

# 中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                               |    |
|-----------------------------------------------|----|
| § 1 重要提示及目录 .....                             | 2  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2  |
| 1.2 目录 .....                                  | 3  |
| § 2 基金简介 .....                                | 5  |
| 2.1 基金基本情况 .....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明 .....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 6  |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 .....                       | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7  |
| § 4 管理人报告 .....                               | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 14 |
| 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 ..... | 15 |
| 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....       | 15 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....                     | 15 |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 15 |
| 6.2 利润表 .....                                 | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 18 |
| 6.4 报表附注 .....                                | 19 |
| § 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 .....                    | 53 |
| 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 .....                     | 58 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 60 |
| 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 .....      | 60 |
| 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 .....   | 60 |
| 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 .....   | 60 |
| 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 .....      | 60 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....           | 60 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....           | 60 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                       | 60 |
| § 8 基金份额持有人信息 .....                      | 62 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 62 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人.....                    | 62 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 63 |
| 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.....    | 63 |
| § 9 开放式基金份额变动 .....                      | 64 |
| § 10 重大事件揭示 .....                        | 64 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 64 |
| 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.....    | 64 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 64 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                      | 65 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 65 |
| 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.....       | 65 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....              | 65 |
| 10.8 其他重大事件.....                         | 69 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 70 |
| 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..... | 70 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 71 |
| § 12 备查文件目录 .....                        | 71 |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 71 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 72 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 72 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|               |                      |
|---------------|----------------------|
| 基金名称          | 中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称          | 汇添富中证主要消费 ETF        |
| 场内简称          | 消费 ETF               |
| 基金主代码         | 159928               |
| 基金运作方式        | 交易型开放式               |
| 基金合同生效日       | 2013 年 08 月 23 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） | 6,736,629,040.00     |
| 基金合同存续期       | 不定期                  |
| 基金份额上市的证券交易所  | 深圳证券交易所              |
| 上市日期          | 2013 年 09 月 16 日     |

注：本基金扩位证券简称为消费 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最小化。                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 投资策略   | 本基金主要采取完全复制法，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动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，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。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 业绩比较基准 | 中证主要消费指数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场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   |      | 上海市富城路99号震旦国际大楼20楼          | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 邮政编码   |      | 200120                      | 100140              |
| 法定代表人  |      | 李文                          | 陈四清                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                  |
|---------------------|----------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》                          |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.99fund.com                   |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 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(2021年01月01日 - 2021年06月30日) |
|---------------|--------------------------------|
| 本期已实现收益       | 795,512,660.22                 |
| 本期利润          | -263,930,772.92                |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1469                        |
| 本期加权平均净值利润率   | -3.13%                         |
| 本期基金份额净值增长率   | -3.36%                         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年06月30日)              |
| 期末可供分配利润      | 4,194,288,239.05               |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.6226                         |
| 期末基金资产净值      | 8,488,533,971.74               |
| 期末基金份额净值      | 1.2601                         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021年06月30日)              |
| 基金份额累计净值增长率   | 404.04%                        |

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       | -5.65%   | 1.23%       | -6.03%     | 1.23%         | 0.38%  | 0.00%  |
| 过去三个月       | 3.84%    | 1.40%       | 3.24%      | 1.41%         | 0.60%  | -0.01% |
| 过去六个月       | -3.36%   | 1.90%       | -3.87%     | 1.91%         | 0.51%  | -0.01% |
| 过去一年        | 35.52%   | 1.79%       | 34.57%     | 1.80%         | 0.95%  | -0.01% |
| 过去三年        | 123.54%  | 1.74%       | 116.40%    | 1.75%         | 7.14%  | -0.01% |
| 自基金合同生效日起至今 | 404.04%  | 1.67%       | 387.74%    | 1.68%         | 16.30% | -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

汇添富中证主要消费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（2013 年 08 月 23 日）起 3 个月，建仓期结束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，公司注册资本金为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。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 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，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。

2021 上半年，汇添富基金新成立 21 只公开募集证券投资基金，包括 7 只股票型基金、13 只混合型基金、1 只债券型基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 189 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 |           |                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 过蓓蓓 | 本基金的基金经理 | 2015 年 08 月 03 日 |      | 10        | 国籍:中国。学历:中国科学技术大学金融工程博士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今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。2015 年 8 月 3 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今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。2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 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生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 12 月 29 日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 10 月 23 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指</p> |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 4 月 15 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业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嵌入式全流程管控模式实现了不同组合之间公平交易的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人进一步完善了公司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、投资策略及投资品种。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，本基金管理人对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合采用了交易系统内的公平交易模块进行操作，实现事前和事中公平交易的管控。

三、对不同投资组合进行了同向交易价差分析，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溢价率进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，再根据交易价格、交易频率、交易数量和交易时间进行了具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、根据交易价格、交易频率、交易数量等对不同组合之间的反向交易进行了综合分析。

通过上述管控措施的有效落实，本报告期内，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易，也未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

### 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，本公司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 14 次，投资组合经理因投资组合的投资策略与其他组合发生同日反向交易，相关交易事前严格根据公司内部规定进行审批，事后对其交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现可能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

2021 年上半年市场风格剧烈，春节前延续 2020 年大盘成长风格，春节后阶段性切换为周期价值，二季度又切换为中小盘成长。市场整体活跃度较 2020 年提升，成交量屡超万亿，港股市场在一季度也迎来大量南下资金增持。

国内资金面从紧到松，而海外美国 10 年期国债收益率也由升转为缓降，二季度初美债

利率企稳，长端利率回落。虽然原材料价格上涨，造成通胀上升的预期，但上半年货币整体保持宽松，主要是因为各个经济体对于经济复苏持续性保持怀疑，疫情也间断发生，使得各国央行并没有快速收紧流动性的动力。

A 股板块分化明显，前些年机构重仓的消费、医药板块分歧加大，上半年波动增加。而以新能源、新能源车、芯片为代表的科技成长板块获得资金的偏好，涨幅较大。究其原因，稳健、确定性为特征的行业在过去几年估值水平提高较多，机构持仓风格也较多的偏向此类行业，而当疫情造成流动性宽松并带来高弹性复苏时，这些行业对新资金的吸引力明显弱于估值尚不高、业绩预期高增长的成长股。于是，在 2021 年上半年演绎了极致的持仓调整。尤其是当新产业趋势、国家政策支持、全球需求启动三重因素叠加影响时，无论是从逻辑还是基本面上，似乎都印证了需要配置的理由，当市场资金不那么紧缺时，对于趋势的跟随程度会更加激烈。

