

汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 净资产（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	23
§ 7 投资组合报告	62
7.1 期末基金资产组合情况	62
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	63
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
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	75
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	75
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	76
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	76

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	76
7.12 投资组合报告附注.....	76
§ 8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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.....	78
§ 9 开放式基金份额变动	78
§ 10 重大事件揭示	78
10.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
10.4 基金投资策略的改变.....	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
10.8 其他重大事件.....	82
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
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.....	83
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§ 12 备查文件目录	83
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点	84
12.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富沪深 300 指数增强	
基金主代码	005530	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 03 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	290,782,576.48	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005530	010556
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	283,344,199.69	7,438,376.79

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以沪深 300 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力求实现超越标的指数的业绩表现和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 * 95% + 活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	李申
	联系电话	021-28932888	021-60637102
	电子邮箱	service@99fund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-9918	021-60637111
传真		021-28932998	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200010	100033
法定代表人		李文	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日 - 2022 年 06 月 30 日)	
	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	-26,412,080.44	-754,223.61
本期利润	-12,189,992.11	-393,156.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0470	-0.0549

本期加权平均净值利润率	-3.07%	-3.60%
本期基金份额净值增长率	-4.95%	-5.14%
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	133,316,696.80	4,595,947.26
期末可供分配基金份额利润	0.4705	0.6179
期末基金资产净值	461,316,960.05	12,034,324.05
期末基金份额净值	1.6281	1.6179
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	3.35%	1.52%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富沪深 300 指数增强 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.93%	0.98%	9.12%	1.02%	0.81%	-0.04%
过去三个月	7.47%	1.35%	5.93%	1.36%	1.54%	-0.01%
过去六个月	-4.95%	1.35%	-8.72%	1.38%	3.77%	-0.03%
过去一年	-10.51%	1.19%	-13.40%	1.18%	2.89%	0.01%
自基金	3.35%	1.19%	-4.58%	1.18%	7.93%	0.01%

合同生效日起至今						
汇添富沪深 300 指数增强 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.90%	0.98%	9.12%	1.02%	0.78%	-0.04%
过去三个月	7.37%	1.35%	5.93%	1.36%	1.44%	-0.01%
过去六个月	-5.14%	1.35%	-8.72%	1.38%	3.58%	-0.03%
过去一年	-10.86%	1.19%	-13.40%	1.18%	2.54%	0.01%
自基金合同生效日起至今	1.52%	1.19%	-5.66%	1.18%	7.18%	0.01%

3.2.2 自基金转型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

汇添富沪深300指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



- 注：1、本基金由原汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金于 2020 年 11 月 03 日转型而来。
- 2、本基金建仓期为《基金合同》生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。
- 3、本基金 C 类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本金为 132,724,224 元人民币。公司总部设立于上海，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		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2018 年 03 月 23 日		16	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放

					式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券
--	--	--	--	--	---

					投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证
--	--	--	--	--	---

					券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日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 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通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 1 月 27 日至今任汇添富中证智能汽车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沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
许一尊	本基金的基金经理	2018 年 03 月 23 日		12	国籍：中国。学历：上海财经大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部高级分析师。2015 年 11 月 24 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 2 日至今任汇添富中证芯片产业指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月 8 日至今任汇添富中证细分化工产业主题指数增强型发起式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

回顾上半年，国内新冠疫情反复，对制造业生产和居民消费造成一些影响，房地产等部分传统经济仍不景气。市场经历了一季度的下跌后，4 月下旬，A 股宽基指数的 PE、PB 等估值指标进入历史底部区域，5、6 月份，随着疫情逐步得到控制，稳增长政策发力，银行信贷投放改善，流动性环境趋向宽松，同时国内经济保持韧性，出口持续超预期，在估值修复和基本面因素改善的共同推动下，市场出现较显著的反弹。

海外方面，地区冲突对全球供应链造成剧烈冲击，能源、资源、农产品价格整体上涨，抬升通胀预期。美联储加息落地，对全球金融市场流动性和资金流向形成一定影响，成长风格回调明显。海外经济压力逐步显现，通胀持续超预期，市场开始交易衰退预期。

风格方面，一季度小盘价值风格表现较好；4 月份市场情绪相对悲观，安全性高的大盘价值风格表现最佳；随着市场企稳和投资者风险偏好提升，5、6 月份，成长风格，尤其是前期调整充分，基本面稳健的大盘成长开始有出色表现。行业方面，一季度煤炭、房地产、建筑领衔的周期板块涨幅居前，二季度在市场反弹过程中，前期调整充分、受益于政策扶持、叠加行业高景气的汽车、新能源板块，受益于疫情后修复的消费板块整体表现出色。

量化选股因子方面，一季度估值类因子表现出色，盈利、质量、成长等基本面因子整体相对一般。二季度投资者风险偏好提升，估值类及质量类因子发生了不同程度的波动和回撤；投资者追求长期相对确定的成长，追求基本面和估值的匹配度，盈利、成长等基本面因子以及相对估值类指标表现较好。上半年市场交易整体仍较为活跃，反转、低波动、流动性等传统市场面因子以及创新类市场面因子均有较好表现。

