

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
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	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	21
6.3 净资产（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	24
§ 7 投资组合报告	65
7.1 期末基金资产组合情况	65
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	66
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
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	78
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	79
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	79
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	79

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	79
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	79
7.12 市场中性策略执行情况.....	79
7.13 投资组合报告附注.....	79
§ 8 基金份额持有人信息	80
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	80
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	81
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.....	81
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	82
§ 9 开放式基金份额变动	82
§ 10 重大事件揭示	82
10.1 基金份额持有人大会决议.....	83
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.....	83
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	83
10.4 基金投资策略的改变.....	83
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
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.....	83
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	83
10.8 其他重大事件.....	88
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
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.....	89
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
§ 12 备查文件目录	89
12.1 备查文件目录.....	89
12.2 存放地点	89
12.3 查阅方式	89

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	汇添富绝对收益定开混合	
基金主代码	000762	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 03 月 15 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	10,295,536,852.84	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
下属分级基金的交易代码	000762	008140
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	8,628,954,279.27	1,666,582,573.57

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李鹏	张燕
	联系电话	021-28932888	0755-83199084

电子邮箱	service@99fund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	400-888-9918	95555
传真	021-28932998	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	李文	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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)	
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
本期已实现收益	-47,539,412.19	-15,156,754.33
本期利润	-348,116,162.91	-69,105,062.50
加权平均基金份额本期利润	-0.0386	-0.0402
本期加权平均净值利润率	-2.83%	-3.00%
本期基金份额净值增长率	-1.93%	-2.25%
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	3,239,558,514.65	557,348,840.65
期末可供分配基金份额利润	0.3754	0.3344
期末基金资产净值	11,868,512,793.92	2,244,575,533.78
期末基金份额净值	1.375	1.347
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	37.50%	5.65%

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

汇添富绝对收益定开混合 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.40%	0.36%	0.12%	0.00%	1.28%	0.36%
过去三个月	1.18%	0.36%	0.37%	0.00%	0.81%	0.36%
过去六个月	-1.93%	0.33%	0.74%	0.01%	-2.67%	0.32%
过去一年	-4.78%	0.32%	1.50%	0.00%	-6.28%	0.32%
过去三年	13.36%	0.33%	4.50%	0.00%	8.86%	0.33%
自基金合同生效日起至今	37.50%	0.33%	7.94%	0.00%	29.56%	0.33%

汇添富绝对收益定开混合 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.35%	0.37%	0.12%	0.00%	1.23%	0.37%
过去三个月	0.97%	0.36%	0.37%	0.00%	0.60%	0.36%
过去六个月	-2.25%	0.33%	0.74%	0.01%	-2.99%	0.32%
过去一年	-5.47%	0.32%	1.50%	0.00%	-6.97%	0.32%
自基金合同生效日起至今	5.65%	0.34%	3.95%	0.00%	1.70%	0.34%

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

汇添富绝对收益定开混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富绝对收益定开混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017 年 03 月 15 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本金为 132,724,224 元人民币。公司总部设立于上海，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		
顾耀强	本基金的基金经理, 增强收益部总监	2017 年 03 月 15 日		18	国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，现任增强收益部总监。2009 年 12 月 22 日至今任

					汇添富策略回报混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 3 月 9 日至 2020 年 9 月 3 日任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理。 2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 月 27 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。 2019 年 8 月 24 日至今任汇添富均衡增长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月 20 日至
--	--	--	--	--	--

					今任汇添富沪深 300 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。 2021 年 2 月 5 日至今任汇添富价值成长均衡投资混合型证券投资基金的基金经理。 2021 年 9 月 16 日至今任汇添富中证 500 基本面增强指数型证券投资基金的基金经理。
吴江宏	本基金的基金经理, 稳健收益部总经理	2017 年 03 月 15 日		11	国籍：中国。学历：厦门大学经济学硕士。 从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2011 年加入汇添富基金管理股份有限公司，历任固定收益分析师，现任稳健收益部总经理。2015 年 7 月 17 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经

					理。2016 年 4 月 19 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月 3 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月 29 日至今任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 13 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 4 月 20 日至 2019 年 9 月 4 日任汇添富
--	--	--	--	--	--

					鑫益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2017 年 6 月 23 日至 2019 年 8 月 28 日任汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 2017 年 9 月 27 日至 2020 年 6 月 3 日任汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月 25 日至 2019 年 8 月 29 日任汇添富鑫永定定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月 16 日至 2020 年 3 月 23 日任汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。 2018 年 9 月 28 日至 2020 年 6 月 4 日任汇添富年年丰定期开放混合型证
--	--	--	--	--	---

					券投资基金的基金经理。2018 年 9 月 28 日至今任汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至今任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 4 月 20 日任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月 28 日至 2021 年 5 月 20 日任汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月 4 日至今任汇添富稳健睿选一年持有期混合型证券投资基金
--	--	--	--	--	---

					的基金经理。2021 年 3 月 23 日至今任汇添富稳健盈和一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 2021 年 3 月 25 日至今任汇添富稳健鑫添益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。 2021 年 7 月 21 日至今任汇添富鑫享添利六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、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

上半年市场受突发地缘冲突及国内疫情扩散的双重影响，一度跌幅较大。后期随着国内疫情逐步得到控制，市场信心有一定恢复，但整体呈现出波动剧烈，分化极致的特征。上半年除煤炭行业受益于国际能源价格的大幅上涨有较好表现外，大部分其它行业均表现不佳。电动车、光伏等少数高景气赛道在政策等推动下基本面超预期而先抑后扬，但结构分化严重。从风格上看，中小市值公司表现好于大市值公司。上半年本基金前期对市场系统性风险和风格变化的反应不够敏捷，但在积极优化投资策略后，超额及稳定性均有一定恢复。本基金管

