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 23 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 61 股（根据军信股份 2021 年年度权益分派实施公告，军信股份以公司现有总股本 273,340,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 3.80 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股，除权除息日为 2022 年 6 月 17 日。）。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
00813	世茂集团	2022年04月01日	重大事项停牌	3.78	-	-	23,500	431,119.02	88,828.59	
01114	BRILLIANCE CHI	2021年03月31日	重大事项停牌	6.24	-	-	100,000	582,525.04	624,288.70	
01918	融创中国	2022年04月01日	重大事项停牌	3.92	-	-	48,000	1,152,451.45	188,004.97	
03333	中国恒大	2022年03月03日	重大事	1.41	-	-	33,000	414,714.54	46,565.10	

		月 21 日	项 停 牌						
0338 0	龙光集团	202 2年 05 月 12 日	重 大 事 项 停 牌	1.8 6	-	27,000	263,630.99	50,336.48	
0666 6	恒大物业	202 2年 03 月 21 日	重 大 事 项 停 牌	1.9 7	-	70,000	499,176.43	137,685.5 9	

#### 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；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素

的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	38,236,248.32	-	-	-	-	-	38,236,248.32
结算备付金	7,653,687.57	-	-	-	-	-	7,653,687.57
存出保证金	22,031.57	-	-	-	-	2,553,984.00	2,576,015.57
交易性金融资产	-	-	51,003.80	-	-	539,046,486.04	539,097,489.84
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	-	-	-	-	-	1,548,314.19	1,548,314.19
应收	-	-	-	-	-	-	-

申购款							
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	45,911,967.46	-	51,003.80	-	-	543,148,784.23	589,111,755.49
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	-	-	-	-	-	1,998,191.54	1,998,191.54
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,247.15	70,247.15
应付托管费	-	-	-	-	-	23,415.71	23,415.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资	-	-	-	-	-	-	-

顾问费							
应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	218,921.13	218,921.13
负债总计	-	-	-	-	-	2,310,775.87	2,310,775.87
利率敏感度缺口	45,911,967.46	-	51,003.80	-	-	540,838,008.36	586,800,979.62
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	41,645,701.38	-	-	-	-	-	41,645,701.38
结算备付金	6,519,378.63	-	-	-	-	-	6,519,378.63
存出保证金	18,449.55	-	-	-	-	2,844,763.20	2,863,212.75
交易性金融资产	-	-	564,000.00	-	-	626,737,640.11	627,301,640.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售	-	-	-	-	-	-	-



金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	73,034.88	73,034.88
应收股利	-	-	-	-	-	44,679.11	44,679.11
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	6,785.15	6,785.15
资产总计	48,183,529.56	-	564,000.00	-	-	629,706,902.45	678,454,432.01
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	-	-	-	-	-	53.25	53.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报	-	-	-	-	-	87,243.40	87,243.40

酬							
应付 托管 费	-	-	-	-	-	29,081.13	29,081.13
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 投资 顾问 费	-	-	-	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-	-	17,510.22	17,510.22
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税负 债	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	257,379.98	257,379.98
负债 总计	-	-	-	-	-	391,267.98	391,267.98
利率 敏感 度缺 口	48,183,529.56	-	564,000.00	-	-	629,315,634.47	678,063,164.03

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	-	218,941,030.41	-	218,941,030.41
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	-	1,548,314.19	-	1,548,314.19
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	220,489,344.60	-	220,489,344.60
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	-	220,489,344.60	-	220,489,344.60
	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	-	246,439,693.66	-	246,439,693.66
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	-	44,679.11	-	44,679.11
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-

资产合计	-	246,484,372.77	-	246,484,372.77
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	-	246,484,372.77	-	246,484,372.77

#### 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	11,024,467.23	12,324,218.64

	币升值 5%		
	港币相对人民币贬值 5%	-11,024,467.23	-12,324,218.64

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	539,046,486.04	91.86	626,737,640.11	92.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	51,003.80	0.01	564,000.00	0.08
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	539,097,489.84	91.87	627,301,640.11	92.51

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中证沪港深 500 指数上涨	28,414,005.53	31,040,653.07

	5%		
	中证沪港深 500 指数下跌 5%	-28,414,005.53	-31,040,653.07

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	537,774,915.84
第二层次	1,215,012.28
第三层次	107,561.72
合计	539,097,489.84

###### 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	539,046,486.04	91.50
	其中：股票	539,046,486.04	91.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	51,003.80	0.01
	其中：债券	51,003.80	0.01
	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	45,889,935.89	7.79
8	其他各项资产	4,124,329.76	0.70
9	合计	589,111,755.49	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 218,941,030.41 元，占期末净值比例为 37.31%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,649,393.80	0.62
B	采矿业	8,132,521.00	1.39



C	制造业	193,231,025.98	32.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,558,892.00	1.29
E	建筑业	5,628,813.00	0.96
F	批发和零售业	1,334,175.40	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	8,036,129.00	1.37
H	住宿和餐饮业	415,140.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,067,846.04	1.72
J	金融业	63,161,195.52	10.76
K	房地产业	5,621,962.00	0.96
L	租赁和商务服务业	4,209,539.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	5,408,669.40	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	152,277.00	0.03
Q	卫生和社会工作	2,653,063.34	0.45
R	文化、体育和娱乐业	698,991.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	319,959,633.48	54.53

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	125,161.28	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,119.10	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,019.69	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,288.06	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,234.02	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	145,822.15	0.02
----	------------	------