半年度末再看消费、医药板块，其估值水平回到近 5 年 70%分位数，而新能源、芯片则从 30%分位数回到近 10 年 80%分位数左右。如果考虑各行业盈利预期，则医药、新能源、芯片市盈率水平相近，高于消费行业估值，而消费行业市盈率则接近其历史上相对舒适的区域。虽然估值分位数并不完全是一个有投资逻辑和投资价值的参考指标，指数成分在 10 年里的变动使得历史并不具备绝对的参考意义，但是估值高低在一定程度上反映了投资者的风险偏好，是选择高景气板块还是选择稳健确定性板块。

中证主要消费行业指数上半年下跌 3.87%。报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内基本保持在 95%~100%之间，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-3.36%。同期业绩比较基准收益率为-3.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然特殊时期的宽松政策未来会在一定程度上退出，但经济体对流动性的依赖在一次次的宽松中越来越强，因此，这种退出将会是很缓慢和充满博弈的过程。政府对于预期的管理、市场的反应、经济指标的变化将互相产生影响。对于下半年的投资环境，总体可以保持一定乐观态度，但需要紧密跟踪当前高景气板块的成长性和盈利能力的预期变化，以及这些板块与上半年调整板块之间投资性价比的变化，尤其是四季度市场资金寻求风格切换的特征一般较为明显。

但是，由产业逻辑驱动、国家政策支持的方向变化的概率极低，股价的涨跌也就会围绕

着产业成长带来的基本面价值中枢变动。从三年的维度来看当前高景气板块，也依然是一个值得布局的方向，只不过这其中的波动将会随着资金的涌入而加大。以一个更长的视角来决策自身的投资标的是较好的选择，另外，下半年从极致化配置单一行业主题逐渐切换至较为均衡的状态也是降低组合波动较好的思路。

对于消费行业，在估值风险在上半年逐渐消化，下半年主要关注其行业盈利增速预期是否会继续下调，猪价企稳后上市公司产能出清的速度如何。主要消费行业内需、刚需为主，对于信用、货币政策的变化不敏感，但是这两年疫情带来的全球冲击是过去十年不曾遇到的，这是消费复苏缓慢的重要原因。如果全球逐渐转变为类似常规传染性疾病的防控，全球开放重启，对于消费复苏或将是最大的刺激因素。

作为被动投资的交易所上市指数型基金，汇添富中证主要消费 ETF 将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。

#### 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 12 次，每次收益分配比例依据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的。

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，本基金托管人在对中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、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中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金 2021 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：中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |
|-----|-----|-----|------|
|-----|-----|-----|------|

|                 |            | 2021 年 06 月 30 日                | 2020 年 12 月 31 日                 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产:</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 59,970,090.62                   | 53,844,156.51                    |
| 结算备付金           |            | 1,555,907.78                    | 883,325.00                       |
| 存出保证金           |            | 787,879.17                      | 889,521.40                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 8,447,183,552.23                | 8,379,014,752.17                 |
| 其中: 股票投资        |            | 8,447,183,552.23                | 8,379,014,752.17                 |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | -                               | -                                |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 244,795.53                      | 34,020,964.17                    |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 245,484.04                      | 115,433.10                       |
| 应收股利            |            | 419,288.00                      | -                                |
| 应收申购款           |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 8,510,406,997.37                | 8,468,768,152.35                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 06 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                                 |                                  |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 15,156,855.88                   | 52,829,386.28                    |
| 应付赎回款           |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 3,440,506.29                    | 3,348,242.87                     |
| 应付托管费           |            | 688,101.27                      | 669,648.57                       |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 1,878,588.21                    | 2,913,425.15                     |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |
| 应付利息            |            | -                               | -                                |
| 应付利润            |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                               | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 708,973.98                      | 785,710.57                       |
| 负债合计            |            | 21,873,025.63                   | 60,546,413.44                    |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                 |                                  |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 1,684,157,260.00                | 1,612,157,260.00                 |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 6,804,376,711.74                | 6,796,064,478.91                 |

|            |  |                  |                  |
|------------|--|------------------|------------------|
| 所有者权益合计    |  | 8,488,533,971.74 | 8,408,221,738.91 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 8,510,406,997.37 | 8,468,768,152.35 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2601 元，基金份额总额 6,736,629,040.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2021 年 01 月 01 日<br>至 2021 年 06 月 30<br>日 | 上年度可比期间<br>2020 年 01 月 01 日至<br>2020 年 06 月 30 日 |
|------------------------|------------|-------------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |            | <b>-231,553,394.98</b>                          | <b>1,010,370,110.31</b>                          |
| 1. 利息收入                |            | 4,055,296.15                                    | 558,226.47                                       |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 152,259.65                                      | 146,869.86                                       |
| 债券利息收入                 |            | 2,290.27                                        | 1,667.71                                         |
| 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               |            | 3,900,746.23                                    | 409,688.90                                       |
| 其他利息收入                 |            | -                                               | -                                                |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 821,055,301.93                                  | 406,790,523.55                                   |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 756,962,776.36                                  | 327,879,982.42                                   |
| 基金投资收益                 | 6.4.7.13   | -                                               | -                                                |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.14   | 603,968.62                                      | 2,846,067.85                                     |
| 资产支持证券投资收益             | 6.4.7.14.2 | -                                               | -                                                |
| 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   | 63,488,556.95                                   | 76,064,473.28                                    |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18   | -1,059,443,433.14                               | 597,902,612.39                                   |
| 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   | 2,779,440.08                                    | 5,118,747.90                                     |
| <b>减：二、费用</b>          |            | <b>32,377,377.94</b>                            | <b>17,452,679.82</b>                             |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 21,006,273.02                                   | 10,503,949.12                                    |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 4,201,254.61                                    | 2,100,789.77                                     |
| 3. 销售服务费               |            | -                                               | -                                                |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.20   | 5,809,795.68                                    | 4,117,871.08                                     |
| 5. 利息支出                |            | -                                               | -                                                |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | -                                               | -                                                |
| 6. 税金及附加               |            | 8.23                                            | 6.01                                             |