报告期内，本基金遵循指数增强基金的投资原则，相对业绩比较基准保持了相对均衡的行业配置和风格配置，在预期、成长、盈利、质量、估值、市场面等各类选股因子上保持了相对均衡的暴露，跟踪误差得到了较为有效的控制。团队在新因子开发、因子配置模型上持续努力，一些创新类因子整体表现出色，对超额收益有所贡献。缺点在于对市场风格的边际变化反应不及时，对因子、模型、策略的迭代更新不够积极，影响了超额收益的进一步获取。未来我们将不断推进对量化选股模型的迭代优化，提升组合精细化管理和对市场风格变动的适应能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富沪深 300 指数增强 A 类份额净值增长率为-4.95%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%。本报告期汇添富沪深 300 指数增强 C 类份额净值增长率为-5.14%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%。

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，积极因素在逐步显现，有利因素包括：国内经济保持韧性，疫情对经济的影响持续减弱；不断强化的稳增长政策以及丰富的政策储备；A 股的整体估值水平合理，和其他市场相比处于相对较低的位置。不利因素包括海外经济衰退、高通胀以及地区冲突增加了外部宏观环境的不确定性；赚钱效应减弱可能降低投资者的风险偏好。

风格角度，大市值公司抗风险能力更强，基本面更为稳健；可能的流动性宽松相对利好成长风格，尤其是一些基本面稳健、估值匹配度好、安全性高的稳健成长类标的。小市值公司也可能受益于信用宽松，同时市场风险偏好和交易活跃度的提升有利于超额收益的获取，带来较好的投资机会。行业角度，高景气的新能源、半导体、军工板块，估值合理、受益于疫情后修复的消费板块，可能受益于稳增长政策的周期板块都可能存在投资机会，但从预期到财报验证仍需要时间，行业间的波动可能加大，从跟踪误差控制角度有必要对行业偏离进行控制。选股模型角度，下半年市场可能仍缺乏鲜明的投资主线，相对有利于信息覆盖面广、反应速度快的量化类策略获取超额收益。

汇添富沪深 300 指数增强使用量化选股模型挑选个股，同时保持风格和行业的相对均衡，具有较鲜明的大盘风格。未来我们将进一步加大量化模型的研究深度，扩展新技术、新数据在量化投资中的应用，提高信息的发掘和利用效率，提升风险管理和组合精细化管理能力。汇添富沪深 300 指数增强基金将继续严格遵守基金合同，追求相对业绩比较基准的较为稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部、风险管理及合规稽核人员、基金经理等组成了估值委员会，负责

研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	33,945,862.93	24,636,999.36
结算备付金		1,836,426.96	1,237,713.87
存出保证金		108,461.90	73,769.02
交易性金融资产	6.4.7.2	439,754,980.23	386,005,707.12
其中：股票投资		439,677,865.70	383,603,857.12
基金投资		-	-
债券投资		77,114.53	2,401,850.00
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		11,089,499.55	2,555,557.79
应收股利		-	-
应收申购款		735,822.99	237,053.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	25,648.95
资产总计		487,471,054.56	414,772,450.07
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		11,952,991.27	2,355,666.20
应付赎回款		576,929.46	100,952.02
应付管理人报酬		299,082.14	272,685.76
应付托管费		74,770.51	68,171.45
应付销售服务费		3,863.55	3,772.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.90	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,212,131.63	770,196.65
负债合计		14,119,770.46	3,571,444.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	290,782,576.48	240,097,259.73
未分配利润	6.4.7.9	182,568,707.62	171,103,746.21
净资产合计		473,351,284.10	411,201,005.94
负债和净资产总计		487,471,054.56	414,772,450.07

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 290,782,576.48 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.6281 元，基金份额总额 283,344,199.69 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.6179 元，基金份额总额 7,438,376.79 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：汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金

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		-10,343,092.58	19,895,626.95
1. 利息收入		62,714.79	66,211.45
其中：存款利息收入	6.4.7.10	62,714.79	58,804.66
债券利息收入		-	6,421.58
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	985.21
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-25,078,765.57	29,594,043.19
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-30,051,759.46	26,080,857.79
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	295,198.84	40,235.50
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	4,677,795.05	3,472,949.90
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	14,583,155.89	-9,969,888.07
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	89,802.31	205,260.38
减：二、营业总支出		2,240,055.58	4,411,172.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,618,999.43	1,653,245.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	404,749.83	413,311.31
3. 销售服务费		21,662.89	15,449.37
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		0.87	0.09
8. 其他费用	6.4.7.21	194,642.56	2,329,166.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,583,148.16	15,484,454.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,583,148.16	15,484,454.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-12,583,148.16	15,484,454.53

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：汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金

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)	240,097,259.73	171,103,746.21	411,201,005.94
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	240,097,259.73	171,103,746.21	411,201,005.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,685,316.75	11,464,961.41	62,150,278.16
（一）、综合收益总额	-	-12,583,148.16	-12,583,148.16
（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）	50,685,316.75	24,048,109.57	74,733,426.32
其中：1. 基金申购款	102,919,643.25	53,065,244.16	155,984,887.41
2. 基金赎回款	-52,234,326.50	-29,017,134.59	-81,251,461.09
（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)	290,782,576.48	182,568,707.62	473,351,284.10
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)	169,193,174.61	126,318,193.85	295,511,368.46
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	169,193,174.61	126,318,193.85	295,511,368.46
三、本期增减变	98,054,314.11	92,576,339.74	190,630,653.85