### 7.2.3 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	5,665,522.58	0.97
15 原材料	2,645,153.99	0.45
20 工业	9,040,906.21	1.54
25 可选消费	37,371,733.71	6.37
30 日常消费	9,484,501.80	1.62
35 医疗保健	10,010,103.28	1.71
40 金融	70,242,173.63	11.97
45 信息技术	9,792,936.34	1.67
50 电信服务	40,076,597.93	6.83
55 公用事业	7,731,659.04	1.32
60 房地产	16,879,741.90	2.88
合计	218,941,030.41	37.31

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股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	104,100	31,550,558.88	5.38
2	600519	贵州茅台	8,800	17,996,000.00	3.07
3	00005	汇丰控股	315,200	13,922,561.62	2.37
4	01299	友邦保险	186,600	13,572,147.51	2.31
5	03690	美团一	76,600	12,721,566.99	2.17

		W			
6	601318	中国平安	154,600	7,218,274.00	1.23
6	02318	中国平安	115,500	5,269,616.64	0.90
7	300750	宁德时代	20,000	10,680,000.00	1.82
8	600036	招商银行	176,800	7,460,960.00	1.27
8	03968	招商银行	70,500	3,165,271.99	0.54
9	00939	建设银行	1,859,000	8,378,236.57	1.43
9	601939	建设银行	95,900	581,154.00	0.10
10	002594	比亚迪	12,900	4,302,021.00	0.73
10	01211	比亚迪股份	14,000	3,759,415.24	0.64
11	01398	工商银行	1,342,000	5,348,118.81	0.91
11	601398	工商银行	500,600	2,387,862.00	0.41
12	00388	香港交易所	19,700	6,503,035.80	1.11
13	601012	隆基绿能	86,731	5,778,886.53	0.98
14	000858	五粮液	27,599	5,573,066.07	0.95
15	03988	中国银行	1,295,000	3,466,384.39	0.59
15	601988	中国银行	300,900	980,934.00	0.17
16	00941	中国移动	95,000	3,980,909.45	0.68
16	600941	中国移动	6,600	399,300.00	0.07
17	000333	美的集团	70,100	4,233,339.00	0.72
18	601166	兴业银行	207,700	4,133,230.00	0.70
19	02269	药明生物	65,000	3,991,171.73	0.68
20	300059	东方财富	151,112	3,838,244.80	0.65

		富			
21	600900	长江电 力	162,400	3,754,688.00	0.64
22	600030	中信证 券	139,275	3,016,696.50	0.51
22	06030	中信证 券	41,475	622,126.35	0.11
23	603259	药明康 德	29,260	3,042,747.40	0.52
23	02359	药明康 德	6,200	554,077.60	0.09
24	601888	中国中 免	13,900	3,237,727.00	0.55
25	601328	交通银 行	392,200	1,953,156.00	0.33
25	03328	交通银 行	269,000	1,246,849.92	0.21
26	01810	小米集 团-W	270,800	3,158,825.57	0.54
27	01024	快手-W	38,900	2,907,526.27	0.50
28	600887	伊利股 份	73,000	2,843,350.00	0.48
29	00981	中芯国 际	92,500	1,438,130.26	0.25
29	688981	中芯国 际	27,600	1,246,692.00	0.21
30	601899	紫金矿 业	205,800	1,920,114.00	0.33
30	02899	紫金矿 业	90,000	739,653.83	0.13
31	600690	海尔智 家	54,200	1,488,332.00	0.25
31	06690	海尔智 家	44,600	1,108,009.82	0.19
32	601288	农业银 行	455,700	1,376,214.00	0.23
32	01288	农业银 行	475,000	1,202,397.14	0.20
33	000568	泸州老 窖	10,400	2,564,016.00	0.44
34	601088	中国神 华	47,100	1,568,430.00	0.27

34	01088	中国神 华	51,500	990,951.41	0.17
35	02331	李宁	41,000	2,549,064.83	0.43
36	02015	理想汽 车-W	19,200	2,510,564.18	0.43
37	000002	万 科 A	97,200	1,992,600.00	0.34
37	02202	万科企 业	29,300	494,125.36	0.08
38	002415	海康威 视	67,400	2,439,880.00	0.42
39	00883	中国海 洋石油	275,000	2,436,436.31	0.42
40	002475	立讯精 密	70,900	2,395,711.00	0.41
41	600276	恒瑞医 药	63,800	2,366,342.00	0.40
42	600438	通威股 份	38,700	2,316,582.00	0.39
43	000651	格力电 器	67,600	2,279,472.00	0.39
44	600809	山西汾 酒	6,820	2,215,136.00	0.38
45	600309	万华化 学	22,500	2,182,275.00	0.37
46	00016	新鸿基 地产	27,500	2,180,093.11	0.37
47	300760	迈瑞医 疗	6,800	2,129,760.00	0.36
48	000725	京东方 A	535,500	2,109,870.00	0.36
49	002714	牧原股 份	38,140	2,107,997.80	0.36
50	09633	农夫山 泉	54,200	2,088,125.97	0.36
51	000001	平安银 行	138,500	2,074,730.00	0.35
52	02628	中国人 寿	114,000	1,331,736.08	0.23
52	601628	中国人 寿	23,900	742,812.00	0.13
53	00669	创科实 业	29,000	2,029,921.74	0.35