理人会继续依托公司投研支持，不断完善投资策略，提高产品在不同市场环境中的适应性，努力为持有人获取相对稳定的超额回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富绝对收益定开混合 A 类份额净值增长率为-1.93%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%。本报告期汇添富绝对收益定开混合 C 类份额净值增长率为-2.25%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，虽然仍面临内外部诸多不确定性因素，但在国内经济筑底回升和流动性环境相对宽松的组下，我们对 A 股市场整体看法略偏积极。基建等稳增长相关产业的确定性较强。新能源等高景气赛道则将面临市场较高预期能否兑现的检验，后期分化仍将较大。消费、医药等近几年受疫情、政策冲击较大的行业，阶段性仍须观察疫情防控进展，但从中长期看，一些优质公司已经具备较好投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次

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

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：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	191,123,888.26	846,039,506.82
结算备付金		1,619,741,016.36	3,261,658,987.69
存出保证金		1,003,055,009.03	1,328,893,488.91
交易性金融资产	6.4.7.2	12,135,053,350.28	17,695,295,560.35
其中：股票投资		9,693,845,594.85	13,127,830,213.23
基金投资		-	-
债券投资		2,441,207,755.43	4,567,465,347.12
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	-	5,199,872,959.81
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		538,953.82	52,180,939.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	54,382,776.53
资产总计		14,949,512,217.75	28,438,324,219.71
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		48,851,619.81	779,515,855.98
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,250,586.48	34,062,479.32
应付托管费		2,875,097.76	5,677,079.89
应付销售服务费		1,463,654.43	2,662,878.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,563,743.09	179,819.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	763,419,188.48	1,062,240,611.65

负债合计		836,423,890.05	1,884,338,725.45
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	10,295,536,852.84	18,991,829,582.14
未分配利润	6.4.7.9	3,817,551,474.86	7,562,155,912.12
净资产合计		14,113,088,327.70	26,553,985,494.26
负债和净资产总计		14,949,512,217.75	28,438,324,219.71

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 10,295,536,852.84 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.375 元，基金份额总额 8,628,954,279.27 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.347 元，基金份额总额 1,666,582,573.57 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：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：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		-276,171,185.32	976,380,560.68
1. 利息收入		26,021,700.21	113,599,926.02
其中：存款利息收入	6.4.7.10	23,887,268.27	9,305,825.67
债券利息收入		-	102,071,528.39
资产支持证券利息收入		-	1,673,624.01
买入返售金融资产收入		2,134,431.94	548,947.95
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		44,020,372.30	830,825,111.60
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-1,022,401,851.90	1,635,041,689.63
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	18,489,790.97	12,396,760.71
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-69,128.77
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	982,716,012.40	-901,310,964.52
股利收益	6.4.7.17	65,216,420.83	84,766,754.55
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	-354,525,058.89	27,390,916.75
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	8,311,801.06	4,564,606.31
减：二、营业总支出		141,050,040.09	252,948,609.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	109,473,548.73	158,238,829.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	18,245,591.53	26,373,138.12
3. 销售服务费		9,191,865.09	11,203,022.10
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	3,664.18
其中：卖出回购金融资产支出		-	3,664.18
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		3,608,185.28	293,964.70
8. 其他费用	6.4.7.21	530,849.46	56,835,990.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-417,221,225.41	723,431,951.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-417,221,225.41	723,431,951.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-417,221,225.41	723,431,951.56

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：汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：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）	18,991,829,582.14	7,562,155,912.12	26,553,985,494.26
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	18,991,829,582.14	7,562,155,912.12	26,553,985,494.26

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,696,292,729.30	-3,744,604,437.26	-12,440,897,166.56
（一）、综合收益总额	-	-417,221,225.41	-417,221,225.41
（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）	-8,696,292,729.30	-3,327,383,211.85	-12,023,675,941.15
其中：1. 基金申购款	23,473,707.91	9,045,976.49	32,519,684.40
2. 基金赎回款	-8,719,766,437.21	-3,336,429,188.34	-12,056,195,625.55
（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）	10,295,536,852.84	3,817,551,474.86	14,113,088,327.70
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）	15,067,356,257.54	5,963,494,086.54	21,030,850,344.08
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	15,067,356,257.54	5,963,494,086.54	21,030,850,344.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,325,641,371.56	1,712,551,740.44	4,038,193,112.00
（一）、综合收益总额	-	723,431,951.56	723,431,951.56
（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）	2,325,641,371.56	989,119,788.88	3,314,761,160.44
其中：1. 基金申购款	7,647,734,107.33	3,261,374,571.08	10,909,108,678.41
2. 基金赎回款	-5,322,092,735.77	-2,272,254,782.20	-7,594,347,517.97
（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）	17,392,997,629.10	7,676,045,826.98	25,069,043,456.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]741 号文《关于核准汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》的核准，以及中国证监会机构部函[2016]2980 号文《关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金延期募集备案的回函》准予延期募集，由汇添富基金管理股份有限公司作为基金发起人向社会公开发行募集，基金合同于 2017 年 3 月 15 日生效，首次设立募集规模为 493,313,864.49 份基金份额。本基金为契约型开放式，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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

自 2019 年 11 月 11 日起，本基金增设 C 类基金份额类别，原基金份额变更为 A 类基金份额，C 类份额注册登记机构为汇添富基金管理股份有限公司。

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金基于基金管理人

市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。本基金的业绩比较基准为：一年期定期存款税后利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（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 846,039,506.82 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 57,989.81 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 846,097,496.63 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,261,658,987.69 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,241,206.90 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,264,900,194.59 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 1,328,893,488.91 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,113.65 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 1,328,895,602.56 元。

买入返售金融资产于 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 5,199,872,959.81 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,076,010.88 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，买入返售金融资产于 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 5,201,948,970.69 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 54,382,776.53 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 57,989.81 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 3,241,206.90 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 2,113.65 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 49,005,455.29 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 2,076,010.88 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 17,695,295,560.35 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 49,005,455.29 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 17,744,301,015.64 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	191,123,888.26
等于：本金	191,104,579.16
加：应计利息	19,309.10
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	191,123,888.26