|                     |          |                 |                |
|---------------------|----------|-----------------|----------------|
| 7. 其他费用             | 6.4.7.21 | 1,360,046.40    | 730,063.84     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | -263,930,772.92 | 992,917,430.49 |
| 减：所得税费用             |          | -               | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | -263,930,772.92 | 992,917,430.49 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日      |                   |                   |
|----------------------------------------|-----------------------------------------------|-------------------|-------------------|
|                                        | 实收基金                                          | 未分配利润             | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,612,157,260.00                              | 6,796,064,478.91  | 8,408,221,738.91  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                             | -263,930,772.92   | -263,930,772.92   |
| 三、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）      | 72,000,000.00                                 | 272,243,005.75    | 344,243,005.75    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 510,000,000.00                                | 2,154,640,375.95  | 2,664,640,375.95  |
| 2. 基金赎回款                               | -438,000,000.00                               | -1,882,397,370.20 | -2,320,397,370.20 |
| 四、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） | -                                             | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,684,157,260.00                              | 6,804,376,711.74  | 8,488,533,971.74  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 |                   |                   |
|                                        | 实收基金                                          | 未分配利润             | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,168,657,260.00                              | 2,363,125,724.08  | 3,531,782,984.08  |

|                                        |                  |                   |                   |
|----------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                | 992,917,430.49    | 992,917,430.49    |
| 三、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）      | 417,000,000.00   | 955,948,711.09    | 1,372,948,711.09  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 968,500,000.00   | 2,105,066,502.08  | 3,073,566,502.08  |
| 2. 基金赎回款                               | -551,500,000.00  | -1,149,117,790.99 | -1,700,617,790.99 |
| 四、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） | -                | -                 | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,585,657,260.00 | 4,311,991,865.66  | 5,897,649,125.66  |

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

中证主要消费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[2013]757 号文《关于核准中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（现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 2013 年 8 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 794,657,260.00 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为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括

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、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金的业绩比较基准为中证主要消费指数。

2021 年 6 月 24 日(拆分日),本基金注册登记机构对本基金进行了基金份额拆分。本基金本次基金份额拆分比例为 1:4,即每 1 份基金份额拆为 4 份。份额拆分日,本基金拆分前的场内基金份额总额为 1,662,657,260.00 份,场外基金份额总额为 0 份,拆分前基金份额净值为 4.9379 元;本基金拆分后,场内基金份额总额为 6,650,629,040.00 份,场外基金份额总额为 0 份,拆分后基金份额净值为 1.2345 元。本基金场内、场外的登记机构已分别按上述拆分比例对各基金份额持有人的本基金基金份额进行了拆分,并完成变更登记。

#### 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(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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 2 号《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 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

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。

#### 6.4.5 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

##### 6.4.6.1 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。

#### 6.4.6.2 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, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品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, 自 2018 年 1 月 1 日起, 本基金的基金管理人运营本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。对本基金在 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, 已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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。

#### 6.4.6.5 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<br>2021 年 06 月 30 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 59,970,090.62           |
| 定期存款           | —                       |
| 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           | —                       |
| 合计             | 59,970,090.62           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 06 月 30 日 |                  |                  |
|---------------|-------------------------|------------------|------------------|
|               | 成本                      | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票            | 7,229,516,449.34        | 8,447,183,552.23 | 1,217,667,102.89 |
| 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            | 7,229,516,449.34        | 8,447,183,552.23 | 1,217,667,102.89 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 06 月 30 日 |
|------------|-------------------------|
| 应收活期存款利息   | 6,029.44                |
| 应收定期存款利息   | -                       |
| 应收其他存款利息   | -                       |
| 应收结算备付金利息  | 741.66                  |
| 应收债券利息     | -                       |
| 应收资产支持证券利息 | -                       |
| 应收买入返售证券利息 | -                       |
| 应收申购款利息    | -                       |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       |
| 应收出借证券利息   | 238,393.89              |
| 其他         | 319.05                  |
| 合计         | 245,484.04              |

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 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 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 06 月 30 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,878,588.21            |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       |
| 合计          | 1,878,588.21            |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2021 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    | -                       |
| 应付审计费        | 39,671.58               |
| 应付信息披露费      | 59,507.37               |
| 应付指数使用费      | 609,795.03              |
| 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 | 708,973.98 |
|----|------------|

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,612,157,260.00                      | 1,612,157,260.00 |
| 本期申购          | 484,500,000.00                        | 484,500,000.00   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -434,000,000.00                       | -434,000,000.00  |
| 基金拆分/份额折算前    | 1,662,657,260.00                      | 1,662,657,260.00 |
| 基金拆分/份额折算调整   | 4,987,971,780.00                      | -                |
| 本期申购          | 102,000,000.00                        | 25,500,000.00    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -16,000,000.00                        | -4,000,000.00    |
| 本期末           | 6,736,629,040.00                      | 1,684,157,260.00 |

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金于 2021 年 6 月 24 日进行了份额拆分，基金拆分比例为 1:4。

#### 6.4.7.10 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           |
|----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 上年度末           | 3,233,910,802.23 | 3,562,153,676.68  | 6,796,064,478.91  |
| 本期利润           | 795,512,660.22   | -1,059,443,433.14 | -263,930,772.92   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 164,864,776.60   | 107,378,229.15    | 272,243,005.75    |
| 其中：基金申购款       | 1,127,819,490.13 | 1,026,820,885.82  | 2,154,640,375.95  |
| 基金赎回款          | -962,954,713.53  | -919,442,656.67   | -1,882,397,370.20 |
| 本期已分配利润        | -                | -                 | -                 |
| 本期末            | 4,194,288,239.05 | 2,610,088,472.69  | 6,804,376,711.74  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                                 |
|-----------|------------------------------------|
|           | 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 119,333.37                         |
| 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 | 26,244.74                          |
| 其他        | 6,681.54                           |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 152,259.65 |
|----|------------|

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 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<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 484,661,469.69                           |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 272,301,306.67                           |
| 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               | 756,962,776.36                           |

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|------------|------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,873,918,944.81                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,389,257,475.12                         |
| 买卖股票差价收入   | 484,661,469.69                           |

