

中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59
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	59

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证上海国企 ETF
场内简称	上海国企
基金主代码	510810
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016 年 07 月 28 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	8,286,093,710.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 08 月 29 日

注：扩位证券简称：上海国企 ETF。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证上海国企指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 姓名	李鹏	郭明

负责人	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		李文	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日 - 2022年06月30日)
本期已实现收益	-145,945,946.24
本期利润	-493,670,233.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0597
本期加权平均净值利润率	-7.13%
本期基金份额净值增长率	-6.80%
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	-1,342,557,182.28
期末可供分配基金份额利润	-0.1620
期末基金资产净值	6,943,536,527.72
期末基金份额净值	0.8380
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	-13.70%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收

益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

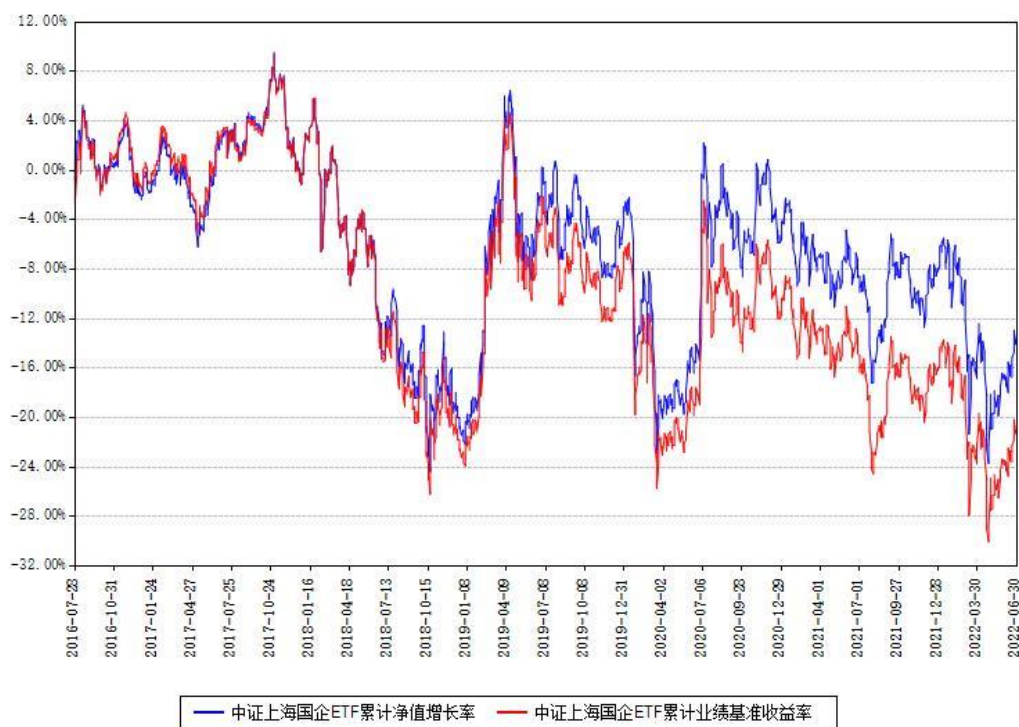
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.27%	1.02%	3.11%	1.02%	0.16%	0.00%
过去三个月	1.63%	1.52%	1.49%	1.53%	0.14%	-0.01%
过去六个月	-6.80%	1.52%	-6.49%	1.52%	-0.31%	0.00%
过去一年	-5.78%	1.23%	-7.22%	1.24%	1.44%	-0.01%
过去三年	-11.85%	1.20%	-17.32%	1.21%	5.47%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-13.70%	1.15%	-20.97%	1.16%	7.27%	-0.01%

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

中证上海国企ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016年07月28日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2016 年 07 月 28 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

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

				<p>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。</p>
--	--	--	--	--

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,国内外风险事件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,受益于经济修复的消费板块整体表现出色。

中证上海国企指数是聚焦上海地方国有企业属性的指数产品,在今年市场回调过程中,较好的体现了国有企业经营稳健的防御特性。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-6.80%。同期业绩比较基准收益率为-6.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年是全国国有企业改革三年行动方案的收官之年,今年国企上市公司整体表现强于市场整体,上海地方国有企业上市公司整体经营稳健,估值较低,当前又处在国企改革预期较强的时间阶段,上海地方国企相关上市公司也迎来较好的投资前景。