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		9,299,265,611.11	-	9,693,845,594.85	394,579,983.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	291,022,245.73	4,376,072.38	303,786,658.12	8,388,340.01
	银行间市场	2,084,649,432.21	33,643,347.31	2,137,421,097.31	19,128,317.79
	其他	-	-	-	-
	合计	2,375,671,677.94	38,019,419.69	2,441,207,755.43	27,516,657.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		11,674,937,289.05	38,019,419.69	12,135,053,350.28	422,096,641.54

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	-7,606,098,960.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投	-7,606,098,960.00	-	-	-

资)				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-7,606,098,960.00	-	-	-

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
IC2209	IC2209	-400	-509,120,000.00	-42,934,280.00
IF2207	IF2207	-1,162	-1,559,357,520.00	-116,509,200.00
IF2209	IF2209	-3,681	-4,911,042,960.00	-420,671,160.00
IF2212	IF2212	-953	-1,267,680,600.00	-60,987,480.00
合计				-641,102,120.00
减：可抵销期货暂收款				-641,102,120.00
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	8,436,396.54
其中：交易所市场	8,435,021.54
银行间市场	1,375.00
应付利息	-
应付审计费	139,588.57
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	754,783,696.00
合计	763,419,188.48

注：本基金使用国债冲抵期货备付金，其他负债-其他为期末应付各期货公司的备付金余额。

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富绝对收益定开混合 A		
项目	本期 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	16,168,004,810.34	16,168,004,810.34
本期申购	22,852,752.89	22,852,752.89
本期赎回（以“-”号填列）	-7,561,903,283.96	-7,561,903,283.96
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	8,628,954,279.27	8,628,954,279.27
汇添富绝对收益定开混合 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	2,823,824,771.80	2,823,824,771.80
本期申购	620,955.02	620,955.02
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,157,863,153.25	-1,157,863,153.25
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,666,582,573.57	1,666,582,573.57

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

汇添富绝对收益定开混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	6,089,415,700.78	405,435,557.04	6,494,851,257.82
本期利润	-47,539,412.19	-300,576,750.72	-348,116,162.91
本期基金份额交易产生的变动数	-2,788,067,428.45	-119,109,151.81	-2,907,176,580.26
其中：基金申购款	8,455,464.11	366,124.35	8,821,588.46
基金赎回款	-2,796,522,892.56	-119,475,276.16	-2,915,998,168.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,253,808,860.14	-14,250,345.49	3,239,558,514.65
汇添富绝对收益定开混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	958,070,411.94	109,234,242.36	1,067,304,654.30
本期利润	-15,156,754.33	-53,948,308.17	-69,105,062.50
本期基金	-385,564,816.96	-34,641,814.63	-420,206,631.59

份额交易产生的变动数			
其中：基金申购款	206,450.47	17,937.56	224,388.03
基金赎回款	-385,771,267.43	-34,659,752.19	-420,431,019.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	557,348,840.65	20,644,119.56	577,992,960.21

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	809,084.26
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	23,041,684.48
其他	36,499.53
合计	23,887,268.27

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	14,498,068,610.87
减：卖出股票成本总额	15,483,600,785.36
减：交易费用	36,869,677.41
买卖股票差价收入	-1,022,401,851.90

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	47,698,939.05
债券投资收益——买卖债券差价收入	-29,209,148.08
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	18,489,790.97

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	2,341,569,082.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,348,416,057.24
减：应计利息总额	22,351,528.75
减：交易费用	10,645.00
买卖债券差价收入	-29,209,148.08

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

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
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	982,716,012.40
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	65,216,420.83
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	65,216,420.83

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	135,207,210.92
——股票投资	110,062,844.03
——债券投资	25,144,366.89
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-489,732,269.81
——权证投资	-
——期货投资	-489,732,269.81
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	-354,525,058.89

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	8,311,801.06
替代损益	-
其他	-
合计	8,311,801.06

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	18,150.00
银行费用	20,618.65
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	382,984.87
合计	530,849.46

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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	11,539,344,363.19	43.70	8,391,267,202.10	22.94

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	202,524,587.19	93.47	1,585,707,483.70	96.82

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
东方证券	200,000,000.00	41.67	-	-

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	8,902,769.23	44.41	3,814,153.30	45.22
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	7,703,450.00	22.91	4,623,362.11	27.30

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	109,473,548.73	158,238,829.05
其中：支付销售机构的客户维护费	34,002,050.63	34,380,309.80

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人与基金托管人核对一致后, 基金托管人于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	18,245,591.53	26,373,138.12

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

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月前三个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	78,570.99	78,570.99
招商银行股份有限公司	-	4,865,663.64	4,865,663.64
东方证券股份有限公司	-	65,118.49	65,118.49
合计	-	5,009,353.12	5,009,353.12
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		
	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	155,770.42	155,770.42
招商银行股份有限公司	-	7,098,860.52	7,098,860.52
东方证券股份有限公司	-	204,646.59	204,646.59
合计	-	7,459,277.53	7,459,277.53

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富绝对收益定开混合 A		
项目	本期 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
基金合同生效日（2017 年 03 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	10,001,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	10,001,000.00

报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例 (%)	-	-
汇添富绝对收益定开混合 C		
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
基金合同生效日 (2017 年 03 月 15 日) 持有的基金 份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份 额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出 总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例 (%)	-	-

注: 基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联 方名 称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商 银行	191,123,888.26	809,084.26	497,750,635.99	815,210.66

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
300834	星辉环材	2022 年 01 月 06 日	6 个月	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	
301103	何氏眼科	2022 年 03 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	
301109	军信股份	2022 年 04 月 06 日	6 个月	新股流通受限	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	
301110	青木股份	2022 年 03 月 04 日	6 个月	新股流通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	
301116	益客食品	2022 年 01 月 10 日	6 个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	

301117	佳缘科技	2022年01月07日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	
301123	奕东电子	2022年01月14日	6个月	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	
301135	瑞德智能	2022年04月01日	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	
301139	元道通信	2022年06月30日	6个交易日	新股流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	
301139	元道通信	2022年06月30日	6个月	新股流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	
301148	嘉戎技术	2022年04月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	
301162	国能日新	2022年04月19日	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	
301175	中科	2022年	6个	新股	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	