54	002142	宁波银行	56,400	2,019,684.00	0.34
55	09868	小鹏汽车-W	18,600	2,010,585.90	0.34
56	00386	中国石油化工股份	396,000	1,195,453.00	0.20
56	600028	中国石化	191,000	779,280.00	0.13
57	00001	长和	42,000	1,905,448.84	0.32
58	002129	TCL 中环	32,300	1,902,147.00	0.32
59	002812	恩捷股份	7,500	1,878,375.00	0.32
60	000792	盐湖股份	62,000	1,857,520.00	0.32
61	601601	中国太保	48,900	1,150,617.00	0.20
61	02601	中国太保	43,000	705,309.40	0.12
62	002466	天齐锂业	14,700	1,834,560.00	0.31
63	01658	邮储银行	184,000	980,321.40	0.17
63	601658	邮储银行	155,300	837,067.00	0.14
64	600585	海螺水泥	34,300	1,210,104.00	0.21
64	00914	海螺水泥	20,500	596,067.43	0.10
65	603288	海天味业	19,896	1,797,802.56	0.31
66	600048	保利发展	102,700	1,793,142.00	0.31
67	00002	中电控股	32,000	1,781,531.81	0.30
68	00857	中国石油股份	326,000	1,042,681.86	0.18
68	601857	中国石油	138,600	734,580.00	0.13
69	01109	华润置地	56,000	1,752,797.42	0.30
70	300015	爱尔眼科	38,842	1,738,956.34	0.30

71	603799	华友钴业	18,150	1,735,503.00	0.30
72	300124	汇川技术	26,250	1,729,087.50	0.29
73	02388	中银香港	65,000	1,723,207.85	0.29
74	02020	安踏体育	20,800	1,714,758.57	0.29
75	002460	赣锋锂业	11,400	1,695,180.00	0.29
76	02319	蒙牛乳业	50,000	1,674,034.43	0.29
77	00027	银河娱乐	41,000	1,640,938.57	0.28
78	01113	长实集团	34,500	1,637,475.05	0.28
79	600031	三一重工	85,000	1,620,100.00	0.28
80	06160	百济神州	19,000	1,600,488.09	0.27
81	601668	中国建筑	299,400	1,592,808.00	0.27
82	300014	亿纬锂能	16,200	1,579,500.00	0.27
83	600436	片仔癀	4,400	1,569,612.00	0.27
84	002352	顺丰控股	27,900	1,557,099.00	0.27
85	002304	洋河股份	8,500	1,556,775.00	0.27
86	300498	温氏股份	72,400	1,541,396.00	0.26
87	600089	特变电工	54,200	1,484,538.00	0.25
88	002271	东方雨虹	28,750	1,479,762.50	0.25
89	300274	阳光电源	14,800	1,454,100.00	0.25
90	00688	中国海外发展	67,500	1,431,588.06	0.24
91	601816	京沪高铁	280,400	1,407,608.00	0.24
92	00175	吉利汽车	92,000	1,403,606.24	0.24

93	00011	恒生银行	11,700	1,385,792.64	0.24
94	600837	海通证券	137,800	1,351,818.00	0.23
95	600000	浦发银行	167,500	1,341,675.00	0.23
96	603986	兆易创新	9,380	1,333,929.80	0.23
97	02688	新奥能源	12,100	1,333,831.29	0.23
98	603501	韦尔股份	7,700	1,332,331.00	0.23
99	600016	民生银行	354,500	1,318,740.00	0.22
100	02333	长城汽车	47,500	655,631.41	0.11
100	601633	长城汽车	17,600	651,904.00	0.11
101	00291	华润啤酒	26,000	1,300,743.99	0.22
102	02382	舜宇光学科技	11,800	1,290,669.85	0.22
103	600406	国电南瑞	47,652	1,286,604.00	0.22
104	601919	中远海控	90,300	1,255,170.00	0.21
105	300122	智飞生物	11,300	1,254,413.00	0.21
106	00003	香港中华煤气	172,700	1,247,991.59	0.21
107	000625	长安汽车	71,136	1,232,075.52	0.21
108	00960	龙湖集团	38,000	1,204,022.00	0.21
109	600919	江苏银行	168,600	1,200,432.00	0.20
110	002709	天赐材料	19,300	1,197,758.00	0.20
111	601688	华泰证券	84,100	1,194,220.00	0.20
112	600104	上汽集团	66,800	1,189,708.00	0.20
113	002049	紫光国微	6,200	1,176,264.00	0.20



114	601225	陕西煤业	55,500	1,175,490.00	0.20
115	000063	中兴通讯	45,400	1,159,062.00	0.20
116	002241	歌尔股份	34,200	1,149,120.00	0.20
117	02313	申洲国际	13,900	1,129,872.75	0.19
118	300142	沃森生物	23,000	1,112,970.00	0.19
119	000661	长春高新	4,700	1,097,074.00	0.19
120	600111	北方稀土	31,100	1,093,476.00	0.19
121	002230	科大讯飞	26,400	1,088,208.00	0.19
122	002371	北方华创	3,800	1,053,056.00	0.18
123	002459	晶澳科技	13,240	1,044,636.00	0.18
124	06618	京东健康	19,800	1,042,211.50	0.18
125	688599	天合光能	15,800	1,030,950.00	0.18
126	00066	港铁公司	29,000	1,016,820.91	0.17
127	002179	中航光电	15,940	1,009,320.80	0.17
128	01093	石药集团	150,000	999,289.52	0.17
129	00006	电能实业	23,500	991,785.22	0.17
130	300450	先导智能	15,640	988,135.20	0.17
131	601211	国泰君安	64,400	978,880.00	0.17
132	002027	分众传媒	144,400	971,812.00	0.17
133	000338	潍柴动力	77,400	965,178.00	0.16
134	600660	福耀玻璃	23,000	961,630.00	0.16
135	601169	北京银行	211,400	959,756.00	0.16