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:本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 06 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	84,222,164.22	21,548,739.40
结算备付金		1,140.85	36,122.89
存出保证金		22,177.60	71,205.88
交易性金融资产	6.4.7.2	6,863,281,861.64	7,395,013,421.19
其中：股票投资		6,863,281,861.64	7,395,013,421.19
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		2,297.40	-
应收股利		102,400.20	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	33,257.40	22,680.81
资产总计		6,947,665,299.31	7,416,692,170.17
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,504,546.48	2,807,685.91
应付托管费		556,565.89	623,930.20
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,426.06	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,064,233.16	779,187.46
负债合计		4,128,771.59	4,210,803.57
净资产:			
实收基金	6.4.7.8	8,286,093,710.00	8,244,093,710.00
未分配利润	6.4.7.9	-1,342,557,182.28	-831,612,343.40
净资产合计		6,943,536,527.72	7,412,481,366.60
负债和净资产总计		6,947,665,299.31	7,416,692,170.17

注：报告截止日2022年06月30日，基金份额净值0.8380元，基金份额总额8,286,093,710.00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：中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日	上年度可比期间 2021年01月01日
-----	-----	-------------------	------------------------

		至 2022 年 06 月 30 日	至 2021 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-473,619,674.87	-379,124,914.98
1. 利息收入		1,276,259.35	1,205,430.45
其中：存款利息收入	6.4.7.10	42,785.20	217,577.76
债券利息收入		-	7,136.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		1,233,474.15	980,715.81
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-127,179,611.58	-97,007,539.72
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-152,009,296.32	-153,748,973.81
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-13,942.98
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	24,829,684.74	56,755,377.07
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	-347,724,287.60	-282,358,470.71
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	7,964.96	-964,335.00
减：二、营业总支出		20,050,558.97	28,996,796.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	15,472,058.20	19,993,996.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,438,235.12	4,443,110.32
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		4,440.72	-
8. 其他费用	6.4.7.21	1,135,824.93	4,559,689.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-493,670,233.84	-408,121,711.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-493,670,233.84	-408,121,711.71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-493,670,233.84	-408,121,711.71

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：中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	8,244,093,710.00	-831,612,343.40	7,412,481,366.60
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	8,244,093,710.00	-831,612,343.40	7,412,481,366.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	42,000,000.00	-510,944,838.88	-468,944,838.88
（一）、综合收益总额	-	-493,670,233.84	-493,670,233.84
（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）	42,000,000.00	-17,274,605.04	24,725,394.96
其中：1. 基金申购款	178,000,000.00	-38,097,571.94	139,902,428.06
2. 基金赎回款	-136,000,000.00	20,822,966.90	-115,177,033.10
（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)	8,286,093,710.00	-1,342,557,182.28	6,943,536,527.72
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)	10,918,093,710.00	-778,538,677.71	10,139,555,032.29
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	10,918,093,710.00	-778,538,677.71	10,139,555,032.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,772,000,000.00	-233,451,878.36	-2,005,451,878.36
（一）、综合收益总额	-	-408,121,711.71	-408,121,711.71
（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）	-1,772,000,000.00	174,669,833.35	-1,597,330,166.65
其中：1. 基金申购款	655,000,000.00	-65,393,105.17	589,606,894.83
2. 基金赎回款	-2,427,000,000.00	240,062,938.52	-2,186,937,061.48
（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)	9,146,093,710.00	-1,011,990,556.07	8,134,103,153.93

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

中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1265 号文《关于准予中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公

司向社会公开发行募集，基金合同于 2016 年 7 月 28 日正式生效，首次设立募集规模为 15,220,091,004.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

2019 年 7 月 8 日，中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，会议审议通过了《关于中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并有关事项的议案》，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2019 年 8 月 28 日起，《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》失效，在份额转换基准日登记在册的上海改革发展 ETF 的基金份额持有人成为上海国企 ETF 的基金份额持有人，并成为《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的当事人。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、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、中小企业私募债券、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、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）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）。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为：中证上海国企指数。

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 21,548,739.40 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,123.97 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 21,550,863.37 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 36,122.89 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 16.30 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，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 36,139.19 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 71,205.88 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 32.10 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 71,237.98 元。