	环 保	06 月 30 日	交 易 日	流 通 受 限						
30117 5	中 科 环 保	202 2 年 06 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	
30118 1	标 榜 股 份	202 2 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	
30118 7	欧 圣 电 气	202 2 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	
30119 6	唯 科 科 技	202 2 年 01 月 04 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	
30120 0	大 族 数 控	202 2 年 02 月 18 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	
30120 1	诚 达 药 业	202 2 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	
30120 7	华 兰 疫 苗	202 2 年 02 月	6 个 月	新 股 流 通	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	

		10 日		受 限						
30121 2	联 盛 化 学	202 2 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	
30123 3	盛 帮 股 份	202 2 年 06 月 24 日	8 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	
30123 3	盛 帮 股 份	202 2 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	
30123 5	华 康 医 疗	202 2 年 01 月 21 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	
30123 9	普 瑞 眼 科	202 2 年 06 月 22 日	9 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	
30123 9	普 瑞 眼 科	202 2 年 06 月 22 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	
30126 3	泰 恩 康	202 2 年 03 月 22 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	

301268	铭利达	2022年03月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	
301286	侨源股份	2022年06月06日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	
600938	中国海油	2022年04月14日	6个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	
688193	仁度生物	2022年03月23日	6个月	新股流通受限	72.65	51.57	1,635	118,782.75	84,316.95	
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	
688259	创耀科技	2022年01月05日	6个月	新股流通受限	66.60	79.22	1,595	106,227.00	126,355.90	
688283	坤恒顺维	2022年02月08日	6个月	新股流通受限	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95	
688400	凌云	2022年	7个	新股	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	

	光	06 月 27 日	交 易 日	流 通 受 限						
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
118008	海 优 转 债	2022 年 06 月 24 日	1 9 个 交 易 日	新 债 流 通 受 限	100.0 0	100.0 1	17,02 0	1,702,000.0 0	1,702,089.5 3	
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 117 股（根据何氏眼科 2021 年年度权益分派实施公告，何氏眼科以公司现有总股本 121,558,824 股为基数，向全体股东每 10 股派 6 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股，除权除息日为 2022 年 6 月 1 日。）。本基金持有的流通受限股票“军信股份”（证券代码：301109）包含其新股发行后期根据权益分配方案以资本公积金转增获得的 613 股（根据军信股份 2021 年年度权益分派实施公告，军信股份以公司现有总股本 273,340,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 3.80 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股，除权除息日为 2022 年 6 月 17 日。）。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本 期 末 20 22 年 06 月	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
---	------------	--------	-------------	-------	-----------	-----	----

30 日							
资 产							
银 行 存 款	191,123, 888.26	-	-	-	-	-	191,123,8 88.26
结 算 备 付 金	1,619,74 1,016.36	-	-	-	-	-	1,619,741 ,016.36
存 出 保 证 金	3,208,47 9.43	-	-	-	-	999,846,5 29.60	1,003,055 ,009.03
交 易 性 金 融 资 产	87,266,5 34.13	16,660,3 65.64	608,071 ,917.37	1,729,20 8,938.29	-	9,693,845 ,594.85	12,135,05 3,350.28
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
买 入 返 售 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
债 权 投 资	-	-	-	-	-	-	-
应	-	-	-	-	-	538,953.8	538,953.8

收清算款						2	2
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,901,339,918.18	16,660,365.64	608,071,917.37	1,729,208,938.29	-	10,694,231,078.27	14,949,512,217.75
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	-	-	-	-	-	48,851,61 9.81	48,851,61 9.81
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	-	17,250,58 6.48	17,250,58 6.48
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	2,875,097 .76	2,875,097 .76
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	1,463,654 .43	1,463,654 .43
应 付 投	-	-	-	-	-	-	-

资 顾 问 费							
应 交 税 费	-	-	-	-	-	2,563,743 .09	2,563,743 .09
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
递 延 所 得 税 负 债	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	763,419,1 88.48	763,419,1 88.48
负 债 总 计	-	-	-	-	-	836,423,8 90.05	836,423,8 90.05
利 率 敏 感 度 缺 口	1,901,33 9,918.18	16,660,3 65.64	608,071 ,917.37	1,729,20 8,938.29	-	9,857,807 ,188.22	14,113,08 8,327.70
上 年 度 末 20 21 年 12 月 31	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

日							
资产							
银行存款	846,039,506.82	-	-	-	-	-	846,039,506.82
结算备付金	3,261,658,987.69	-	-	-	-	-	3,261,658,987.69
存出保证金	4,270,088.11	-	-	-	-	1,324,623,400.80	1,328,893,488.91
交易性金融资产	1,646,692.52	1,452,336,811.60	290,904,243.00	2,814,432,400.00	8,145,200.00	13,127,830,213.23	17,695,295,560.35
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	5,199,872,959.81	-	-	-	-	-	5,199,872,959.81
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收	-	-	-	-	-	52,180,939.60	52,180,939.60

清算款							
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	54,382,776.53	54,382,776.53
资产总计	9,313,488,234.95	1,452,336,811.60	290,904,243.00	2,814,432,400.00	8,145,200.00	14,559,017,330.16	28,438,324,219.71
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	-	-	-	-	-	779,515,855.98	779,515,855.98
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	34,062,479.32	34,062,479.32
应付托管费	-	-	-	-	-	5,677,079.89	5,677,079.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,662,878.72	2,662,878.72
应付投资	-	-	-	-	-	-	-

顾问费							
应交税费	-	-	-	-	-	179,819.89	179,819.89
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,062,240,611.65	1,062,240,611.65
负债总计	-	-	-	-	-	1,884,338,725.45	1,884,338,725.45
利率敏感度缺口	9,313,488,234.95	1,452,336,811.60	290,904,243.00	2,814,432,400.00	8,145,200.00	12,674,678,604.71	26,553,985,494.26