136	000100	TCL 科技	200,200	958,958.00	0.16
137	06098	碧桂园服务	32,000	956,444.50	0.16
138	03800	协鑫科技	293,000	949,662.84	0.16
139	601229	上海银行	142,000	930,100.00	0.16
140	01997	九龙仓置业	29,000	927,539.07	0.16
141	601985	中国核电	134,700	924,042.00	0.16
142	600050	中国联通	265,400	918,284.00	0.16
143	00267	中信股份	134,000	911,033.91	0.16
144	601766	中国中车	173,700	903,240.00	0.15
145	600522	中天科技	39,100	903,210.00	0.15
146	600745	闻泰科技	10,600	902,166.00	0.15
147	601390	中国中铁	146,700	900,738.00	0.15
148	00881	中升控股	19,000	899,360.56	0.15
149	01821	ESR	48,600	881,119.36	0.15
150	00968	信义光能	84,000	870,651.84	0.15
151	300347	泰格医药	7,600	869,820.00	0.15
152	600893	航发动力	19,100	869,241.00	0.15
153	601669	中国电建	109,200	859,404.00	0.15
154	603659	璞泰来	9,780	825,432.00	0.14
155	601615	明阳智能	23,900	807,820.00	0.14
156	01928	金沙中国有限公司	49,600	794,054.18	0.14
157	000776	广发证券	42,200	789,140.00	0.13
158	300896	爱美客	1,300	780,013.00	0.13

159	600009	上海机场	13,700	776,790.00	0.13
160	600905	三峡能源	122,500	770,525.00	0.13
161	601009	南京银行	73,500	765,870.00	0.13
162	600019	宝钢股份	127,200	765,744.00	0.13
163	600999	招商证券	53,100	765,171.00	0.13
164	600010	包钢股份	325,600	765,160.00	0.13
165	600196	复星医药	17,300	762,757.00	0.13
166	600958	东方证券	74,524	760,890.04	0.13
167	02328	中国财险	108,000	753,661.84	0.13
168	01177	中国生物制药	175,000	743,801.50	0.13
169	002410	广联达	13,600	740,384.00	0.13
170	600570	恒生电子	16,700	727,118.00	0.12
171	000895	双汇发展	24,600	720,780.00	0.12
172	000733	振华科技	5,300	720,641.00	0.12
173	00288	万洲国际	138,500	717,769.52	0.12
174	00992	联想集团	114,000	714,613.87	0.12
175	00322	康师傅控股	62,000	712,612.72	0.12
176	601818	光大银行	236,100	710,661.00	0.12
177	00868	信义玻璃	44,000	708,165.74	0.12
178	002311	海大集团	11,800	708,118.00	0.12
179	002050	三花智控	25,500	700,740.00	0.12
180	00268	金蝶国际	44,000	692,361.82	0.12

181	01801	信达生物	23,000	686,461.01	0.12
182	300759	康龙化成	7,200	685,584.00	0.12
183	600760	中航沈飞	11,120	672,204.00	0.11
184	600346	恒力石化	30,100	669,424.00	0.11
185	300661	圣邦股份	3,675	668,923.50	0.11
186	002493	荣盛石化	43,290	666,233.10	0.11
187	002074	国轩高科	14,200	647,520.00	0.11
188	300782	卓胜微	4,736	639,360.00	0.11
189	300496	中科创达	4,900	639,352.00	0.11
190	600926	杭州银行	42,200	632,156.00	0.11
191	688012	中微公司	5,400	630,450.00	0.11
192	600460	士兰微	12,100	629,200.00	0.11
193	00788	中国铁塔	722,000	623,621.65	0.11
194	002340	格林美	68,400	622,440.00	0.11
195	600426	华鲁恒升	21,280	621,376.00	0.11
196	300316	晶盛机电	9,100	615,069.00	0.10
197	000799	酒鬼酒	3,300	613,173.00	0.10
198	000538	云南白药	10,120	611,146.80	0.10
199	001979	招商蛇口	45,200	607,036.00	0.10
200	002821	凯莱英	2,100	606,900.00	0.10
201	601989	中国重工	162,900	604,359.00	0.10
202	002001	新和成	26,400	602,184.00	0.10
203	000768	中航西飞	19,800	599,742.00	0.10
204	000596	古井贡酒	2,400	599,184.00	0.10

205	600176	中国巨石	34,336	597,789.76	0.10
206	02007	碧桂园	143,000	594,339.95	0.10
207	00083	信和置业	60,000	594,186.01	0.10
208	002920	德赛西威	4,000	592,000.00	0.10
209	01929	周大福	46,600	588,213.37	0.10
210	00004	九龙仓集团	24,000	587,002.42	0.10
211	002202	金风科技	39,600	586,080.00	0.10
212	06969	思摩尔国际	28,000	579,476.74	0.10
213	603993	洛阳钼业	101,000	578,730.00	0.10
214	00012	恒基地产	23,000	578,279.48	0.10
215	00017	新世界发展	24,000	577,766.36	0.10
216	600763	通策医疗	3,300	575,652.00	0.10
217	601006	大秦铁路	85,000	560,150.00	0.10
218	000963	华东医药	12,400	559,984.00	0.10
219	601138	工业富联	56,600	556,944.00	0.09
220	300012	华测检测	23,800	552,398.00	0.09
221	000166	申万宏源	128,700	552,123.00	0.09
222	600584	长电科技	20,400	550,800.00	0.09
223	601877	正泰电器	15,300	547,434.00	0.09
224	300207	欣旺达	17,200	543,520.00	0.09
225	600600	青岛啤酒	5,200	540,384.00	0.09
226	06186	中国飞鹤	70,000	539,966.97	0.09
227	601377	兴业证券	76,400	538,620.00	0.09