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|-------------|------------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 2,320,397,370.20                         |
| 减：现金支付赎回款总额 | 1,147,178,054.20                         |
| 减：赎回股票成本总额  | 900,918,009.33                           |
| 赎回差价收入      | 272,301,306.67                           |

##### 6.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|------------|------------------------------------------|
| 出借证券现金清偿总额 | —                                        |
| 减：出借证券成本总额 | —                                        |
| 减：应收证券出借利息 | —                                        |
| 证券出借差价收入   | —                                        |

#### 6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|------------------------|------------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 21,303,527.53                            |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 20,697,200.00                            |
| 减：应收利息总额               | 2,358.91                                 |
| 买卖债券差价收入               | 603,968.62                               |

#### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 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——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 63,488,556.95                            |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | 2,855,306.30                             |
| 基金投资产生的股利收益   | —                                        |
| 合计            | 63,488,556.95                            |

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|------------|------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -1,059,443,433.14                        |
| ——股票投资     | -1,059,443,433.14                        |
| ——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                     | -1,059,443,433.14 |

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|---------|------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                        |
| 替代损益    | 2,779,440.08                             |
| 其他      | -                                        |
| 合计      | 2,779,440.08                             |

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 5,809,795.68                             |
| 银行间市场交易费用 | -                                        |
| 合计        | 5,809,795.68                             |

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------------|
| 审计费用      | 39,671.58                                |
| 信息披露费     | 59,507.37                                |
| 证券出借违约金   | -                                        |
| 账户维护费     | -                                        |
| 银行费用      | 491.12                                   |
| 指数使用费     | 1,260,376.33                             |
| 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        | 1,360,046.40                             |

#### 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, 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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |                  | 上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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  | 617,203.19                            | 0.02             | 715,862,944.91                             | 24.63            |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名 | 本期 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  | 568.35                                     | 0.02           | 339.59     | 0.02             |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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  | 657,901.44                                 | 24.39          | 657,390.77 | 39.40            |

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<br>2021 年 01 月 01 日至<br>2021 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 01 月 01 日至<br>2020 年 06 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 21,006,273.02                               | 10,503,949.12                                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                                           | -                                                |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 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、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<br>2021 年 01 月 01 日至 2021<br>年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 01 月 01 日至 2020<br>年 06 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,201,254.61                                | 2,100,789.77                                     |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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

单位：人民币元

| 本期 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                                       | 7,762,456.00   | 5,131.86   | -              | -         |
| 上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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                                       | 700,139,784.00 | 409,688.90 | 114,095,826.00 | 20,133.83 |

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 |            | 上年度可比期间 2020 年 01 月 01 日至 2020 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  | 59,970,090.62                         | 119,333.37 | 48,587,004.20                              | 124,929.70 |

#### 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（2021 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            | 可流通日             | 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 |
| 300973               | 立高食品 | 2021 年 04 月 08 日 | 2021 年 10 月 15 日 | 新股流通受限 | 28.28 | 115.71 | 360      | 10,180.80 | 41,655.60  |    |
| 688609               | 九联科技 | 2021 年 03 月 15 日 | 2021 年 09 月 23 日 | 新股流通受限 | 3.99  | 15.29  | 10,372   | 41,384.28 | 158,587.88 |    |
| 301018               | 申    | 2021             | 2021             | 新      | 8.29  | 8.29   | 7,029    | 58,270.41 | 58,270.41  |    |

|        |      |                                 |                                 |                            |       |        |       |           |            |  |
|--------|------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------|-------|--------|-------|-----------|------------|--|
|        | 菱环境  | 年<br>06<br>月<br>28<br>日         | 年<br>07<br>月<br>07<br>日         | 股<br>流<br>通<br>受<br>限      |       |        |       |           |            |  |
| 688499 | 利元亨  | 2021<br>年<br>06<br>月<br>23<br>日 | 2021<br>年<br>07<br>月<br>01<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 38.85 | 38.85  | 2,149 | 83,488.65 | 83,488.65  |  |
| 688565 | 力源科技 | 2021<br>年<br>05<br>月<br>06<br>日 | 2021<br>年<br>11<br>月<br>15<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 9.39  | 14.00  | 2,464 | 23,136.96 | 34,496.00  |  |
| 300957 | 贝泰妮  | 2021<br>年<br>03<br>月<br>18<br>日 | 2021<br>年<br>09<br>月<br>27<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 47.33 | 251.96 | 853   | 40,372.49 | 214,921.88 |  |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021<br>年<br>06<br>月<br>23<br>日 | 2022<br>年<br>01<br>月<br>05<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 8.86  | 8.86   | 555   | 4,917.30  | 4,917.30   |  |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021<br>年<br>06<br>月<br>23<br>日 | 2021<br>年<br>07<br>月<br>05<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 8.86  | 8.86   | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70  |  |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021<br>年<br>05<br>月<br>17<br>日 | 2021<br>年<br>11<br>月<br>25<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 9.36  | 20.32  | 200   | 1,872.00  | 4,064.00   |  |
| 301015 | 百洋医  | 2021<br>年<br>06                 | 2021<br>年<br>12                 | 新<br>股<br>流                | 7.64  | 38.83  | 462   | 3,529.68  | 17,939.46  |  |

|        | 药    | 月<br>22<br>日                    | 月<br>30<br>日                    | 通<br>受<br>限                |       |       |       |           |           |  |
|--------|------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|
| 300968 | 格林精密 | 2021<br>年<br>04<br>月<br>06<br>日 | 2021<br>年<br>10<br>月<br>15<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 6.87  | 12.07 | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 |  |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021<br>年<br>03<br>月<br>03<br>日 | 2021<br>年<br>09<br>月<br>13<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 11.72 | 27.08 | 340   | 3,984.80  | 9,207.20  |  |
| 300982 | 苏文电能 | 2021<br>年<br>04<br>月<br>19<br>日 | 2021<br>年<br>10<br>月<br>27<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 15.83 | 45.29 | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 |  |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021<br>年<br>06<br>月<br>23<br>日 | 2021<br>年<br>12<br>月<br>30<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 13.75 | 32.98 | 275   | 3,781.25  | 9,069.50  |  |
| 688117 | 圣诺生物 | 2021<br>年<br>05<br>月<br>26<br>日 | 2021<br>年<br>12<br>月<br>03<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 17.90 | 35.97 | 1,672 | 29,928.80 | 60,141.84 |  |
| 300996 | 普联软件 | 2021<br>年<br>05<br>月<br>26<br>日 | 2021<br>年<br>12<br>月<br>03<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 20.81 | 42.23 | 241   | 5,015.21  | 10,177.43 |  |
| 688359 | 三孚新科 | 2021<br>年<br>05<br>月<br>14      | 2021<br>年<br>11<br>月<br>22      | 新<br>股<br>流<br>通<br>受      | 11.03 | 26.35 | 2,213 | 24,409.39 | 58,312.55 |  |