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	9,827,017.88	17,213,127.92
	基准利率增加 25 个基点	-9,740,509.19	-17,054,598.23

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	9,693,845,594.85	68.69	13,127,830,213.23	49.44
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,441,207,755.43	17.30	4,567,465,347.12	17.20
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	12,135,053,350.28	85.98	17,695,295,560.35	66.64

	50.28		60.35
--	-------	--	-------

本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120% 之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	110,285,382.48	298,473,160.65
	沪深 300 指数下跌 5%	-110,285,382.48	-298,473,160.65

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	9,734,376,839.01
第二层次	2,398,677,488.22
第三层次	1,999,023.05
合计	12,135,053,350.28

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	9,693,845,594.85	64.84
	其中：股票	9,693,845,594.85	64.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,441,207,755.43	16.33
	其中：债券	2,441,207,755.43	16.33
	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	1,810,864,904.62	12.11
8	其他各项资产	1,003,593,962.85	6.71
9	合计	14,949,512,217.75	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	194,600,773.40	1.38
B	采矿业	303,983,192.78	2.15
C	制造业	5,523,970,622.78	39.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	138,853,240.56	0.98
E	建筑业	170,604,042.00	1.21
F	批发和零售业	132,493,260.45	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	300,955,547.59	2.13
H	住宿和餐饮业	60,207,880.00	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	363,418,758.55	2.58
J	金融业	1,629,537,940.26	11.55
K	房地产业	224,994,823.81	1.59
L	租赁和商务服务业	174,235,620.69	1.23
M	科学研究和技术服务业	248,124,828.06	1.76
N	水利、环境和公共设施管理业	102,416,930.14	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	96,218,035.06	0.68
R	文化、体育和娱乐业	29,230,098.72	0.21
S	综合	-	-
	合计	9,693,845,594.85	68.69

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	290,780	594,645,100.00	4.21
2	300059	东方财富	12,234,900	310,766,460.00	2.20
3	300750	宁德时代	577,693	308,488,062.00	2.19
4	600030	中信证券	8,356,271	180,996,829.86	1.28
5	601012	隆基绿能	2,525,388	168,266,602.44	1.19
6	601888	中国中免	708,600	165,054,198.00	1.17
7	601166	兴业银行	6,761,085	134,545,591.50	0.95
8	600036	招商银行	3,179,972	134,194,818.40	0.95
9	002142	宁波银行	3,574,100	127,988,521.00	0.91
10	601658	邮储银行	22,823,700	123,019,743.00	0.87
11	600048	保利发展	6,637,400	115,889,004.00	0.82
12	601398	工商银行	22,936,345	109,406,365.65	0.78
13	603259	药明康德	1,043,200	108,482,368.00	0.77
14	000001	平安银	7,166,669	107,356,701.62	0.76

		行			
15	002714	牧原股份	1,926,120	106,456,652.40	0.75
16	601318	中国平安	2,221,590	103,726,037.10	0.73
17	603568	伟明环保	3,060,582	102,131,621.34	0.72
18	002271	东方雨虹	1,974,681	101,636,831.07	0.72
19	300015	爱尔眼科	2,144,481	96,008,414.37	0.68
20	000568	泸州老窖	382,900	94,400,166.00	0.67
21	000333	美的集团	1,528,539	92,308,470.21	0.65
22	600438	通威股份	1,521,700	91,088,962.00	0.65
23	600900	长江电力	3,847,008	88,942,824.96	0.63
24	001914	招商积余	4,930,629	88,603,403.13	0.63
25	002352	顺丰控股	1,508,808	84,206,574.48	0.60
26	002594	比亚迪	250,135	83,417,521.15	0.59
27	688390	固德威	255,931	80,108,962.31	0.57
28	300759	康龙化成	839,206	79,909,195.32	0.57
29	601899	紫金矿业	8,563,500	79,897,455.00	0.57
30	601669	中国电建	9,690,000	76,260,300.00	0.54
31	002371	北方华创	273,500	75,792,320.00	0.54
32	603290	斯达半导	195,500	75,443,450.00	0.53
33	601111	中国国航	6,490,651	75,356,458.11	0.53
34	300122	智飞生物	674,627	74,890,343.27	0.53
35	600233	圆通速递	3,621,400	73,840,346.00	0.52
36	600570	恒生电子	1,670,500	72,733,570.00	0.52

37	000596	古井贡酒	288,726	72,083,333.16	0.51
38	000858	五粮液	349,359	70,546,062.87	0.50
39	603198	迎驾贡酒	1,078,600	70,260,004.00	0.50
40	000661	长春高新	297,113	69,352,116.46	0.49
41	600765	中航重机	2,152,760	69,275,816.80	0.49
42	600809	山西汾酒	213,200	69,247,360.00	0.49
43	002557	洽洽食品	1,179,300	67,137,549.00	0.48
44	300896	爱美客	111,740	67,045,117.40	0.48
45	300014	亿纬锂能	685,300	66,816,750.00	0.47
46	002475	立讯精密	1,937,300	65,461,367.00	0.46
47	601117	中国化学	6,946,200	65,363,742.00	0.46
48	002415	海康威视	1,753,100	63,462,220.00	0.45
49	002812	恩捷股份	252,809	63,316,014.05	0.45
50	600096	云天化	1,974,200	62,147,816.00	0.44
51	300207	欣旺达	1,960,900	61,964,440.00	0.44
52	000683	远兴能源	5,834,828	61,324,042.28	0.43
53	600754	锦江酒店	957,200	60,207,880.00	0.43
54	002179	中航光电	949,178	60,101,950.96	0.43
55	300760	迈瑞医疗	190,903	59,790,819.60	0.42
56	600188	兖矿能源	1,447,000	57,127,560.00	0.40
57	600031	三一重工	2,928,300	55,813,398.00	0.40
58	603799	华友钴业	583,510	55,795,226.20	0.40
59	300274	阳光电源	565,281	55,538,858.25	0.39