其他资产于 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 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 20,508.44 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，其他资产于 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 20,508.44 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 22,680.81 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 2,123.97 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 16.30 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 32.10 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 20,508.44 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

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

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

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

2. 增值税

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

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，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	84,222,164.22
等于: 本金	84,215,770.82
加: 应计利息	6,393.40

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	84,222,164.22

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	7,981,526,564. 93	-	6,863,281,861.64	-1,118,244,70 3.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,981,526,564. 93	-	6,863,281,861.64	-1,118,244,70 3.29

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应收利息	-
其他应收款	33,257.40
待摊费用	-
合计	33,257.40

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	379,083.30
其中：交易所市场	379,083.30
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	124,630.98
应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	501,011.51
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	1,064,233.16

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,244,093,710.00	8,244,093,710.00
本期申购	178,000,000.00	178,000,000.00
本期赎回（以“-”号	-136,000,000.00	-136,000,000.00

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	8,286,093,710.00	8,286,093,710.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-30,907,438.12	-800,704,905.28	-831,612,343.40
本期利润	-145,945,946.24	-347,724,287.60	-493,670,233.84
本期基金份额交易产生的变动数	-457,635.24	-16,816,969.80	-17,274,605.04
其中：基金申购款	-2,374,684.89	-35,722,887.05	-38,097,571.94
基金赎回款	1,917,049.65	18,905,917.25	20,822,966.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-177,311,019.60	-1,165,246,162.68	-1,342,557,182.28

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	38,012.04
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	4,512.97
其他	260.19
合计	42,785.20

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-133,478,981.35
股票投资收益——赎回差价收入	-18,530,314.97

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-152,009,296.32

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	694,425,381.11
减：卖出股票成本总额	826,131,270.02
减：交易费用	1,773,092.44
买卖股票差价收入	-133,478,981.35

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
赎回基金份额对价总额	115,177,033.10
减：现金支付赎回款总额	427,327.10
减：赎回股票成本总额	133,280,020.97
减：交易费用	-
赎回差价收入	-18,530,314.97

6.4.7.11.4 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	24,829,684.74
其中：证券出借权益补偿收入	974,955.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	24,829,684.74

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	-347,724,287.60
——股票投资	-347,724,287.60
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-347,724,287.60

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	7,964.96
其他	-

合计	7,964.96
----	----------

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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	216.00
指数使用费	1,031,470.58
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	1,135,824.93

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东

东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
--------------	----------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 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	1,294,089,393.76	100.00	2,110,729,608.92	100.00

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	-	-	43,409,193.90	100.00

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	925,486.01	100.00	379,083.30	100.00
关联方名	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日			

称	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	1,965,715.86	100.00	817,473.82	100.00

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	15,472,058.20	19,993,996.45
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.45%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年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	3,438,235.12	4,443,110.32

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送

基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位:人民币元

本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	10,683,075.00	7,484.32	919,121.00	129.69
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	3,911,736.00	2,642.30	-	-

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:本基金本报告期末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

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(2016 年 07 月 28 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	9,297,348.00
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	-	9,297,348.00
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 (%)	-	-
-------------------------	---	---

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 06 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
上海上报资产管理有限公司	18,594,696.00	0.22	18,594,696.00	0.23

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
工商银行	84,222,164.22	38,012.04	57,675,925.96	203,343.41

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 股)	总金额
东方证券承销保荐有限公司	600958	东方证券	原股东优先配售	3,417,635.00	28,913,192.10
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 股)	总金额
				-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金根据基金合同和招募书约定的投资策略，按照标的指数的成分股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理人的股东东方证券发行的股票东方证券。于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 14,522,175.00 股。（于上年度可比期间，本基金按照指数权重比例持有东方证券 13,940,240.00 股。）

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。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
688209	英集芯	2022 年 04 月 12 日	6 个月	新股流通受限	24.23	27.58	6,822	165,297.06	188,150.76	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

名称	日期	受限类型	单价	位：张)					
			-	-	-	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日		期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额
1	600773	西藏城投	2022年07月04日	2022年07月11日	19.70	533,900	10,517,830.00
2	600621	华鑫股份	2022年07月04日	2022年07月11日	14.52	677,100	9,831,492.00
3	600827	百联股份	2022年07月04日	2022年07月11日	13.21	698,900	9,232,469.00
4	600820	隧道股份	2022年07月04日	2022年07月11日	6.12	1,417,400	8,674,488.00
5	600648	外	2022	2022	13.60	560,300	7,620,080.00