动额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	15,484,454.53	15,484,454.53
（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）	98,054,314.11	77,091,885.21	175,146,199.32
其中：1. 基金申购款	136,969,420.98	108,564,971.48	245,534,392.46
2. 基金赎回款	-38,915,106.87	-31,473,086.27	-70,388,193.14
（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）	267,247,488.72	218,894,533.59	486,142,022.31

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

汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)，是由汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金变更而来。原汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1062 号文《关于准予汇添富价值多因子量化策略股票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发行募集，基金合同于 2018 年 3 月 23 日生效。设立时募集规模为人民币 361,461,540.37 份基金份额。

根据《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，汇添富价值多因子量化策略股票型证

券投资基金基金份额持有人大会于 2020 年 11 月 2 日表决通过了《关于汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金转型的议案》。自 2020 年 11 月 3 日起,本基金名称变更为“汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金”。《汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 3 日起生效,原《汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金基金合同》于同一起失效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

自 2020 年 11 月 3 日起,本基金增设 C 类份额类别,原基金份额变更为 A 类基金份额,基金注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司。

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(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、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、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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。本基金为股票型指数增强基金,在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,进行积极的组合管理和风险控制,力求实现超越标的指数的业绩表现,谋求基金资产的长期增值。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(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 24,636,999.36 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,439.37 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 24,640,438.73 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 1,237,713.87 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 612.60 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 1,238,326.47 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 73,769.02 元,自应收利息转入的重分类金额为人民币 36.52 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 73,805.54 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 25,648.95 元,转出至银行存款的重分类金额为人民币 3,439.37 元,转出至结算备付金的重分类金额为人民币 612.60 元,转出至存出保证金的重分类金额为人民币 36.52 元,转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 21,560.46 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 386,005,707.12 元,自应收利息转入的重分类金额为人民币 21,560.46 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 386,027,267.58 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。

6.4.7 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	33,945,862.93

等于：本金	33,942,583.62
加：应计利息	3,279.31
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	33,945,862.93

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		419, 204, 982. 77	-	439, 677, 865. 70	20, 472, 882. 93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	77, 100. 00	14. 53	77, 114. 53	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	77, 100. 00	14. 53	77, 114. 53	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		419, 282, 082. 77	14. 53	439, 754, 980. 23	20, 472, 882. 93

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	219.45
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	997,609.62
其中：交易所市场	997,609.62
银行间市场	—
应付利息	—
应付审计费	104,795.19
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	50,000.00
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	1,212,131.63

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富沪深 300 指数增强 A		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	233,170,394.03	233,170,394.03
本期申购	98,033,420.38	98,033,420.38
本期赎回（以“-”	-47,859,614.72	-47,859,614.72

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	283,344,199.69	283,344,199.69
汇添富沪深 300 指数增强 C		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	6,926,865.70	6,926,865.70
本期申购	4,886,222.87	4,886,222.87
本期赎回 (以“-”号填列)	-4,374,711.78	-4,374,711.78
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	7,438,376.79	7,438,376.79

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富沪深 300 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	134,244,688.55	31,972,411.96	166,217,100.51
本期利润	-26,412,080.44	14,222,088.33	-12,189,992.11
本期基金份额交易产生的变动数	25,484,088.69	-1,538,436.73	23,945,651.96
其中：基金申购款	48,272,460.96	2,244,841.44	50,517,302.40
基金赎回款	-22,788,372.27	-3,783,278.17	-26,571,650.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,316,696.80	44,656,063.56	177,972,760.36

汇添富沪深 300 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,031,188.63	-144,542.93	4,886,645.70
本期利润	-754,223.61	361,067.56	-393,156.05
本期基金份额 额交易产生 的变动数	324,193.55	-221,735.94	102,457.61
其中：基金 申购款	3,185,249.43	-637,307.67	2,547,941.76
基金赎回款	-2,861,055.88	415,571.73	-2,445,484.15
本期已分配 利润	-	-	-
本期末	4,601,158.57	-5,211.31	4,595,947.26

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	50,267.88
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	11,694.52
其他	752.39
合计	62,714.79

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	1,063,460,676.87
减：卖出股票成本总额	1,090,670,972.27
减：交易费用	2,841,464.06
买卖股票差价收入	-30,051,759.46

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	3,389.43
债券投资收益——买卖债券差价收入	291,809.41
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	295,198.84

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	3,244,117.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,927,210.00
减：应计利息总额	24,942.53
减：交易费用	155.45
买卖债券差价收入	291,809.41

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	4,677,795.05
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	4,677,795.05

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	14,583,155.89
——股票投资	14,582,795.89
——债券投资	360.00
——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	14,583,155.89

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	89,802.31
替代损益	-
其他	-
合计	89,802.31

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	1,340.00
指数使用费	100,000.00
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	194,642.56

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
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	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	137,811,929.96	6.31	121,105,383.13	8.15

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 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	82,323.30	4.81	-	-

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	99,801.74	6.37	67,894.03	6.81
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	111,962.83	8.57	77,894.54	10.95

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	1,618,999.43	1,653,245.14
其中：支付销售机构的客户维护费	174,886.38	184,146.39

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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	404,749.83	413,311.31