60	300316	晶盛机电	799,986	54,071,053.74	0.38
61	002410	广联达	991,100	53,955,484.00	0.38
62	600690	海尔智家	1,919,700	52,714,962.00	0.37
63	300124	汇川技术	800,200	52,709,174.00	0.37
64	000983	山西焦煤	3,916,700	52,444,613.00	0.37
65	600256	广汇能源	4,941,931	52,087,952.74	0.37
66	000733	振华科技	381,385	51,856,918.45	0.37
67	300755	华致酒行	1,131,481	49,615,441.85	0.35
68	600926	杭州银行	3,299,977	49,433,655.46	0.35
69	300666	江丰电子	807,500	49,257,500.00	0.35
70	603369	今世缘	961,700	49,046,700.00	0.35
71	600406	国电南瑞	1,800,760	48,620,520.00	0.34
72	601088	中国神华	1,451,262	48,327,024.60	0.34
73	603477	巨星农牧	2,010,800	48,218,984.00	0.34
74	688301	奕瑞科技	99,683	47,154,046.32	0.33
75	002541	鸿路钢构	1,406,543	46,978,536.20	0.33
76	300763	锦浪科技	219,500	46,753,500.00	0.33
77	300628	亿联网络	611,300	46,550,495.00	0.33
78	300170	汉得信息	5,071,400	45,693,314.00	0.32
79	002180	纳思达	882,700	44,682,274.00	0.32
80	002050	三花智控	1,622,900	44,597,292.00	0.32
81	000963	华东医药	966,484	43,646,417.44	0.31
82	002518	科士达	1,424,600	43,592,760.00	0.31
83	688356	键凯科	179,022	43,289,309.82	0.31

		技			
84	002507	涪陵榨菜	1,249,100	43,118,932.00	0.31
85	002709	天赐材料	667,500	41,425,050.00	0.29
86	601009	南京银行	3,956,800	41,229,856.00	0.29
87	601688	华泰证券	2,902,300	41,212,660.00	0.29
88	002043	兔宝宝	3,505,199	40,660,308.40	0.29
89	300498	温氏股份	1,875,300	39,925,137.00	0.28
90	300171	东富龙	1,166,700	39,562,797.00	0.28
91	600004	白云机场	2,652,900	39,554,739.00	0.28
92	002049	紫光国微	208,470	39,550,928.40	0.28
93	600153	建发股份	3,000,000	39,210,000.00	0.28
94	000776	广发证券	2,027,700	37,917,990.00	0.27
95	600309	万华化学	389,779	37,804,665.21	0.27
96	300033	同花顺	385,329	37,049,383.35	0.26
97	600660	福耀玻璃	867,700	36,278,537.00	0.26
98	300855	图南股份	865,656	36,175,764.24	0.26
99	000933	神火股份	2,740,300	35,843,124.00	0.25
100	600702	舍得酒业	173,300	35,351,467.00	0.25
101	688363	华熙生物	241,059	34,273,768.62	0.24
102	600887	伊利股份	865,399	33,707,291.05	0.24
103	300595	欧普康视	585,300	33,473,307.00	0.24
104	603501	韦尔股份	192,952	33,386,484.56	0.24
105	300347	泰格医药	290,200	33,213,390.00	0.24

106	603816	顾家家居	581,230	32,915,054.90	0.23
107	603806	福斯特	501,331	32,847,207.12	0.23
108	603659	璞泰来	385,164	32,507,841.60	0.23
109	600298	安琪酵母	645,673	31,476,558.75	0.22
110	603338	浙江鼎力	619,080	31,387,356.00	0.22
111	601628	中国人寿	991,500	30,815,820.00	0.22
112	688711	宏微科技	403,513	30,788,041.90	0.22
113	600905	三峡能源	4,826,800	30,360,572.00	0.22
114	002484	江海股份	1,297,200	30,276,648.00	0.21
115	300911	亿田智能	393,598	30,248,006.30	0.21
116	002241	歌尔股份	869,956	29,230,521.60	0.21
117	300413	芒果超媒	876,202	29,230,098.72	0.21
118	000012	南玻A	3,933,982	29,190,146.44	0.21
119	000498	山东路桥	3,000,000	28,980,000.00	0.21
120	002129	TCL中环	483,900	28,496,871.00	0.20
121	002304	洋河股份	154,900	28,369,935.00	0.20
122	002460	赣锋锂业	190,733	28,361,997.10	0.20
123	688005	容百科技	219,068	28,356,161.92	0.20
124	600989	宝丰能源	1,914,100	28,041,565.00	0.20
125	688063	派能科技	88,742	27,705,252.40	0.20
126	603486	科沃斯	218,748	26,663,193.72	0.19
127	603127	昭衍新药	232,900	26,504,020.00	0.19
128	600085	同仁堂	482,900	25,535,752.00	0.18
129	300496	中科创	193,300	25,221,784.00	0.18

		达			
130	601636	旗滨集团	1,922,040	24,506,010.00	0.17
131	601966	玲珑轮胎	961,000	24,380,570.00	0.17
132	601601	中国太保	988,700	23,264,111.00	0.16
133	601689	拓普集团	333,450	22,817,983.50	0.16
134	300601	康泰生物	500,000	22,590,000.00	0.16
135	603225	新凤鸣	1,931,624	22,290,940.96	0.16
136	688008	澜起科技	365,797	22,159,982.26	0.16
137	601128	常熟银行	2,892,700	22,100,228.00	0.16
138	002154	报喜鸟	5,000,000	21,600,000.00	0.15
139	688680	海优新材	106,060	21,074,122.00	0.15
140	600588	用友网络	966,370	20,979,892.70	0.15
141	603032	德新交运	265,400	20,966,600.00	0.15
142	000002	万科A	1,000,000	20,500,000.00	0.15
143	002555	三七互娱	964,278	20,471,621.94	0.15
144	300454	深信服	192,500	19,977,650.00	0.14
145	600795	国电电力	4,999,960	19,549,843.60	0.14
146	603039	ST泛微	530,482	19,346,678.54	0.14
147	605123	派克新材	130,100	18,307,672.00	0.13
148	605358	立昂微	259,100	17,458,158.00	0.12
149	002120	韵达股份	1,000,000	17,060,000.00	0.12
150	000786	北新建材	483,700	16,745,694.00	0.12
151	002508	老板电器	458,000	16,501,740.00	0.12
152	688366	昊海生科	155,534	16,452,386.52	0.12