228	601066	中信建投	18,600	537,726.00	0.09
229	01876	百威亚太	26,500	532,569.57	0.09
230	601600	中国铝业	112,100	532,475.00	0.09
231	688111	金山办公	2,700	532,224.00	0.09
232	00151	中国旺旺	91,000	530,748.02	0.09
233	600588	用友网络	24,400	529,724.00	0.09
234	600029	南方航空	72,200	527,782.00	0.09
235	600383	金地集团	38,800	521,472.00	0.09
236	600741	华域汽车	22,600	519,800.00	0.09
237	601186	中国铁建	65,700	519,030.00	0.09
238	03323	中国建材	72,000	515,987.44	0.09
239	600188	兖矿能源	13,000	513,240.00	0.09
240	600132	重庆啤酒	3,500	513,100.00	0.09
241	600085	同仁堂	9,700	512,936.00	0.09
242	601838	成都银行	30,900	512,322.00	0.09
243	603806	福斯特	7,768	508,959.36	0.09
244	002180	纳思达	10,000	506,200.00	0.09
245	688005	容百科技	3,900	504,816.00	0.09
246	000786	北新建材	14,400	498,528.00	0.08
247	601111	中国国航	42,600	494,586.00	0.08
248	300408	三环集团	16,400	493,640.00	0.08
249	01038	长江基建集团	12,000	493,615.67	0.08
250	601117	中国化学	52,400	493,084.00	0.08

251	000876	新希望	32,200	492,660.00	0.08
252	600885	宏发股份	11,760	492,156.00	0.08
253	300751	迈为股份	1,000	490,900.00	0.08
254	01548	金斯瑞生物科技	20,000	486,603.11	0.08
255	603019	中科曙光	16,700	484,634.00	0.08
256	00998	中信银行	161,000	483,276.42	0.08
257	600150	中国船舶	25,400	482,092.00	0.08
258	601238	广汽集团	31,500	480,060.00	0.08
259	600547	山东黄金	25,700	476,992.00	0.08
260	003816	中国广核	168,400	471,520.00	0.08
261	601100	恒立液压	7,600	469,072.00	0.08
262	300763	锦浪科技	2,200	468,600.00	0.08
263	601800	中国交建	50,400	467,712.00	0.08
264	600989	宝丰能源	31,400	460,010.00	0.08
265	600884	杉杉股份	15,400	457,688.00	0.08
266	600015	华夏银行	87,700	456,917.00	0.08
267	688396	华润微	7,700	454,839.00	0.08
268	300999	金龙鱼	8,400	453,768.00	0.08
269	03888	金山软件	17,200	450,103.60	0.08
270	002384	东山精密	19,600	449,428.00	0.08
271	603369	今世缘	8,800	448,800.00	0.08
272	000723	美锦能源	36,700	447,740.00	0.08
273	01193	华润燃	14,300	446,977.88	0.08

		气			
274	02618	京东物流	30,500	446,546.01	0.08
275	600886	国投电力	42,500	446,250.00	0.08
276	00101	恒隆地产	35,000	445,382.95	0.08
277	002648	卫星化学	17,170	443,844.50	0.08
278	600011	华能国际	62,800	442,112.00	0.08
279	603185	上机数控	2,820	439,891.80	0.07
280	601868	中国能建	185,100	438,687.00	0.07
281	601788	光大证券	27,800	438,128.00	0.07
282	601689	拓普集团	6,400	437,952.00	0.07
283	000157	中联重科	71,000	437,360.00	0.07
284	300601	康泰生物	9,520	430,113.60	0.07
285	000301	东方盛虹	25,400	429,514.00	0.07
286	600115	中国东航	78,200	429,318.00	0.07
287	09992	泡泡玛特	13,200	427,834.45	0.07
288	01378	中国宏桥	56,000	424,789.98	0.07
289	300595	欧普康视	7,400	423,206.00	0.07
290	000425	徐工机械	78,300	422,037.00	0.07
291	002236	大华股份	25,500	418,710.00	0.07
292	00586	海螺创业	28,500	416,776.85	0.07
293	00836	华润电力	30,000	415,622.34	0.07
294	600754	锦江酒店	6,600	415,140.00	0.07



295	002601	龙佰集团	20,500	411,025.00	0.07
296	06862	海底捞	26,000	406,899.40	0.07
297	603833	欧派家居	2,700	406,836.00	0.07
298	002555	三七互娱	19,100	405,493.00	0.07
299	603816	顾家家居	7,150	404,904.50	0.07
300	300628	亿联网络	5,300	403,595.00	0.07
301	603486	科沃斯	3,300	402,237.00	0.07
302	600233	圆通速递	19,700	401,683.00	0.07
303	688008	澜起科技	6,600	399,828.00	0.07
304	603392	万泰生物	2,571	399,276.30	0.07
305	01308	海丰国际	21,000	398,689.58	0.07
306	000938	紫光股份	20,500	397,700.00	0.07
307	605358	立昂微	5,900	397,542.00	0.07
308	00241	阿里健康	86,000	397,150.24	0.07
309	601555	东吴证券	57,090	395,633.70	0.07
310	002008	大族激光	11,900	394,247.00	0.07
311	601901	方正证券	58,700	393,877.00	0.07
312	002736	国信证券	41,100	393,327.00	0.07
313	603290	斯达半导	1,000	385,900.00	0.07
314	000977	浪潮信息	14,500	383,960.00	0.07
315	601233	桐昆股份	24,000	381,120.00	0.06
316	601336	新华保险	11,800	379,842.00	0.06
317	000069	华侨城 A	58,500	379,665.00	0.06