注：托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	7,808.65	7,808.65
合计	-	7,808.65	7,808.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	6,108.24	6,108.24
合计	-	6,108.24	6,108.24

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 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
建设银行	33,945,862.93	50,267.88	29,959,627.31	49,615.08

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	证券名称	成功认购	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	225	12,503.25	6,756.75	
301103	何氏眼科	2022 年 03 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.71	32.02	382	12,495.00	12,231.64	
301109	军信股份	2022 年 04 月 06 日	6 个月	新股流通受限	23.19	16.14	791	18,344.87	12,766.74	
301110	青木股份	2022 年 03 月 04 日	6 个月	新股流通受限	63.10	39.85	176	11,105.60	7,013.60	
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	295	10,982.85	7,490.05	

		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	464	17,812.96	11,089.60	
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	54,792	209,305.44	209,305.44	
301175	中科环保	2022 年 06 月 30 日	6 个月	新股流通受限	3.82	3.82	6,088	23,256.16	23,256.16	
30118	标	202	6	新	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	

1	榜 股 份	2 年 02 月 11 日	个 月	股 流 通 受 限						
301187	欧 圣 电 气	2022 年 04 月 13 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	
301196	唯 科 科 技	2022 年 01 月 04 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	64.08	37.52	157	10,060.56	5,890.64	
301200	大 族 数 控	2022 年 02 月 18 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	76.56	51.92	217	16,613.52	11,266.64	
301201	诚 达 药 业	2022 年 01 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	72.69	71.54	247	17,954.43	17,670.38	
301207	华 兰 疫 苗	2022 年 02 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	56.88	56.42	163	9,271.44	9,196.46	
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 月	8 个 交	新 股 流	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	

	份	月 24 日	易 日	通 受 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	306	12,025.80	11,606.58	
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	4,741	159,534.65	159,534.65	
301239	普瑞眼科	2022年06月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	527	17,733.55	17,733.55	
301263	泰恩康	2022年03月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	655	13,054.15	20,553.90	
301268	铭利达	2022年03月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	444	12,654.00	15,482.28	
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	

		日		限						
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	
688046	药康生物	2022 年 04 月 14 日	6 个月	新股流通受限	22.53	26.24	11,005	247,942.65	288,771.20	
688048	长光华芯	2022 年 03 月 25 日	6 个月	新股流通受限	80.80	111.97	2,007	162,165.60	224,723.79	
688213	思特威	2022 年 05 月 13 日	6 个月	新股流通受限	31.51	49.01	12,838	404,525.38	629,190.38	
688237	超卓航科	2022 年 06 月 24 日	5 个交易日	新股流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	
688267	中触媒	2022 年 02 月 09 日	6 个月	新股流通受限	41.90	31.90	1,617	67,752.30	51,582.30	
688279	峰昭科技	2022 年 04 月 13 日	6 个月	新股流通受限	82.00	67.34	3,487	285,934.00	234,814.58	
68830	海	202	6	新	42.92	38.35	9,157	393,018.44	351,170.95	

2	创 药 业	2 年 04 月 01 日	个 月	股 流 通 受 限						
688349	三 一 重 能	2022 年 06 月 15 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	29.80	36.94	8,554	254,909.20	315,984.76	
688400	凌 云 光	2022 年 06 月 27 日	7 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	21.93	21.93	8,635	189,365.55	189,365.55	
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
127064	杭 氧 转 债	2022 年 05 月 19 日	3 2 个 交 易 日	新 债 流 通 受 限	100.00	100.02	771	77,100.00	77,114.53	
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 88 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 264 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 2 年 06 月 30 日	1 个月以内	1 - 3 个 月	3 个月-1 年	1 - 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	33,945,862.93	-	-	-	-	-	33,945,862.93
结 算 备 付 金	1,836,426.96	-	-	-	-	-	1,836,426.96
存 出 保 证 金	108,461.90	-	-	-	-	-	108,461.90
交 易 性 金 融 资 产	-	-	77,114.53	-	-	439,677,865.70	439,754,980.23
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
买 入	-	-	-	-	-	-	-

返售金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	11,089,499.55	11,089,499.55
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	735,822.99	735,822.99
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	35,890,751.79	-	77,114.53	-	-	451,503,188.24	487,471,054.56
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	-	-	-	-	-	11,952,991.27	11,952,991.27
应付赎回款	-	-	-	-	-	576,929.46	576,929.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	299,082.14	299,082.14
应付托管	-	-	-	-	-	74,770.51	74,770.51

费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,863.55	3,863.55
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1.90	1.90
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,212,131.63	1,212,131.63
负债总计	-	-	-	-	-	14,119,770.46	14,119,770.46
利率敏感度缺	35,890,751.79	-	77,114.53	-	-	437,383,417.78	473,351,284.10

口							
上 年 度 末 202 1 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	24,636,999.36	-	-	-	-	-	24,636,999.36
结 算 备 付 金	1,237,713.87	-	-	-	-	-	1,237,713.87
存 出 保 证 金	73,769.02	-	-	-	-	-	73,769.02
交 易 性 金 融 资 产	-	-	2,401,850.00	-	-	383,603,857.12	386,005,707.12
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
买 入 返 售	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,555,557.79	2,555,557.79
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	237,053.96	237,053.96
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	25,648.95	25,648.95
资产总计	25,948,482.25	-	2,401,850.00	-	-	386,422,117.82	414,772,450.07
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	-	-	-	-	-	2,355,666.20	2,355,666.20
应付赎回款	-	-	-	-	-	100,952.02	100,952.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	272,685.76	272,685.76
应付托管费	-	-	-	-	-	68,171.45	68,171.45
应	-	-	-	-	-	3,772.05	3,772.05