153	603345	安井食品	96,600	16,216,242.00	0.11
154	000630	铜陵有色	4,837,100	15,768,946.00	0.11
155	300682	朗新科技	621,373	15,652,385.87	0.11
156	600563	法拉电子	75,700	15,530,612.00	0.11
157	603995	甬金股份	459,648	15,471,751.68	0.11
158	300026	红日药业	2,000,000	15,400,000.00	0.11
159	601799	星宇股份	89,200	15,253,200.00	0.11
160	688111	金山办公	77,116	15,201,105.92	0.11
161	000876	新希望	988,700	15,127,110.00	0.11
162	601100	恒立液压	238,321	14,709,172.12	0.10
163	601238	广汽集团	964,290	14,695,779.60	0.10
164	002920	德赛西威	99,200	14,681,600.00	0.10
165	601288	农业银行	4,805,600	14,512,912.00	0.10
166	603208	江山欧派	200,000	14,446,000.00	0.10
167	300979	华利集团	191,897	14,023,832.76	0.10
168	300715	凯伦股份	999,960	13,999,440.00	0.10
169	600529	山东药玻	500,000	13,975,000.00	0.10
170	688276	百克生物	200,000	13,270,000.00	0.09
171	002332	仙琚制药	1,326,500	13,026,230.00	0.09
172	688123	聚辰股份	120,352	12,819,895.04	0.09
173	002706	良信股份	771,900	12,759,507.00	0.09
174	002612	朗姿股份	442,200	12,505,416.00	0.09

175	002025	航天电 器	176,781	12,342,849.42	0.09
176	600009	上海机 场	192,900	10,937,430.00	0.08
177	300054	鼎龙股 份	500,000	10,585,000.00	0.08
178	002258	利尔化 学	442,200	10,444,764.00	0.07
179	603520	司太立	371,400	10,443,768.00	0.07
180	000975	银泰黄 金	964,200	9,391,308.00	0.07
181	002027	分众传 媒	1,364,253	9,181,422.69	0.07
182	600315	上海家 化	200,000	8,550,000.00	0.06
183	688180	君实生 物	97,166	7,320,486.44	0.05
184	600276	恒瑞医 药	194,500	7,214,005.00	0.05
185	688800	瑞可达	53,682	6,780,573.42	0.05
186	300286	安科瑞	200,000	5,430,000.00	0.04
187	600559	老白干 酒	182,000	5,221,580.00	0.04
188	300751	迈为股 份	9,700	4,761,730.00	0.03
189	002832	比音勒 芬	182,000	4,586,400.00	0.03
190	300627	华测导 航	120,420	4,141,243.80	0.03
191	002001	新 和 成	175,600	4,005,436.00	0.03
192	688052	纳芯微	10,000	3,789,600.00	0.03
193	001270	铖昌科 技	37,068	3,751,281.60	0.03
194	600028	中国石 化	827,200	3,374,976.00	0.02
195	002311	海大集 团	24,200	1,452,242.00	0.01
196	600938	中国海 油	84,004	1,332,303.44	0.01
197	688777	中控技 术	9,800	713,048.00	0.01
198	688508	芯朋微	9,101	678,024.50	0.00

199	688331	荣昌生物	14,486	677,365.36	0.00
200	688739	成大生物	8,995	457,035.95	0.00
201	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.00
202	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.00
203	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.00
204	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
205	688259	创耀科技	1,595	126,355.90	0.00
206	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
207	688257	新锐股份	2,639	104,557.18	0.00
208	688193	仁度生物	1,635	84,316.95	0.00
209	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.00
210	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
211	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
212	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
213	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
214	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
215	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
216	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
217	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
218	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
219	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
220	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
221	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00

222	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
223	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
224	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
225	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
226	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
227	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
228	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
229	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
230	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
231	605369	拱东医疗	80	9,936.00	0.00
232	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
233	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
234	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
235	002968	新大正	98	2,416.68	0.00
236	600771	广誉远	39	1,370.85	0.00
237	600426	华鲁恒升	13	379.60	0.00
238	600919	江苏银行	36	256.32	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	300750	宁德时代	352,439,764.85	1.33
2	600519	贵州茅台	326,421,425.70	1.23
3	601288	农业银行	281,120,356.00	1.06

4	601398	工商银行	231,073,137.30	0.87
5	300059	东方财富	204,403,254.96	0.77
6	300207	欣旺达	196,096,733.63	0.74
7	601318	中国平安	171,561,747.71	0.65
8	300014	亿纬锂能	152,655,772.28	0.57
9	601166	兴业银行	148,875,922.50	0.56
10	002594	比亚迪	143,435,687.57	0.54
11	601012	隆基绿能	140,492,337.74	0.53
12	600036	招商银行	137,944,377.70	0.52
13	688599	天合光能	135,500,880.86	0.51
14	600188	兖矿能源	128,739,566.05	0.48
15	300274	阳光电源	127,005,871.57	0.48
16	000683	远兴能源	118,057,402.89	0.44
17	000596	古井贡酒	116,760,115.45	0.44
18	001979	招商蛇口	115,868,093.44	0.44
19	002371	北方华创	112,476,018.66	0.42
20	002241	歌尔股份	110,817,760.51	0.42

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	300750	宁德时代	395,906,650.35	1.49
2	600519	贵州茅台	344,083,108.50	1.30
3	601288	农业银行	265,841,790.00	1.00
4	601658	邮储银行	257,297,044.60	0.97
5	002142	宁波银行	233,991,134.77	0.88
6	000858	五粮液	212,391,045.77	0.80
7	601888	中国中免	209,968,021.92	0.79
8	300059	东方财富	202,517,181.75	0.76
9	603259	药明康德	184,759,279.73	0.70
10	300274	阳光电源	182,587,235.11	0.69
11	300014	亿纬锂能	169,834,445.29	0.64
12	000683	远兴能源	163,581,634.82	0.62
13	601398	工商银行	160,420,014.93	0.60
14	000568	泸州老窖	158,319,495.58	0.60
15	601166	兴业银行	155,699,014.00	0.59
16	000001	平安银行	154,827,416.81	0.58
17	000776	广发证券	151,942,341.45	0.57