|        |      | 日           | 日           | 限      |       |       |       |           |           |  |
|--------|------|-------------|-------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|
| 301010 | 晶雪节能 | 2021年06月09日 | 2021年12月20日 | 新股流通受限 | 7.83  | 17.61 | 218   | 1,706.94  | 3,838.98  |  |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年05月17日 | 2021年11月26日 | 新股流通受限 | 14.72 | 23.32 | 191   | 2,811.52  | 4,454.12  |  |
| 300945 | 曼卡龙  | 2021年02月03日 | 2021年08月10日 | 新股流通受限 | 4.56  | 18.88 | 474   | 2,161.44  | 8,949.12  |  |
| 300614 | 百川畅银 | 2021年05月18日 | 2021年11月25日 | 新股流通受限 | 9.19  | 40.38 | 329   | 3,023.51  | 13,285.02 |  |
| 301018 | 申菱环境 | 2021年06月28日 | 2022年01月07日 | 新股流通受限 | 8.29  | 8.29  | 782   | 6,482.78  | 6,482.78  |  |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021年03月16日 | 2021年09月24日 | 新股流通受限 | 16.53 | 46.07 | 232   | 3,834.96  | 10,688.24 |  |
| 688367 | 工大高科 | 2021年06月21日 | 2021年12月28日 | 新股流通受限 | 11.53 | 17.94 | 1,717 | 19,797.01 | 30,802.98 |  |
| 301007 | 德    | 2021        | 2021        | 新      | 5.29  | 14.44 | 303   | 1,602.87  | 4,375.32  |  |

|        |      |                                 |                                 |                            |       |       |       |           |            |  |
|--------|------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------|-------|-------|-------|-----------|------------|--|
|        | 迈仕   | 年<br>06<br>月<br>04<br>日         | 年<br>12<br>月<br>16<br>日         | 股<br>流<br>通<br>受<br>限      |       |       |       |           |            |  |
| 605162 | 新中港  | 2021<br>年<br>06<br>月<br>29<br>日 | 2021<br>年<br>07<br>月<br>07<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 6.07  | 6.07  | 1,377 | 8,358.39  | 8,358.39   |  |
| 300958 | 建工修复 | 2021<br>年<br>03<br>月<br>18<br>日 | 2021<br>年<br>09<br>月<br>29<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 8.53  | 27.22 | 300   | 2,559.00  | 8,166.00   |  |
| 688195 | 腾景科技 | 2021<br>年<br>03<br>月<br>18<br>日 | 2021<br>年<br>09<br>月<br>27<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 13.60 | 19.87 | 2,693 | 36,624.80 | 53,509.91  |  |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021<br>年<br>04<br>月<br>02<br>日 | 2021<br>年<br>10<br>月<br>13<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 4.54  | 11.54 | 507   | 2,301.78  | 5,850.78   |  |
| 688661 | 和林微纳 | 2021<br>年<br>03<br>月<br>19<br>日 | 2021<br>年<br>09<br>月<br>29<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 17.71 | 84.01 | 1,452 | 25,714.92 | 121,982.52 |  |
| 300991 | 创益通  | 2021<br>年<br>05<br>月<br>12<br>日 | 2021<br>年<br>11<br>月<br>22<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 13.06 | 26.51 | 254   | 3,317.24  | 6,733.54   |  |
| 300971 | 博亚精  | 2021<br>年<br>04                 | 2021<br>年<br>10                 | 新<br>股<br>流                | 18.24 | 28.29 | 245   | 4,468.80  | 6,931.05   |  |

|        | 工    | 月           | 月           | 通      |       |       |       |           |           |  |
|--------|------|-------------|-------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|
|        |      | 07          | 15          | 受      |       |       |       |           |           |  |
|        |      | 日           | 日           | 限      |       |       |       |           |           |  |
| 688611 | 杭州柯林 | 2021年04月01日 | 2021年10月12日 | 新股流通受限 | 33.44 | 42.34 | 1,400 | 46,816.00 | 59,276.00 |  |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年06月28日 | 2022年01月06日 | 新股流通受限 | 9.46  | 9.46  | 290   | 2,743.40  | 2,743.40  |  |
| 300979 | 华利集团 | 2021年04月15日 | 2021年10月26日 | 新股流通受限 | 33.22 | 87.50 | 925   | 30,728.50 | 80,937.50 |  |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021年02月02日 | 2021年08月09日 | 新股流通受限 | 5.31  | 28.52 | 443   | 2,352.33  | 12,634.36 |  |
| 301011 | 华立科技 | 2021年06月09日 | 2021年12月17日 | 新股流通受限 | 14.20 | 33.84 | 175   | 2,485.00  | 5,922.00  |  |
| 300930 | 屹通新材 | 2021年01月13日 | 2021年07月21日 | 新股流通受限 | 13.11 | 24.48 | 322   | 4,221.42  | 7,882.56  |  |
| 300981 | 中红医疗 | 2021年04月19日 | 2021年10月27日 | 新股流通受限 | 48.59 | 90.39 | 601   | 29,202.59 | 54,324.39 |  |