		高桥	年 07 月 04 日	年 07 月 11 日			
6	600170	上海建 工	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	3.03	1,959,000	5,935,770.00
7	600748	上实发 展	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	3.70	1,219,300	4,511,410.00
8	603881	数据港	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	26.85	164,200	4,408,770.00
9	600662	外服控 股	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	6.75	639,600	4,317,300.00
10	600835	上海机 电	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	13.73	314,000	4,311,220.00
11	600675	中华企 业	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	3.06	1,311,500	4,013,190.00
12	600848	上海临 港	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	13.56	293,000	3,973,080.00
13	600623	华谊集 团	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	8.30	474,800	3,940,840.00
14	600708	光明地 产	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	2.47	1,502,700	3,711,669.00
15	600073	上海梅 林	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	7.97	456,200	3,635,914.00
16	600284	浦	2022	- 2022	7.41	463,000	3,430,830.00

		东建设	年 07 月 11 日	年 07 月 11 日			
17	600278	东方创业	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	7.55	416,300	3,143,065.00
18	600618	氯碱化工	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	12.50	250,200	3,127,500.00
19	600616	金枫酒业	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	7.53	384,500	2,895,285.00
20	600602	云赛智联	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	7.16	401,500	2,874,740.00
21	600604	市北高新	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	5.84	466,900	2,726,696.00
22	600626	申达股份	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 11 日	4.00	581,100	2,324,400.00
23	600612	老凤祥	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	41.78	50,700	2,118,246.00
24	600826	兰生股份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	8.22	253,200	2,081,304.00
25	600895	张江高科	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	12.45	166,500	2,072,925.00
26	600649	城投控股	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	4.28	468,400	2,004,752.00
27	600637	东	2022	- 2022	7.15	279,700	1,999,855.00

		方明珠	年 07 月 11 日	年 07 月 11 日			
28	600639	浦东金桥	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	13.59	147,100	1,999,089.00
29	600663	陆家嘴	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	10.36	188,900	1,957,004.00
30	600846	同济科技	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	7.90	246,500	1,947,350.00
31	600825	新华传媒	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	3.97	489,000	1,941,330.00
32	600676	交运股份	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	4.20	418,200	1,756,440.00
33	600822	上海物贸	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	8.44	134,600	1,136,024.00
34	600692	亚通股份	2022 年 07 月 04 日	- 2022 年 07 月 04 日	6.10	120,700	736,270.00
35	600838	上海九百	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	7.37	86,500	637,505.00
36	601229	上海银行	2022 年 07 月 11 日	- 2022 年 07 月 11 日	6.55	10,000	65,500.00
合计	-	-	-	-	-	18,245,400	131,611,632.00

注：出借证券中如有其它流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内

容。

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 2022 年06 月30 日	1个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	84,222,164.22	-	-	-	-	-	84,222,164.22
结算 备付 金	1,140.85	-	-	-	-	-	1,140.85
存出 保证 金	22,177.60	-	-	-	-	-	22,177.60
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	6,863,281,861.64	6,863,281,861.64
衍生 金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	2,297.40	2,297.40
应收股利	-	-	-	-	-	102,400.20	102,400.20
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	33,257.40	33,257.40
资产总计	84,245,482.67	-	-	-	-	6,863,419,816.64	6,947,665,299.31
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,504,546.48	2,504,546.48
应付托管费	-	-	-	-	-	556,565.89	556,565.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	3,426.06	3,426.06
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,064,233.16	1,064,233.16
负债总计	-	-	-	-	-	4,128,771.59	4,128,771.59
利率敏感度缺口	84,245,482.67	-	-	-	-	6,859,291,045.05	6,943,536,527.72
上年度末2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,548,739.40	-	-	-	-	-	21,548,739.40
结算备付金	36,122.89	-	-	-	-	-	36,122.89
存出	71,205.88	-	-	-	-	-	71,205.88