18	600919	江苏银行	151,710,961.91	0.57
19	601088	中国神华	148,188,438.68	0.56
20	002821	凯莱英	145,899,080.79	0.55

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	11,939,553,322.95
卖出股票收入（成交）总额	14,498,068,610.87

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	1,325,801,287.68	9.39
2	央行票据	—	—
3	金融债券	412,687,347.40	2.92
	其中：政策性金融债	146,628,136.99	1.04
4	企业债券	452,714,964.74	3.21
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	204,645,492.46	1.45
7	可转债（可交换债）	45,358,663.15	0.32
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—
10	其他	—	—
11	合计	2,441,207,755.43	17.30

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	200009	20 付息 国债 09	7,000,000	718,924,739.73	5.09
2	210008	21 付息 国债 08	5,000,000	504,028,630.14	3.57
3	210316	21 进出 16	1,400,000	146,628,136.99	1.04
4	200014	20 付息	1,000,000	102,847,917.81	0.73

		国债 14			
5	2128042	21 兴业 银行二 级 02	600,000	61,727,799.45	0.44

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截止本报告期末,本基金持有的股票资产 9,693,845,594.85 元,占基金资产净值的比例为 68.69%;运用股指期货进行对冲的空头合约市值-8,247,201,080.00 元,占基金资产净值的比例为-58.44%,运用股指期货进行对冲的空头合约市值占股票资产的比例为-85.08%。

本报告期内,本基金执行市场中性策略的投资收益为-39,685,839.50 元,公允价值变动损益为-379,669,425.78 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,兴业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、

中国进出口银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.13.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,003,055,009.03
2	应收清算款	538,953.82
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,003,593,962.85

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	32,372,461.06	0.23
2	113633	科沃转债	1,697,696.78	0.01
3	127024	盈峰转债	1,448,507.79	0.01

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

				比例 (%)		比例 (%)
汇添富绝对收益定开混合 A	82,319	104,823.36	2,395,286,451.35	27.76	6,233,667,827.92	72.24
汇添富绝对收益定开混合 C	16,343	101,975.32	41,488,021.89	2.49	1,625,094,551.68	97.51
合计	98,662	104,351.59	2,436,774,473.24	23.67	7,858,762,379.60	76.33

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 （%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富绝对收益定开混合 A	4,552,417.99	0.05
	汇添富绝对收益定开混合 C	18,722.54	0.00
	合计	4,571,140.53	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	汇添富绝对收益定开混合 A	0
	汇添富绝对收益定开混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富绝对收益定开混合 A	>100
	汇添富绝对收益定开混合 C	0
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,001,000.00 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 03 月 15 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富绝对收益定开混合 A	汇添富绝对收益定开混合 C
基金合同生效日 （2017 年 03 月 15 日）基金份额总额	493,313,864.49	—
本报告期期初基金份额总额	16,168,004,810.34	2,823,824,771.80
本报告期基金总申购份额	22,852,752.89	620,955.02
减：本报告期基金总赎回份额	7,561,903,283.96	1,157,863,153.25
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	8,628,954,279.27	1,666,582,573.57

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			(%)			
东方 证券	2	11,539,344,363.19	43.70	8,902,769.23	44.41	
中信 建投 证券	2	4,063,140,766.69	15.39	2,895,287.47	14.44	
天风 证券	2	2,472,913,317.30	9.36	1,886,521.88	9.41	
东方 财富	2	2,417,974,793.81	9.16	2,138,464.99	10.67	
开源 证券	2	1,663,992,360.27	6.30	1,184,039.25	5.91	
申万 宏源 证券	2	1,039,111,439.17	3.94	741,785.23	3.70	
海通 证券	2	973,284,912.59	3.69	697,455.37	3.48	
安信 证券	2	659,859,514.27	2.50	469,361.68	2.34	
广发 证券	4	555,622,802.96	2.10	400,446.73	2.00	
国泰 君安	2	434,973,559.33	1.65	311,812.78	1.56	
中信 证券	2	249,207,697.18	0.94	179,739.92	0.90	
国信 证券	2	226,930,617.13	0.86	161,419.50	0.81	
国金 证券	2	110,369,335.69	0.42	78,504.66	0.39	
北京 高华	2	-	-	-	-	
财达 证券	2	-	-	-	-	
德邦 证券	2	-	-	-	-	
东北 证券	2	-	-	-	-	
华安 证券	2	-	-	-	-	
华泰 证券	1	-	-	-	-	
民生 证券	2	-	-	-	-	
招商	3	-	-	-	-	

证券						
中原 证券	2	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
东方证券	202,524,587.19	93.47	200,000,000.00	41.67	-	-	-	-
中信建投证券	1,980,219.78	0.91	280,000,000.00	58.33	-	-	-	-
天风证券	317,153.90	0.15	-	-	-	-	-	-
东方财富	10,507,218.08	4.85	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万	-	-	-	-	-	-	-	-

宏源 证券								
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	537,190.68	0.25	-	-	-	-	-	-
中信 证券	813,982.19	0.38	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京 高华	-	-	-	-	-	-	-	-
财达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华 安 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华 泰 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
民 生 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招 商 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中 原 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用, 基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定, 同一基金管理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 3 家证券公司的 5 个交易单元: 华安证券(上交所单元, 深交所单元)、民生证券(上交所单元, 深交所单元)、招商证券(新三板单元)。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金重大关联交易事项的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 16 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 21 日
6	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
7	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金重大关联交易事项的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 29 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 21 日

	金重大关联交易事项的公告		
9	关于汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金第十次开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金在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