|        |      | 日           | 日           | 限      |       |       |       |           |            |  |
|--------|------|-------------|-------------|--------|-------|-------|-------|-----------|------------|--|
| 300950 | 德固特  | 2021年02月24日 | 2021年09月03日 | 新股流通受限 | 8.41  | 39.13 | 219   | 1,841.79  | 8,569.47   |  |
| 300966 | 共同药业 | 2021年03月31日 | 2021年10月11日 | 新股流通受限 | 8.24  | 31.54 | 286   | 2,356.64  | 9,020.44   |  |
| 605287 | 德才股份 | 2021年06月28日 | 2021年07月06日 | 新股流通受限 | 31.56 | 31.56 | 349   | 11,014.44 | 11,014.44  |  |
| 688087 | 英科再生 | 2021年06月30日 | 2021年07月09日 | 新股流通受限 | 21.96 | 21.96 | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24  |  |
| 301012 | 扬电科技 | 2021年06月15日 | 2021年12月22日 | 新股流通受限 | 8.05  | 24.26 | 170   | 1,368.50  | 4,124.20   |  |
| 688575 | 亚辉龙  | 2021年05月10日 | 2021年11月17日 | 新股流通受限 | 14.80 | 32.09 | 3,435 | 50,838.00 | 110,229.15 |  |
| 300948 | 冠中生态 | 2021年02月18日 | 2021年08月25日 | 新股流通受限 | 8.67  | 27.42 | 324   | 2,808.00  | 8,884.08   |  |
| 688226 | 威    | 2021        | 2021        | 新      | 6.42  | 6.42  | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06  |  |

|        |                  |                                 |                                 |                            |       |       |       |          |           |  |
|--------|------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------|-------|-------|-------|----------|-----------|--|
|        | 腾<br>电<br>气      | 年<br>06<br>月<br>28<br>日         | 年<br>07<br>月<br>07<br>日         | 股<br>流<br>通<br>受<br>限      |       |       |       |          |           |  |
| 300933 | 中<br>辰<br>股<br>份 | 2021<br>年<br>01<br>月<br>15<br>日 | 2021<br>年<br>07<br>月<br>22<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 3.37  | 10.44 | 1,112 | 3,747.44 | 11,609.28 |  |
| 300997 | 欢<br>乐<br>家      | 2021<br>年<br>05<br>月<br>26<br>日 | 2021<br>年<br>12<br>月<br>02<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 4.94  | 13.05 | 928   | 4,584.32 | 12,110.40 |  |
| 300993 | 玉<br>马<br>遮<br>阳 | 2021<br>年<br>05<br>月<br>17<br>日 | 2021<br>年<br>11<br>月<br>24<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 12.10 | 19.29 | 410   | 4,961.00 | 7,908.90  |  |
| 300986 | 志<br>特<br>新<br>材 | 2021<br>年<br>04<br>月<br>21<br>日 | 2021<br>年<br>11<br>月<br>01<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 14.79 | 30.57 | 264   | 3,904.56 | 8,070.48  |  |
| 300962 | 中<br>金<br>辐<br>照 | 2021<br>年<br>03<br>月<br>29<br>日 | 2021<br>年<br>10<br>月<br>11<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 3.40  | 16.37 | 393   | 1,336.20 | 6,433.41  |  |
| 300972 | 万<br>辰<br>生<br>物 | 2021<br>年<br>04<br>月<br>08<br>日 | 2021<br>年<br>10<br>月<br>19<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 7.19  | 12.65 | 430   | 3,091.70 | 5,439.50  |  |
| 300929 | 华<br>骐<br>环      | 2021<br>年<br>01<br>月            | 2021<br>年<br>07<br>月            | 新<br>股<br>流                | 13.87 | 29.55 | 183   | 2,538.21 | 5,407.65  |  |

|                      | 保                | 月<br>12<br>日                    | 月<br>21<br>日                    | 通<br>受<br>限                |                  |                            |                               |                            |                            |        |
|----------------------|------------------|---------------------------------|---------------------------------|----------------------------|------------------|----------------------------|-------------------------------|----------------------------|----------------------------|--------|
| 300943               | 春晖智控             | 2021<br>年<br>02<br>月<br>03<br>日 | 2021<br>年<br>08<br>月<br>10<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 9.79             | 23.01                      | 255                           | 2,496.45                   | 5,867.55                   |        |
| 688395               | 正弦电气             | 2021<br>年<br>04<br>月<br>21<br>日 | 2021<br>年<br>10<br>月<br>29<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 15.95            | 22.37                      | 1,627                         | 25,950.65                  | 36,395.99                  |        |
| 301021               | 英诺激光             | 2021<br>年<br>06<br>月<br>28<br>日 | 2021<br>年<br>07<br>月<br>06<br>日 | 新<br>股<br>流<br>通<br>受<br>限 | 9.46             | 9.46                       | 2,609                         | 24,681.14                  | 24,681.14                  |        |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |                  |                                 |                                 |                            |                  |                            |                               |                            |                            |        |
| 证券代<br>码             | 证<br>券<br>名<br>称 | 成<br>功<br>认<br>购<br>日           | 可<br>流<br>通<br>日                | 流<br>通<br>受<br>限<br>类<br>型 | 认<br>购<br>价<br>格 | 期<br>末<br>估<br>值<br>单<br>价 | 数<br>量<br>(<br>单<br>位<br>: 张) | 期<br>末<br>成<br>本<br>总<br>额 | 期<br>末<br>估<br>值<br>总<br>额 | 备<br>注 |
|                      |                  |                                 |                                 |                            | -                | -                          | -                             | -                          | -                          |        |

注：本基金持有的流通受限股票“冠中生态”（证券代码：300948）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 108 股（根据冠中生态 2020 年年度权益分派实施公告，冠中生态以公司现有总股本 93,340,000 股为基数，向全体股东每 10 股派 0.80 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 2021 年 6 月 4 日。）。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票<br>代码 | 股<br>票<br>名 | 停<br>牌<br>日 | 停<br>牌<br>原 | 期<br>末<br>估 | 复<br>牌<br>日 | 复<br>牌<br>开 | 数<br>量<br>(<br>股) | 期<br>末<br>成<br>本<br>总<br>额 | 期<br>末<br>估<br>值<br>总<br>额 | 备<br>注 |
|----------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------------|----------------------------|----------------------------|--------|
|----------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------------|----------------------------|----------------------------|--------|

|        | 称    | 期           | 因      | 值<br>单<br>价 | 期           | 盘<br>单<br>价 |            |               |               |  |
|--------|------|-------------|--------|-------------|-------------|-------------|------------|---------------|---------------|--|
| 600811 | 东方集团 | 2021年06月30日 | 重大资产重组 | 3.05        | 2021年07月14日 | 3.36        | 10,472,494 | 41,880,392.31 | 31,941,106.70 |  |