保证金							
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,395,013,421.19	7,395,013,421.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	22,680.81	22,680.81
资产总计	21,656,068.17	-	-	-	-	7,395,036,102.00	7,416,692,170.17
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
款							
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,807,685.91	2,807,685.91
应付托管费	-	-	-	-	-	623,930.20	623,930.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	779,187.46	779,187.46
负债总计	-	-	-	-	-	4,210,803.57	4,210,803.57
利率敏感度缺口	21,656,068.17	-	-	-	-	7,390,825,298.43	7,412,481,366.60

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股, 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	6,863,281,861.64	98.84	7,395,013,421.19	99.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,863,281,861.64	98.84	7,395,013,421.19	99.76

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%, 因法律法规的规定而受限制的情形除外。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
	中证上海国企指数上涨 5%	343,770,537.66	363,366,117.30
	中证上海国企指数下跌 5%	-343,770,537.66	-363,366,117.30

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	6,863,093,710.88
第二层次	-
第三层次	188,150.76
合计	6,863,281,861.64

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	6,863,281,861.64	98.79
	其中：股票	6,863,281,861.64	98.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	84,223,305.07	1.21
8	其他各项资产	160,132.60	0.00
9	合计	6,947,665,299.31	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 131,611,632.00 元，占期末基金资产净值比例 1.90%。

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	4,854,054.00	0.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,526,176,548.02	21.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	167,162,848.72	2.41
E	建筑业	372,149,628.40	5.36
F	批发和零售业	342,485,152.35	4.93

G	交通运输、仓储和邮政业	1,252,946,896.55	18.04
H	住宿和餐饮业	271,804,360.60	3.91
I	信息传输、软件和信息技术服务业	134,879,488.50	1.94
J	金融业	1,764,468,849.72	25.41
K	房地产业	910,760,333.09	13.12
L	租赁和商务服务业	36,394,198.02	0.52
M	科学研究和技术服务业	9,838,401.30	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	26,526,784.64	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	41,212,685.13	0.59
S	综合	-	-
	合计	6,861,660,229.04	98.82

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	1,067,436.82	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,513.78	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	524,682.00	0.01
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,621,632.60	0.02

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	600009	上海机场	10,866,711	616,142,513.70	8.87
2	601601	中国太保	25,012,695	588,548,713.35	8.48
3	600104	上汽集团	30,097,785	536,041,550.85	7.72
4	600018	上港集团	88,213,730	514,286,045.90	7.41
5	600741	华域汽车	18,646,975	428,880,425.00	6.18
6	600000	浦发银行	45,207,340	362,110,793.40	5.22
7	600754	锦江酒店	4,321,214	271,804,360.60	3.91
8	600848	上海临港	19,610,552	265,919,085.12	3.83
9	601727	上海电气	51,422,814	211,347,765.54	3.04
10	601211	国泰君安	13,297,868	202,127,593.60	2.91
11	600606	绿地控股	50,092,478	198,366,212.88	2.86
12	600663	陆家嘴	18,354,861	190,156,359.96	2.74
13	600642	申能股份	29,430,079	167,162,848.72	2.41
14	600837	海通证券	16,926,509	166,049,053.29	2.39
15	600958	东方证券	14,522,175	148,271,406.75	2.14
16	601229	上海银行	22,272,392	145,884,167.60	2.10
17	601607	上海医	7,123,040	128,784,563.20	1.85

		药			
18	600675	中华企业	41,240,266	126,195,213.96	1.82
19	600827	百联股份	8,969,278	118,484,162.38	1.71
20	600895	张江高科	9,486,516	118,107,124.20	1.70
21	600637	东方明珠	13,210,638	94,456,061.70	1.36
22	600170	上海建工	28,814,151	87,306,877.53	1.26
23	601825	沪农商行	13,826,103	86,689,665.81	1.25
24	600662	外服控股	10,527,827	71,062,832.25	1.02
25	600597	光明乳业	5,332,421	67,348,477.23	0.97
26	600621	华鑫股份	4,461,946	64,787,455.92	0.93
27	600773	西藏城投	3,177,671	62,600,118.70	0.90
28	600820	隧道股份	9,262,799	56,688,329.88	0.82
29	600623	华谊集团	6,818,213	56,591,167.90	0.82
30	600649	城投控股	10,598,168	45,360,159.04	0.65
31	600835	上海机电	3,225,668	44,288,421.64	0.64
32	600648	外高桥	3,102,075	42,188,220.00	0.61
33	600639	浦东金桥	2,774,452	37,704,802.68	0.54
34	600651	飞乐音响	9,405,200	37,150,540.00	0.54
35	600612	老凤祥	777,578	32,487,208.84	0.47
36	600826	兰生股份	3,397,391	27,926,554.02	0.40
37	601200	上海环境	2,610,904	26,526,784.64	0.38
38	601595	上海电影	2,311,334	25,910,054.14	0.37
39	600748	上实发展	6,754,024	24,989,888.80	0.36