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	-	-	-	-	-	770,196.65	770,196.65
负 债 总 计	-	-	-	-	-	3,571,444.13	3,571,444.13
利 率 敏 感 度 缺 口	25,948,482.25	-	2,401,850.00	-	-	382,850,673.69	411,201,005.94

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	-	2,029.23
	基准利率增加 25 个基点	-	-2,023.77

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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	公允价值	占基金资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	439,677,865.70	92.89	383,603,857.12	93.29
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	77,114.53	0.02	2,401,850.00	0.58
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	439,754,980.23	92.90	386,005,707.12	93.87

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产及存托凭证占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股占非现金基金资产的比例不低于 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	22,187,625.27	19,933,916.89
	沪深 300 指数下跌 5%	-22,187,625.27	-19,933,916.89

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 06 月 30 日
第一层次	431,056,854.37
第二层次	1,078,394.43
第三层次	7,619,731.43
合计	439,754,980.23

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	439,677,865.70	90.20
	其中：股票	439,677,865.70	90.20
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	77,114.53	0.02
	其中：债券	77,114.53	0.02
	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	35,782,289.89	7.34
8	其他各项资产	11,933,784.44	2.45
9	合计	487,471,054.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,221,854.00	0.47
B	采矿业	8,178,342.00	1.73
C	制造业	233,738,883.85	49.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,051,565.00	0.43
E	建筑业	8,960,387.00	1.89
F	批发和零售业	687,232.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	7,880,125.00	1.66
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,313,869.38	3.66
J	金融业	70,345,032.40	14.86
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	11,076,182.88	2.34
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	-	-
Q	卫生和社会工作	2,187,575.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	364,641,048.51	77.03

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	60,500,134.82	12.78
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	27,352.55	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	2,337,570.00	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,480,114.66	0.74
J	金融业	5,093,949.00	1.08
K	房地产业	46,854.00	0.01
L	租赁和商务服务业	1,271,174.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	1,833,750.38	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	256,417.94	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	189,499.84	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	75,036,817.19	15.85

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	14,902	30,474,590.00	6.44
2	600887	伊利股份	322,800	12,573,060.00	2.66
3	601166	兴业银行	557,233	11,088,936.70	2.34
4	603259	药明康德	106,512	11,076,182.88	2.34
5	600438	通威股份	169,000	10,116,340.00	2.14
6	600809	山西汾酒	28,800	9,354,240.00	1.98
7	601668	中国建筑	1,584,700	8,430,604.00	1.78
8	002142	宁波银行	221,940	7,947,671.40	1.68
9	600089	特变电工	288,800	7,910,232.00	1.67
10	000858	五粮液	35,300	7,128,129.00	1.51
11	002812	恩捷股份	28,400	7,112,780.00	1.50
12	600919	江苏银行	993,990	7,077,208.80	1.50
13	300750	宁德时代	12,500	6,675,000.00	1.41
14	601688	华泰证券	468,400	6,651,280.00	1.41
15	002371	北方华创	22,200	6,152,064.00	1.30
16	002352	顺丰控股	104,300	5,820,983.00	1.23
17	600030	中信证券	268,125	5,807,587.50	1.23
18	600660	福耀玻璃	137,000	5,727,970.00	1.21
19	002129	TCL 中环	93,600	5,512,104.00	1.16
20	000333	美的集团	89,178	5,385,459.42	1.14
21	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	1.11

22	600036	招商银行	121,300	5,118,860.00	1.08
23	002466	天齐锂业	35,900	4,480,320.00	0.95
24	601211	国泰君安	279,000	4,240,800.00	0.90
25	002311	海大集团	69,600	4,176,696.00	0.88
26	601088	中国神华	123,100	4,099,230.00	0.87
27	600999	招商证券	281,900	4,062,179.00	0.86
28	600690	海尔智家	144,600	3,970,716.00	0.84
29	600426	华鲁恒升	130,910	3,822,572.00	0.81
30	002475	立讯精密	109,400	3,696,626.00	0.78
31	600176	中国巨石	211,600	3,683,956.00	0.78
32	300450	先导智能	57,900	3,658,122.00	0.77
33	000768	中航西飞	117,700	3,565,133.00	0.75
34	300316	晶盛机电	52,400	3,541,716.00	0.75
35	002410	广联达	63,100	3,435,164.00	0.73
36	600406	国电南瑞	123,240	3,327,480.00	0.70
37	002074	国轩高科	70,300	3,205,680.00	0.68
38	600760	中航沈飞	52,500	3,173,625.00	0.67
39	601877	正泰电器	87,300	3,123,594.00	0.66
40	300661	圣邦股份	17,100	3,112,542.00	0.66
41	300763	锦浪科技	14,100	3,003,300.00	0.63
42	600085	同仁堂	56,500	2,987,720.00	0.63
43	300408	三环集团	99,100	2,982,910.00	0.63
44	601318	中国平安	62,700	2,927,463.00	0.62