#### 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 2021 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 2021 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  | 002304 | 洋河股份 | 2021年07月01日 | 2021年07月05日 | 207.20 | 307100   | 63,631,120.00 |
| 2  | 000568 | 泸州老窖 | 2021年07月01日 | 2021年07月12日 | 235.94 | 165700   | 39,095,258.00 |
| 3  | 002311 | 海大集团 | 2021年07月01日 | 2021年07月12日 | 81.60  | 429200   | 35,022,720.00 |
| 4  | 600887 | 伊利股份 | 2021年07月01日 | 2021年07月05日 | 36.83  | 680600   | 25,066,498.00 |

|    |        |      |                           |   |                           |        |        |               |
|----|--------|------|---------------------------|---|---------------------------|--------|--------|---------------|
| 5  | 600132 | 重庆啤酒 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 197.95 | 115400 | 22,843,430.00 |
| 6  | 000799 | 酒鬼酒  | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 255.60 | 89000  | 22,748,400.00 |
| 7  | 603369 | 今世缘  | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 54.16  | 326600 | 17,688,656.00 |
| 8  | 000895 | 双汇发展 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 31.80  | 538300 | 17,117,940.00 |
| 9  | 000596 | 古井贡酒 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 239.50 | 58000  | 13,891,000.00 |
| 10 | 300146 | 汤臣倍健 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 32.90  | 368900 | 12,136,810.00 |
| 11 | 603589 | 口子窖  | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 67.69  | 172000 | 11,642,680.00 |
| 12 | 600315 | 上海家化 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 60.14  | 175100 | 10,530,514.00 |
| 13 | 600779 | 水井坊  | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 126.35 | 72000  | 9,097,200.00  |
| 14 | 603605 | 珀莱雅  | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 196.71 | 44100  | 8,674,911.00  |
| 15 | 000998 | 隆平高科 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 16.04  | 531700 | 8,528,468.00  |

|    |        |      |                           |   |                           |       |         |              |
|----|--------|------|---------------------------|---|---------------------------|-------|---------|--------------|
| 16 | 002385 | 大北农  | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 6.80  | 1201300 | 8,168,840.00 |
| 17 | 000876 | 新希望  | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 14.67 | 546500  | 8,017,155.00 |
| 18 | 002511 | 中顺洁柔 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 27.55 | 245000  | 6,749,750.00 |
| 19 | 002299 | 圣农发展 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 23.88 | 239200  | 5,712,096.00 |
| 20 | 002507 | 涪陵榨菜 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 37.66 | 147400  | 5,551,084.00 |
| 21 | 603198 | 迎驾贡酒 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 44.30 | 121100  | 5,364,730.00 |
| 22 | 000729 | 燕京啤酒 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 7.24  | 728900  | 5,277,236.00 |
| 23 | 002557 | 洽洽食品 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 43.10 | 121100  | 5,219,410.00 |
| 24 | 600598 | 北大荒  | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 14.96 | 339900  | 5,084,904.00 |
| 25 | 600737 | 中粮糖业 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 10.01 | 507600  | 5,081,076.00 |
| 26 | 600811 | 东方集团 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 3.05  | 1387400 | 4,231,570.00 |

|    |        |      |                           |   |                           |        |        |              |
|----|--------|------|---------------------------|---|---------------------------|--------|--------|--------------|
| 27 | 603866 | 桃李面包 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 31.20  | 120700 | 3,765,840.00 |
| 28 | 002157 | 正邦科技 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 11.95  | 298700 | 3,569,465.00 |
| 29 | 000860 | 顺鑫农业 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 42.18  | 82500  | 3,479,850.00 |
| 30 | 002714 | 牧原股份 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 60.82  | 50300  | 3,059,246.00 |
| 31 | 603156 | 养元饮品 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 28.58  | 104800 | 2,995,184.00 |
| 32 | 000858 | 五粮液  | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 297.89 | 10000  | 2,978,900.00 |
| 33 | 000930 | 中粮科技 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 12<br>日 | 9.01   | 319700 | 2,880,497.00 |
| 34 | 000869 | 张裕 A | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 37.14  | 68600  | 2,547,804.00 |
| 35 | 002458 | 益生股份 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 9.97   | 218200 | 2,175,454.00 |
| 36 | 603708 | 家家悦  | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | 17.37  | 122800 | 2,133,036.00 |
| 37 | 601933 | 永辉超市 | 2021<br>年 07<br>月 01<br>日 | - | 2021<br>年 07<br>月 05<br>日 | 4.73   | 439400 | 2,078,362.00 |

|    |        |      |             |   |             |        |            |                |
|----|--------|------|-------------|---|-------------|--------|------------|----------------|
| 38 | 002124 | 天邦股份 | 2021年07月01日 | - | 2021年07月05日 | 7.01   | 275600     | 1,931,956.00   |
| 39 | 002505 | 鹏都农牧 | 2021年07月01日 | - | 2021年07月12日 | 2.24   | 648500     | 1,452,640.00   |
| 40 | 603288 | 海天味业 | 2021年07月01日 | - | 2021年07月01日 | 128.95 | 10000      | 1,289,500.00   |
| 41 | 600600 | 青岛啤酒 | 2021年07月01日 | - | 2021年07月01日 | 115.65 | 10000      | 1,156,500.00   |
| 42 | 603517 | 绝味食品 | 2021年07月05日 | - | 2021年07月05日 | 84.29  | 10000      | 842,900.00     |
| 43 | 600872 | 中炬高新 | 2021年07月01日 | - | 2021年07月12日 | 42.02  | 20000      | 840,400.00     |
| 44 | 603719 | 良品铺子 | 2021年07月05日 | - | 2021年07月05日 | 45.00  | 12900      | 580,500.00     |
| 45 | 300498 | 温氏股份 | 2021年07月01日 | - | 2021年07月01日 | 14.37  | 10000      | 143,700.00     |
| 合计 | -      | -    | -           | - | -           | -      | 12,491,800 | 422,075,190.00 |