40	603881	数据港	912,628	24,504,061.80	0.35
41	600841	动力新科	2,776,017	24,040,307.22	0.35
42	600834	申通地铁	2,259,766	22,597,660.00	0.33
43	600278	东方创业	2,983,756	22,527,357.80	0.32
44	600708	光明地产	8,320,545	20,551,746.15	0.30
45	600073	上海梅林	2,527,100	20,140,987.00	0.29
46	600284	浦东建设	2,565,271	19,008,658.11	0.27
47	600618	氯碱化工	1,385,329	17,316,612.50	0.25
48	600616	金枫酒业	2,127,741	16,021,889.73	0.23
49	600602	云赛智联	2,223,375	15,919,365.00	0.23
50	600825	新华传媒	3,854,567	15,302,630.99	0.22
51	600604	市北高新	2,585,522	15,099,448.48	0.22
52	600626	申达股份	3,217,600	12,870,400.00	0.19
53	600650	锦江在线	902,195	11,927,017.90	0.17
54	600846	同济科技	1,364,500	10,779,550.00	0.16
55	600629	华建集团	1,338,558	9,838,401.30	0.14
56	600676	交运股份	2,316,244	9,728,224.80	0.14
57	600819	耀皮玻璃	1,732,630	8,957,697.10	0.13
58	603648	畅联股份	906,600	8,467,644.00	0.12
59	600119	长江投资	1,109,800	7,202,602.00	0.10
60	600824	益民集团	1,844,808	6,936,478.08	0.10
61	600628	新世界	900,342	6,878,612.88	0.10
62	600822	上海物	745,782	6,294,400.08	0.09

		贸			
63	600097	开创国际	493,800	4,854,054.00	0.07
64	600833	第一医药	442,455	4,729,843.95	0.07
65	600619	海立股份	687,672	4,662,416.16	0.07
66	600692	亚通股份	668,260	4,076,386.00	0.06
67	600679	上海凤凰	346,600	3,621,970.00	0.05
68	600838	上海九百	478,254	3,524,731.98	0.05
69	600630	龙头股份	478,414	2,860,915.72	0.04
70	600272	开开实业	209,900	2,136,782.00	0.03
71	600843	上工申贝	286,099	1,547,795.59	0.02

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	688107	安路科技	7,821	537,302.70	0.01
2	688105	诺唯赞	6,180	524,682.00	0.01
3	688553	汇宇制药	8,928	216,861.12	0.00
4	688209	英集芯	6,822	188,150.76	0.00
5	688150	莱特光电	5,626	125,122.24	0.00
6	603071	物产环能	1,627	29,513.78	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	601601	中国太保	94,610,033.00	1.28
2	601825	沪农商行	89,016,225.28	1.20

3	600958	东方证券	78,984,003.10	1.07
4	600837	海通证券	36,725,519.11	0.50
5	600018	上港集团	35,954,799.06	0.49
6	600104	上汽集团	35,505,108.18	0.48
7	600662	外服控股	30,630,607.00	0.41
8	600642	申能股份	29,190,624.92	0.39
9	600773	西藏城投	28,236,760.20	0.38
10	601211	国泰君安	21,382,594.57	0.29
11	600827	百联股份	20,177,275.04	0.27
12	600848	上海临港	18,958,753.80	0.26
13	600841	动力新科	15,574,369.00	0.21
14	600754	锦江酒店	12,064,666.00	0.16
15	600000	浦发银行	10,943,128.00	0.15
16	600606	绿地控股	8,551,060.00	0.12
17	603881	数据港	6,894,963.62	0.09
18	600623	华谊集团	5,540,855.00	0.07
19	600748	上实发展	5,484,723.00	0.07
20	600616	金枫酒业	3,871,824.00	0.05