		安			
45	601838	成都银行	173,900	2,883,262.00	0.61
46	002001	新和成	120,920	2,758,185.20	0.58
47	603019	中科曙光	92,600	2,687,252.00	0.57
48	002648	卫星化学	103,699	2,680,619.15	0.57
49	600989	宝丰能源	182,800	2,678,020.00	0.57
50	002594	比亚迪	8,000	2,667,920.00	0.56
51	601328	交通银行	535,500	2,666,790.00	0.56
52	603806	福斯特	39,400	2,581,488.00	0.55
53	002008	大族激光	76,500	2,534,445.00	0.54
54	300014	亿纬锂能	25,900	2,525,250.00	0.53
55	600741	华域汽车	108,400	2,493,200.00	0.53
56	300628	亿联网络	30,800	2,345,420.00	0.50
57	002568	百润股份	77,200	2,319,088.00	0.49
58	601225	陕西煤业	109,400	2,317,092.00	0.49
59	002736	国信证券	241,900	2,314,983.00	0.49
60	601698	中国卫通	203,200	2,298,192.00	0.49
61	002414	高德红外	175,760	2,262,031.20	0.48
62	600183	生益科技	131,700	2,237,583.00	0.47
63	688396	华润微	37,700	2,226,939.00	0.47
64	002714	牧原股份	40,200	2,221,854.00	0.47
65	603195	公牛集团	14,500	2,217,195.00	0.47
66	603882	金域医学	26,500	2,187,575.00	0.46
67	600362	江西铜	122,000	2,175,260.00	0.46

		业			
68	002841	视源股份	28,500	2,146,620.00	0.45
69	002032	苏泊尔	37,800	2,129,652.00	0.45
70	600111	北方稀土	59,800	2,102,568.00	0.44
71	002120	韵达股份	120,700	2,059,142.00	0.44
72	601998	中信银行	432,000	2,052,000.00	0.43
73	600025	华能水电	293,500	2,051,565.00	0.43
74	601288	农业银行	671,600	2,028,232.00	0.43
75	688126	沪硅产业	87,900	2,019,942.00	0.43
76	600845	宝信软件	36,800	2,009,280.00	0.42
77	300760	迈瑞医疗	6,400	2,004,480.00	0.42
78	000895	双汇发展	62,900	1,842,970.00	0.39
79	300529	健帆生物	32,500	1,653,925.00	0.35
80	601658	邮储银行	299,600	1,614,844.00	0.34
81	600028	中国石化	377,900	1,541,832.00	0.33
82	600600	青岛啤酒	13,800	1,434,096.00	0.30
83	688008	澜起科技	23,300	1,411,514.00	0.30
84	002916	深南电路	14,700	1,377,537.00	0.29
85	002493	荣盛石化	87,100	1,340,469.00	0.28
86	603986	兆易创新	8,500	1,208,785.00	0.26
87	601238	广汽集团	78,200	1,191,768.00	0.25
88	000568	泸州老窖	3,900	961,506.00	0.20

89	601881	中国银河	92,400	893,508.00	0.19
90	601319	中国人保	174,200	881,452.00	0.19
91	601012	隆基绿能	10,500	699,615.00	0.15
92	600655	豫园股份	72,800	687,232.00	0.15
93	600050	中国联通	178,100	616,226.00	0.13
94	601117	中国化学	56,300	529,783.00	0.11
95	002555	三七互娱	17,100	363,033.00	0.08
96	601899	紫金矿业	23,600	220,188.00	0.05
97	688363	华熙生物	1,300	184,834.00	0.04
98	002460	赣锋锂业	1,000	148,700.00	0.03
99	300601	康泰生物	2,200	99,396.00	0.02
100	600918	中泰证券	11,500	87,975.00	0.02
101	000301	东方盛虹	3,100	52,421.00	0.01
102	603833	欧派家居	100	15,068.00	0.00
103	688005	容百科技	100	12,944.00	0.00
104	603288	海天味业	33	2,981.88	0.00

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	603713	密尔克卫	17,100	2,337,570.00	0.49
2	603456	九洲药	44,700	2,310,990.00	0.49

		业			
3	002597	金禾实 业	50,700	2,196,831.00	0.46
4	603613	国联股 份	23,800	2,108,680.00	0.45
5	603989	艾华集 团	73,600	2,075,520.00	0.44
6	600486	扬农化 工	15,500	2,065,840.00	0.44
7	002423	中粮资 本	307,800	2,065,338.00	0.44
8	002507	涪陵榨 菜	59,600	2,057,392.00	0.43
9	600867	通化东 宝	197,800	2,045,252.00	0.43
10	600456	宝钛股 份	34,100	2,025,540.00	0.43
11	601163	三角轮 胎	172,900	2,016,014.00	0.43
12	601882	海天精 工	97,700	2,013,597.00	0.43
13	300568	星源材 质	68,600	1,992,144.00	0.42
14	601231	环旭电 子	137,400	1,973,064.00	0.42
15	002677	浙江美 大	124,600	1,827,882.00	0.39
16	002035	华帝股 份	312,100	1,816,422.00	0.38
17	300453	三鑫医 疗	181,700	1,806,098.00	0.38
18	603589	口子窖	29,700	1,740,717.00	0.37
19	300429	强力新 材	180,200	1,710,098.00	0.36
20	002884	凌霄泵 业	82,800	1,696,572.00	0.36
21	300765	新诺威	116,800	1,666,736.00	0.35
22	600908	无锡银 行	294,900	1,660,287.00	0.35
23	000989	九 芝 堂	170,700	1,553,370.00	0.33
24	000869	张 裕 A	50,800	1,510,792.00	0.32