318	600219	南山铝业	102,500	378,225.00	0.06
319	688180	君实生物	5,000	376,700.00	0.06
320	00135	昆仑能源	68,000	373,923.28	0.06
321	300454	深信服	3,600	373,608.00	0.06
322	688169	石头科技	600	370,020.00	0.06
323	002385	大北农	47,300	369,413.00	0.06
324	300363	博腾股份	4,700	366,553.00	0.06
325	603260	合盛硅业	3,100	365,676.00	0.06
326	601108	财通证券	46,370	364,931.90	0.06
327	601995	中金公司	8,200	364,818.00	0.06
328	688099	晶晨股份	3,600	363,600.00	0.06
329	688126	沪硅产业	15,800	363,084.00	0.06
330	01044	恒安国际	11,500	362,408.14	0.06
331	002841	视源股份	4,800	361,536.00	0.06
332	600845	宝信软件	6,620	361,452.00	0.06
333	01209	华润万象生活	10,800	359,282.42	0.06
334	601799	星宇股份	2,100	359,100.00	0.06
335	601618	中国中冶	102,100	357,350.00	0.06
336	300529	健帆生物	7,000	356,230.00	0.06
337	600298	安琪酵母	7,300	355,875.00	0.06
338	00316	东方海外国际	2,000	355,759.04	0.06
339	002007	华兰生物	15,600	355,680.00	0.06
340	002120	韵达股	20,800	354,848.00	0.06

		份			
341	300413	芒果超媒	10,600	353,616.00	0.06
342	603345	安井食品	2,100	352,527.00	0.06
343	002013	中航机电	28,300	349,505.00	0.06
344	00384	中国燃气	33,600	348,260.73	0.06
345	601360	三六零	40,700	346,764.00	0.06
346	300144	宋城演艺	22,500	345,375.00	0.06
347	002252	上海莱士	57,600	341,568.00	0.06
348	00019	太古股份公司 A	8,500	339,831.13	0.06
349	603882	金域医学	4,100	338,455.00	0.06
350	688536	思瑞浦	600	336,954.00	0.06
351	300003	乐普医疗	18,100	336,117.00	0.06
352	300919	中伟股份	2,700	334,530.00	0.06
353	000703	恒逸石化	31,400	330,014.00	0.06
354	000783	长江证券	55,400	328,522.00	0.06
355	601155	新城控股	12,900	328,047.00	0.06
356	601077	渝农商行	88,300	326,710.00	0.06
357	01066	威高股份	41,600	324,452.24	0.06
358	601696	中银证券	23,700	315,210.00	0.05
359	601878	浙商证券	27,600	314,088.00	0.05
360	300146	汤臣倍健	14,500	313,925.00	0.05
361	300433	蓝思科技	28,300	313,281.00	0.05
362	600332	白云山	9,900	312,741.00	0.05

363	688036	传音控股	3,500	312,305.00	0.05
364	603517	绝味食品	5,400	312,228.00	0.05
365	002602	世纪华通	63,900	307,998.00	0.05
366	603589	口子窖	5,200	304,772.00	0.05
367	00762	中国联通	96,000	304,584.47	0.05
368	600918	中泰证券	39,800	304,470.00	0.05
369	603899	晨光股份	5,400	302,832.00	0.05
370	002185	华天科技	32,000	300,160.00	0.05
371	000066	中国长城	27,600	298,632.00	0.05
372	00270	粤海投资	42,000	298,119.23	0.05
373	300033	同花顺	3,100	298,065.00	0.05
374	600674	川投能源	25,000	298,000.00	0.05
375	300223	北京君正	2,800	297,500.00	0.05
376	01972	太古地产	17,800	296,532.00	0.05
377	601727	上海电气	72,100	296,331.00	0.05
378	00285	比亚迪电子	14,000	296,323.34	0.05
379	002938	鹏鼎控股	9,800	296,058.00	0.05
380	601636	旗滨集团	23,100	294,525.00	0.05
381	000708	中信特钢	14,400	290,160.00	0.05
382	601728	中国电信	77,600	289,448.00	0.05
383	601607	上海医药	15,900	287,472.00	0.05
384	600109	国金证券	31,900	287,100.00	0.05
385	603737	三棵树	2,200	284,746.00	0.05

386	601865	福莱特	7,400	281,940.00	0.05
387	002916	深南电 路	3,000	281,130.00	0.05
388	600183	生益科 技	16,500	280,335.00	0.05
389	002624	完美世 界	19,500	280,215.00	0.05
390	603939	益丰药 房	5,260	277,885.80	0.05
391	00144	招商局 港口	24,000	273,797.63	0.05
392	00853	微创医 疗	14,000	272,378.02	0.05
393	600018	上港集 团	46,500	271,095.00	0.05
394	601898	中煤能 源	26,000	269,880.00	0.05
395	600705	中航产 融	76,400	264,344.00	0.05
396	600362	江西铜 业	14,800	263,884.00	0.04
397	601990	南京证 券	31,600	263,544.00	0.04
398	002080	中材科 技	9,500	261,250.00	0.04
399	300957	贝泰妮	1,200	261,036.00	0.04
400	00772	阅文集 团	8,000	259,293.61	0.04
401	600779	水井坊	2,800	259,112.00	0.04
402	300676	华大基 因	3,600	258,120.00	0.04
403	002673	西部证 券	38,400	251,136.00	0.04
404	002508	老板电 器	6,900	248,607.00	0.04
405	002791	坚朗五 金	1,900	246,468.00	0.04
406	00884	旭辉控 股集团	72,904	245,646.28	0.04
407	00656	复星国 际	39,500	244,905.04	0.04
408	03692	翰森制 药	18,000	243,831.77	0.04