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	600741	华域汽车	101,058,158.40	1.36
2	600009	上海机场	90,350,013.06	1.22
3	600606	绿地控股	39,062,085.12	0.53
4	600170	上海建工	38,678,000.00	0.52
5	600827	百联股份	38,650,386.54	0.52
6	600675	中华企业	25,481,566.75	0.34
7	600000	浦发银行	25,447,124.69	0.34
8	600820	隧道股份	25,392,619.00	0.34
9	600018	上港集团	21,734,342.00	0.29
10	600637	东方明珠	17,099,476.42	0.23
11	600623	华谊集团	16,438,472.44	0.22
12	603881	数据港	14,433,947.00	0.19
13	600648	外高桥	13,419,776.32	0.18
14	600621	华鑫股份	12,741,004.22	0.17
15	600649	城投控股	12,554,627.99	0.17
16	600651	飞乐音响	12,398,577.00	0.17
17	600104	上汽集团	11,835,785.08	0.16

18	600639	浦东金桥	11,221,772.00	0.15
19	600754	锦江酒店	10,827,889.00	0.15
20	601229	上海银行	9,862,589.30	0.13

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	637,310,579.04
卖出股票收入（成交）总额	694,425,381.11

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

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，上海浦东发展银行股份有限公司、上海电气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	22,177.60
2	应收清算款	2,297.40
3	应收股利	102,400.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	33,257.40
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	160,132.60

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600848	上海临港	3,973,080.00	0.06	转融通出借流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688209	英集芯	188,150.76	0.00	新股流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国工商银行股份有限公司—中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
2,066	4,010,693.95	8,237,497,174.00	99.41	48,596,536.00	0.59	207,212,150.00	2.50

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例 （%）
1	申能(集团)有限公司	1,627,624,800.00	19.64
2	上海华谊(集团)公司	1,579,005,316.00	19.06
3	上海城投(集团)有限公司	1,572,000,000.00	18.97
4	光明食品(集团)有限公司	839,022,608.00	10.13
5	东浩兰生会展集团股份有限公司	533,142,171.00	6.43
6	上海久事(集团)有限公司	506,797,072.00	6.12
7	申能股份有限公司	386,445,550.00	4.66
8	上海电气(集团)总公司	319,365,667.00	3.85
9	上海燃气(集团)有限公司	180,000,000.00	2.17
10	东方国际(集团)有限公司	179,340,120.00	2.16
11	中国工商银行股份有限公司—中证上海国企交易	207,212,150.00	2.50

	型开放式指数证 券投资基金联接 基金		
--	--------------------------	--	--

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,000.00	0.00

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年07月28日） 基金份额总额	15,220,091,004.00
本报告期期初基金份额总额	8,244,093,710.00
本报告期基金总申购份额	178,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	136,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,286,093,710.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	4	1,294,089,393.76	100.00	925,486.01	100.00	
安信证券	2	-	-	-	-	
北京高华	1	-	-	-	-	
财信证券	1	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
东吴证券	2	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
方正	1	-	-	-	-	

证券						
光大证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国都证券	1	-	-	-	-	
国金证券	2	-	-	-	-	
国泰君安	2	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
海通证券	2	-	-	-	-	
华融证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
华鑫证券	3	-	-	-	-	
上海证券	1	-	-	-	-	
申万宏源证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	2	-	-	-	-	
银河证券	3	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
中金财富	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	2	-	-	-	-	
中信建投证券	1	-	-	-	-	
中信	1	-	-	-	-	

证券						
中银国际	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 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

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

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 2 个交易单元:华鑫证券(深交所单元,上交所单元);

不再租用 1 家证券公司的 1 个交易单元:中信证券华南(深交所单元)。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加开源证券为申购赎回代理券商的公告	上交所,上证报,公司网站,深交所,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 08 日
4	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
5	汇添富基金管理股份有限公司旗	上交所,公司网站,深	2022 年 04 月 01 日

	下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	交所, 中国证监会基金电子披露网站	
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旗下的上海证券交易所 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 20 日

§ 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、中国证监会批准中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
- 2、《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
- 3、《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5、报告期内中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告;
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 或登录基金管理人网站 www.99fund.com 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