25	002180	纳思达	27,300	1,381,926.00	0.29
26	601128	常熟银行	179,100	1,368,324.00	0.29
27	002378	章源钨业	168,200	1,359,056.00	0.29
28	300470	中密控股	37,800	1,333,962.00	0.28
29	002332	仙琚制药	133,400	1,309,988.00	0.28
30	002344	海宁皮城	272,200	1,271,174.00	0.27
31	603236	移远通信	9,490	1,268,433.40	0.27
32	002672	东江环保	201,400	1,246,666.00	0.26
33	002832	比音勒芬	49,100	1,237,320.00	0.26
34	300699	光威复材	17,900	1,053,773.00	0.22
35	603203	快克股份	40,500	1,036,800.00	0.22
36	603337	杰克股份	42,300	908,604.00	0.19
37	600482	中国动力	57,300	900,183.00	0.19
38	002318	久立特材	52,400	837,876.00	0.18
39	600645	中源协和	42,800	833,316.00	0.18
40	603367	辰欣药业	67,900	805,294.00	0.17
41	600488	天药股份	173,500	746,050.00	0.16
42	603060	国检集团	56,820	684,681.00	0.14
43	002368	太极股份	33,800	649,298.00	0.14
44	688213	思特威	12,838	629,190.38	0.13
45	002430	杭氧股份	19,700	615,822.00	0.13
46	002240	盛新锂能	8,200	494,952.00	0.10
47	300596	利安隆	10,200	449,922.00	0.10

48	300258	精锻科技	39,300	433,872.00	0.09
49	603279	景津装备	11,640	360,956.40	0.08
50	002643	万润股份	17,100	356,706.00	0.08
51	688302	海创药业	9,157	351,170.95	0.07
52	300463	迈克生物	15,500	317,595.00	0.07
53	688349	三一重能	8,554	315,984.76	0.07
54	688046	药康生物	11,005	288,771.20	0.06
55	688279	峰昭科技	3,487	234,814.58	0.05
56	301175	中科环保	60,880	232,561.60	0.05
57	002465	海格通信	25,200	229,068.00	0.05
58	688048	长光华芯	2,007	224,723.79	0.05
59	300308	中际旭创	7,200	223,560.00	0.05
60	603386	骏亚科技	14,200	222,798.00	0.05
61	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.05
62	688400	凌云光	8,635	189,365.55	0.04
63	000997	新大陆	14,000	184,940.00	0.04
64	301239	普瑞眼科	5,268	177,268.20	0.04
65	600563	法拉电子	700	143,612.00	0.03
66	300193	佳士科技	15,000	140,700.00	0.03
67	603105	芯能科技	12,100	135,278.00	0.03
68	002367	康力电梯	18,100	135,207.00	0.03
69	600529	山东药玻	4,700	131,365.00	0.03

70	603277	银都股份	6,200	130,882.00	0.03
71	688122	西部超导	1,300	119,860.00	0.03
72	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.03
73	002645	华宏科技	4,100	89,462.00	0.02
74	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
75	002206	海利得	8,900	56,248.00	0.01
76	688267	中触媒	1,617	51,582.30	0.01
77	002968	新大正	1,900	46,854.00	0.01
78	002063	远光软件	6,500	45,695.00	0.01
79	601089	福元医药	1,279	26,922.95	0.01
80	301263	泰恩康	655	20,553.90	0.00
81	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
82	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
83	301201	诚达药业	247	17,670.38	0.00
84	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
85	301268	铭利达	444	15,482.28	0.00
86	300887	谱尼测试	360	15,375.60	0.00
87	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
88	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
89	002826	易明医药	1,400	13,664.00	0.00
90	301109	军信股份	791	12,766.74	0.00
91	301103	何氏眼科	382	12,231.64	0.00
92	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
93	301235	华康医	306	11,606.58	0.00

		疗			
94	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
95	301200	大族数控	217	11,266.64	0.00
96	300898	熊猫乳品	496	11,160.00	0.00
97	301148	嘉戎技术	464	11,089.60	0.00
98	301207	华兰疫苗	163	9,196.46	0.00
99	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
100	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
101	301123	奕东电子	295	7,490.05	0.00
102	688139	海尔生物	100	7,283.00	0.00
103	301110	青木股份	176	7,013.60	0.00
104	688006	杭可科技	100	7,006.00	0.00
105	300892	品渥食品	227	6,798.65	0.00
106	300834	星辉环材	225	6,756.75	0.00
107	301196	唯科科技	157	5,890.64	0.00
108	300889	爱克股份	392	5,597.76	0.00
109	688181	八亿时空	100	4,330.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	20,783,015.00	5.05
2	300750	宁德时代	17,389,903.00	4.23