409	600143	金发科技	25,600	243,712.00	0.04
410	002414	高德红外	18,824	242,264.88	0.04
411	01691	J S 环球生活	27,500	240,351.15	0.04
412	06110	滔搏	39,000	237,802.68	0.04
413	600161	天坛生物	9,700	235,516.00	0.04
414	601216	君正集团	48,200	235,216.00	0.04
415	000728	国元证券	37,500	233,250.00	0.04
416	002568	百润股份	7,700	231,308.00	0.04
417	601319	中国人保	45,600	230,736.00	0.04
418	000408	藏格矿业	6,900	227,286.00	0.04
419	600803	新奥股份	12,100	224,939.00	0.04
420	600079	人福医药	14,000	224,000.00	0.04
421	01999	敏华控股	30,800	223,361.94	0.04
422	688185	康希诺	1,100	218,988.00	0.04
423	300558	贝达药业	3,600	218,880.00	0.04
424	603893	瑞芯微	2,400	218,256.00	0.04
425	600372	中航电子	10,900	211,351.00	0.04
426	601966	玲珑轮胎	8,300	210,571.00	0.04
427	603233	大参林	6,672	208,833.60	0.04
428	300832	新产业	4,600	207,506.00	0.04
429	00754	合生创展集团	20,240	207,362.37	0.04
430	601198	东兴证券	23,200	206,480.00	0.04
431	00909	明源云	19,000	204,082.54	0.03
432	300677	英科医疗	8,040	203,894.40	0.03
433	002600	领益智	40,200	201,804.00	0.03

		造			
434	688363	华熙生物	1,400	199,052.00	0.03
435	01313	华润水泥控股	44,000	198,301.46	0.03
436	600038	中直股份	4,300	194,360.00	0.03
437	01579	颐海国际	8,000	193,615.02	0.03
438	003022	联泓新科	5,800	192,734.00	0.03
439	600369	西南证券	47,400	188,178.00	0.03
440	01918	融创中国	48,000	188,004.97	0.03
441	02588	中银航空租赁	3,300	186,119.28	0.03
442	00966	中国太平	22,000	182,121.26	0.03
443	002064	华峰化学	21,400	180,616.00	0.03
444	600025	华能水电	25,600	178,944.00	0.03
445	601881	中国银河	18,500	178,895.00	0.03
446	02018	瑞声科技	11,500	177,614.41	0.03
447	000050	深天马A	17,600	175,472.00	0.03
448	01833	平安好医生	8,800	174,971.87	0.03
449	02689	玖龙纸业	30,000	170,353.85	0.03
450	688187	时代电气	2,500	162,475.00	0.03
451	300866	安克创新	2,400	159,168.00	0.03
452	603087	甘李药业	3,300	158,301.00	0.03
453	06993	蓝月亮集团	27,500	157,568.76	0.03
454	603707	健友股份	5,470	154,254.00	0.03

455	002607	中公教育	26,300	152,277.00	0.03
456	000987	越秀金控	21,486	151,046.58	0.03
457	00293	国泰航空	20,000	146,921.64	0.03
458	002153	石基信息	8,892	141,116.04	0.02
459	06666	恒大物业	70,000	137,685.59	0.02
460	002032	苏泊尔	2,400	135,216.00	0.02
461	002939	长城证券	13,200	134,112.00	0.02
462	601231	环旭电子	9,300	133,548.00	0.02
463	300888	稳健医疗	1,900	126,350.00	0.02
464	000800	一汽解放	13,200	123,288.00	0.02
465	601808	中海油服	8,300	115,785.00	0.02
466	01128	永利澳门	24,400	111,219.17	0.02
467	06699	时代天使	800	107,548.69	0.02
468	000877	天山股份	8,500	104,550.00	0.02
469	605499	东鹏饮料	600	102,516.00	0.02
470	300979	华利集团	1,400	102,312.00	0.02
471	06808	高鑫零售	43,500	94,861.95	0.02
472	00813	世茂集团	23,500	88,828.59	0.02
473	601825	沪农商行	13,700	85,899.00	0.01
474	01516	融创服务	19,000	77,505.87	0.01
475	03380	龙光集团	27,000	50,336.48	0.01
476	001289	龙源电力	2,200	47,872.00	0.01



477	03333	中国恒大	33,000	46,565.10	0.01
-----	-------	------	--------	-----------	------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	01114	BRILLIANCE CHI	100,000	624,288.70	0.11
2	601089	福元医药	1,279	26,922.95	0.00
3	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
4	688163	赛伦生物	802	18,895.12	0.00
5	301200	大族数控	229	11,889.68	0.00
6	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
7	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
8	301207	华兰疫苗	126	7,108.92	0.00
9	301263	泰恩康	195	6,119.10	0.00
10	301187	欧圣电气	234	5,274.36	0.00
11	301212	联盛化学	139	4,625.92	0.00
12	301162	国能日新	84	4,545.24	0.00
13	301103	何氏眼科	101	3,234.02	0.00
14	301268	铭利达	92	3,208.04	0.00
15	301109	军信股份	184	2,969.76	0.00
16	301135	瑞德智能	106	2,783.56	0.00
17	301148	嘉戎技术	97	2,318.30	0.00
18	301110	青木股份	37	1,474.45	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	000792	盐湖股份	2,015,064.00	0.30
2	02015	理想汽车—W	1,952,646.74	0.29
3	09868	小鹏汽车—W	1,699,463.58	0.25
4	002466	天齐锂业	1,632,697.03	0.24

5	00700	腾讯控股	1,400,980.02	0.21
6	01024	快手—W	1,046,197.00	0.15
7	03800	协鑫科技	811,291.92	0.12
8	000733	振华科技	661,881.00	0.10
9	601615	明阳智能	639,724.00	0.09
10	300750	宁德时代	575,332.00	0.08
11	02359	药明康德	564,758.36	0.08
12	002340	格林美	558,888.00	0.08
13	06160	百济神州	537,223.46	0.08
14	300012	华测检测	535,668.00	0.08
15	600941	中国移动	434,520.00	0.06
15	00941	中国移动	87,828.48	0.01
16	600085	同仁堂	466,100.00	0.07
17	600885	宏发股份	452,244.00	0.07
18	01548	金斯瑞生物 科技	446,950.48	0.07
19	000723	美锦能源	446,854.00	0.07
20	688005	容百科技	409,019.40	0.06