3	601012	隆基绿能	17,066,938.92	4.15
4	600438	通威股份	16,038,263.00	3.90
5	002812	恩捷股份	14,767,196.32	3.59
6	600030	中信证券	13,592,739.14	3.31
7	600887	伊利股份	12,972,926.25	3.15
8	002475	立讯精密	12,721,033.10	3.09
9	300450	先导智能	12,551,725.00	3.05
10	603799	华友钴业	12,203,264.61	2.97
11	300014	亿纬锂能	11,587,217.00	2.82
12	603259	药明康德	10,213,942.80	2.48
13	002129	TCL 中环	9,956,797.00	2.42
14	300122	智飞生物	9,291,848.00	2.26
15	002371	北方华创	9,096,020.23	2.21
16	600809	山西汾酒	8,780,422.06	2.14
17	600089	特变电工	8,528,608.00	2.07
18	600900	长江电力	8,508,257.32	2.07
19	600741	华域汽车	8,204,936.00	2.00
20	601601	中国太保	8,151,236.26	1.98

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	601012	隆基绿能	21,643,221.66	5.26
2	300750	宁德时代	21,329,078.61	5.19
3	603799	华友钴业	17,654,349.32	4.29
4	600030	中信证券	14,928,463.70	3.63
5	600438	通威股份	12,989,586.96	3.16
6	300059	东方财富	12,275,910.98	2.99
7	002129	TCL 中环	12,055,139.28	2.93
8	002812	恩捷股份	12,024,238.00	2.92
9	300014	亿纬锂能	11,138,373.85	2.71
10	601899	紫金矿业	10,964,951.83	2.67
11	300450	先导智能	10,563,950.69	2.57
12	600900	长江电力	9,672,596.87	2.35
13	002475	立讯精密	9,147,105.00	2.22
14	601601	中国太保	8,499,727.00	2.07
15	300122	智飞生物	8,305,580.00	2.02
16	000568	泸州老窖	8,280,801.00	2.01

17	002049	紫光国微	8,083,658.82	1.97
18	601985	中国核电	8,003,552.00	1.95
19	600887	伊利股份	7,925,564.33	1.93
20	002230	科大讯飞	7,790,411.99	1.89

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	1,132,162,184.96
卖出股票收入（成交）总额	1,063,460,676.87

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）	77,114.53	0.02
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	77,114.53	0.02

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	127064	杭氧转债	771	77,114.53	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、重庆市涪陵榨菜集团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	108,461.90
2	应收清算款	11,089,499.55
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	735,822.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,933,784.44

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

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
汇添富沪深 300 指数增强 A	12,439	22,778.70	193,385,229.45	68.25	89,958,970.24	31.75
汇添富沪深 300 指数增强 C	2,256	3,297.15	0.00	0.00	7,438,376.79	100.00
合计	14,695	19,787.86	193,385,229.45	66.51	97,397,347.03	33.49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富沪深 300 指数增强 A	119,161.96	0.04
	汇添富沪深 300 指数增强 C	7,319.53	0.10

	合计	126,481.49	0.04
--	----	------------	------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富沪深 300 指数增强 A	0
	汇添富沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富沪深 300 指数增强 A	0~10
	汇添富沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富沪深 300 指数增强 A	汇添富沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日 （2020 年 11 月 03 日）基金份额总额	194,012,600.68	—
本报告期期初基金份额总额	233,170,394.03	6,926,865.70
本报告期基金总申购份额	98,033,420.38	4,886,222.87
减：本报告期基金总赎回份额	47,859,614.72	4,374,711.78
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	283,344,199.69	7,438,376.79

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，本基金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。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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 (%)	
中信建投证券	4	340,032,191.93	15.56	243,635.62	15.55	
海通证券	4	224,875,897.46	10.29	161,505.66	10.31	

方正证券	2	199,992,541.73	9.15	143,596.02	9.17	
西部证券	2	192,130,199.74	8.79	137,027.18	8.75	
申万宏源证券	3	170,622,983.15	7.81	122,202.82	7.80	
东吴证券	3	148,065,516.53	6.77	105,792.54	6.75	
招商证券	2	142,687,841.08	6.53	102,366.35	6.53	
东方证券	2	137,811,929.96	6.31	99,801.74	6.37	
华兴证券	2	130,353,613.49	5.96	93,405.85	5.96	
国金证券	2	96,050,863.31	4.39	68,853.39	4.40	
浙商证券	1	91,911,115.66	4.21	65,669.77	4.19	
太平洋证券	2	88,623,344.27	4.05	63,091.66	4.03	
野村东方国际	2	80,469,442.73	3.68	57,938.95	3.70	
中泰证券	2	58,594,151.42	2.68	41,841.64	2.67	
上海证券	2	43,812,997.45	2.00	31,365.47	2.00	
安信证券	2	21,071,021.20	0.96	15,152.37	0.97	
中信证券	3	18,579,413.40	0.85	13,219.14	0.84	
川财证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
粤开证券	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 (%)
中信建投证券	123,893.10	7.23	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,506,781.00	87.96	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	82,323.30	4.81	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开 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,同一基金管理人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 2 家证券公司的 4 个交易单元:海通证券(上交所单元,深交所单元)、安信证券(深交所单元,上交所单元)。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下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
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价值多因子量化策略股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 指数增强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、报告期内汇添富沪深 300 指数增强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