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	03690	美团—W	4,927,018.24	0.73
2	00700	腾讯控股	4,534,807.86	0.67
3	300750	宁德时代	1,914,429.76	0.28
4	00005	汇丰控股	1,753,612.17	0.26
5	01299	友邦保险	1,486,549.38	0.22
6	00939	建设银行	999,924.67	0.15
6	601939	建设银行	19,668.00	0.00
7	09618	京东集团— S W	930,943.35	0.14
8	000858	五 粮 液	843,137.08	0.12
9	002594	比亚迪	584,856.00	0.09
9	01211	比亚迪股份	238,629.52	0.04
10	02318	中国平安	599,317.60	0.09
10	601318	中国平安	221,500.00	0.03
11	00388	香港交易所	700,855.88	0.10
12	01398	工商银行	583,702.98	0.09
12	601398	工商银行	77,356.00	0.01

13	000333	美的集团	643,583.00	0.09
14	03968	招商银行	432,212.90	0.06
14	600036	招商银行	159,480.00	0.02
15	02269	药明生物	535,467.54	0.08
16	002812	恩捷股份	468,094.00	0.07
17	300059	东方财富	459,873.00	0.07
18	688707	振华新材	448,804.58	0.07
19	00941	中国移动	438,275.51	0.06
20	000568	泸州老窖	419,732.00	0.06

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	39,798,373.84
卖出股票收入（成交）总额	63,575,934.31

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	51,003.80	0.01
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	51,003.80	0.01

#### 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	113060	浙 22 转	510	51,003.80	0.01

		债			
--	--	---	--	--	--

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以降低交易成本,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数。

### 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中,浙商证券股份有限公司、腾讯控股有限公司、美团、招商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,576,015.57
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,548,314.19
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	4,124,329.76

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	01114	BRILLIANCE CHI	624,288.70	0.11	重大事项停牌
2	301201	诚达药业	25,253.62	0.00	新股流通受限
3	688163	赛伦生物	18,895.12	0.00	新股流通受限
4	301200	大族数控	11,889.68	0.00	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		中国工商银行股份有限公司—汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

			比例 (%)		比例 (%)		比例 (%)
20,250	35,415.60	33,984,924.00	4.74	683,181,076.00	95.26	6,985,100.00	0.97

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例 （%）
1	中信建投证券股份有限公司	6,423,200.00	0.90
2	招商证券股份有限公司	4,538,495.00	0.63
3	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	3,603,900.00	0.50
4	国信证券股份有限公司	3,484,300.00	0.49
5	刘贞峰	3,160,000.00	0.44
6	朴昌建	3,000,000.00	0.42
7	李静	3,000,000.00	0.42
8	中信证券股份有限公司	2,283,629.00	0.32
9	潘卉	2,256,900.00	0.31
10	伊晓晨	2,140,700.00	0.30
11	中国工商银行股份有限公司—汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	6,985,100.00	0.97

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 02 月 01 日）基金份额总额	1,089,166,000.00
本报告期期初基金份额总额	777,166,000.00
本报告期基金总申购份额	16,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	76,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	717,166,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安	2	30,722,395.92	30.52	23,332.54	33.85	
华泰证券	2	18,398,584.33	18.28	5,823.10	8.45	
中银国际	1	17,917,587.78	17.80	12,924.19	18.75	
国金证券	2	14,510,883.32	14.41	11,600.78	16.83	
西南证券	1	12,289,325.71	12.21	9,752.84	14.15	
中金公司	2	4,426,446.55	4.40	3,564.30	5.17	
上海证券	1	584,943.89	0.58	544.78	0.79	
兴业证券	2	359,840.00	0.36	255.95	0.37	
华鑫证券	3	354,992.76	0.35	330.59	0.48	
银河证券	3	308,992.00	0.31	222.87	0.32	
中信建投	1	294,755.08	0.29	209.69	0.30	



证券						
北京高华	1	188,217.84	0.19	133.88	0.19	
申万宏源证券	1	82,311.40	0.08	58.54	0.08	
国信证券	2	81,439.48	0.08	58.67	0.09	
国都证券	1	59,944.42	0.06	55.82	0.08	
东方证券	4	39,071.57	0.04	30.10	0.04	
中金财富	1	24,567.58	0.02	22.88	0.03	
海通证券	2	20,401.24	0.02	14.51	0.02	
广发证券	1	810.00	0.00	0.58	0.00	
光大证券	1	-	-	-	-	
安信证券	2	-	-	-	-	
财信证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
东吴证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
方正证券	1	-	-	-	-	
华融证券	2	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
中泰证券	2	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	

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 (%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	26,043.90	2.22	-	-	-	-	-	-
中银国际	147,728.00	12.59	-	-	-	-	-	-
国金证券	17,315.83	1.48	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	135,216.30	11.52	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	19,233.60	1.64	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国都 证券	624,176.20	53.20	-	-	-	-	-	-
东方 证券	90,955.10	7.75	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	112,576.50	9.60	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 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 1 家证券公司的 2 个交易单元:华鑫证券(上交所单元,深交所单元);不再租用 1 家证券公司的 1 个交易单元:中信证券华南(深交所单元)。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
3	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报,上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 25 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加开源证券为申购赎回代理券商的公告	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 03 月 08 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金公司为申购赎回代理券商的公告	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 03 月 22 日

6	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 29 日
7	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
8	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 01 日
9	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 13 日
10	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	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 26 日
12	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 05 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下的上海证券交易所 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 20 日
14	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 21 日
15	关于汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金非港股通交易日暂停申购、赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 29 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数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、报告期内汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2022 年 08 月 31 日