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。

除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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<br>2021<br>年 06<br>月 30<br>日 | 1 个月以内        | 1-3<br>个月 | 3<br>个月<br>-1<br>年 | 1-5<br>年 | 5<br>年<br>以上 | 不计息              | 合计               |
|----------------------------------|---------------|-----------|--------------------|----------|--------------|------------------|------------------|
| 资产                               |               |           |                    |          |              |                  |                  |
| 银行存款                             | 59,970,090.62 | -         | -                  | -        | -            | -                | 59,970,090.62    |
| 结算备付金                            | 1,555,907.78  | -         | -                  | -        | -            | -                | 1,555,907.78     |
| 存出保证金                            | 787,879.17    | -         | -                  | -        | -            | -                | 787,879.17       |
| 交易性金融资产                          | -             | -         | -                  | -        | -            | 8,447,183,552.23 | 8,447,183,552.23 |
| 应收股利                             | -             | -         | -                  | -        | -            | 419,288.00       | 419,288.00       |
| 应收利息                             | -             | -         | -                  | -        | -            | 245,484.04       | 245,484.04       |
| 应收申购款                            | -             | -         | -                  | -        | -            | -                | -                |
| 衍生                               | -             | -         | -                  | -        | -            | -                | -                |

|                           |               |   |   |   |   |                  |                  |
|---------------------------|---------------|---|---|---|---|------------------|------------------|
| 金融资产                      |               |   |   |   |   |                  |                  |
| 应收<br>证券<br>清算<br>款       | -             | - | - | - | - | 244,795.53       | 244,795.53       |
| 买入<br>返售<br>金融<br>资产      | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 其他<br>资产                  | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 资产<br>总计                  | 62,313,877.57 | - | - | - | - | 8,448,093,119.80 | 8,510,406,997.37 |
| 负债                        |               |   |   |   |   |                  |                  |
| 应付<br>赎回<br>款             | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 应付<br>管理<br>人报<br>酬       | -             | - | - | - | - | 3,440,506.29     | 3,440,506.29     |
| 应付<br>托管<br>费             | -             | - | - | - | - | 688,101.27       | 688,101.27       |
| 应付<br>证券<br>清算<br>款       | -             | - | - | - | - | 15,156,855.88    | 15,156,855.88    |
| 卖出<br>回购<br>金融<br>资产<br>款 | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 应付<br>销售<br>服务<br>费       | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 应付<br>交易<br>费用            | -             | - | - | - | - | 1,878,588.21     | 1,878,588.21     |
| 应交<br>税费                  | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 应付                        | -             | - | - | - | - | -                | -                |

|                          |               |        |          |       |       |                  |                  |
|--------------------------|---------------|--------|----------|-------|-------|------------------|------------------|
| 利息                       |               |        |          |       |       |                  |                  |
| 应付利润                     | -             | -      | -        | -     | -     | -                | -                |
| 其他负债                     | -             | -      | -        | -     | -     | 708,973.98       | 708,973.98       |
| 负债总计                     | -             | -      | -        | -     | -     | 21,873,025.63    | 21,873,025.63    |
| 利率敏感<br>度缺口              | 62,313,877.57 | -      | -        | -     | -     | 8,426,220,094.17 | 8,488,533,971.74 |
| 上年度末<br>2020 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                     | 53,844,156.51 | -      | -        | -     | -     | -                | 53,844,156.51    |
| 结算备付金                    | 883,325.00    | -      | -        | -     | -     | -                | 883,325.00       |
| 存出保证金                    | 889,521.40    | -      | -        | -     | -     | -                | 889,521.40       |
| 交易性金融资产                  | -             | -      | -        | -     | -     | 8,379,014,752.17 | 8,379,014,752.17 |
| 应收股利                     | -             | -      | -        | -     | -     | -                | -                |
| 应收利息                     | -             | -      | -        | -     | -     | 115,433.10       | 115,433.10       |
| 应收申购款                    | -             | -      | -        | -     | -     | -                | -                |
| 衍生金融资产                   | -             | -      | -        | -     | -     | -                | -                |
| 应收证券清算款                  | -             | -      | -        | -     | -     | 34,020,964.17    | 34,020,964.17    |

|                           |               |   |   |   |   |                  |                  |
|---------------------------|---------------|---|---|---|---|------------------|------------------|
| 买入<br>返售<br>金融<br>资产      | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 其他<br>资产                  | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 资产<br>总计                  | 55,617,002.91 | - | - | - | - | 8,413,151,149.44 | 8,468,768,152.35 |
| 负债                        |               |   |   |   |   |                  |                  |
| 应付<br>赎回<br>款             | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 应付<br>管理<br>人报<br>酬       | -             | - | - | - | - | 3,348,242.87     | 3,348,242.87     |
| 应付<br>托管<br>费             | -             | - | - | - | - | 669,648.57       | 669,648.57       |
| 应付<br>证券<br>清算<br>款       | -             | - | - | - | - | 52,829,386.28    | 52,829,386.28    |
| 卖出<br>回购<br>金融<br>资产<br>款 | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 应付<br>销售<br>服务<br>费       | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 应付<br>交易<br>费用            | -             | - | - | - | - | 2,913,425.15     | 2,913,425.15     |
| 应交<br>税费                  | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 应付<br>利息                  | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 应付<br>利润                  | -             | - | - | - | - | -                | -                |
| 其他<br>负债                  | -             | - | - | - | - | 785,710.57       | 785,710.57       |
| 负债                        | -             | - | - | - | - | 60,546,413.44    | 60,546,413.44    |

|             |               |   |   |   |   |                  |                  |
|-------------|---------------|---|---|---|---|------------------|------------------|
| 总计          |               |   |   |   |   |                  |                  |
| 利率敏感<br>度缺口 | 55,617,002.91 | - | - | - | - | 8,352,604,736.00 | 8,408,221,738.91 |

注：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

注：本基金本报告期及上年度末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且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其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 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。本基金所面临的最大的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 2021 年 06 月 30 日 |               | 上年度末 2020 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  | 8,447,183,552.23     | 99.51         | 8,379,014,752.17      | 99.65         |
| 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            | 8,447,183,552.23     | 99.51         | 8,379,014,752.17      | 99.65         |

注：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成

份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产的 90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 2021 年 06 月 30 日        | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|    | 中证主要消费指数上涨 5%                                                                          | 421,536,414.81              | 416,302,129.60        |
|    | 中证主要消费指数下跌 5%                                                                          | -421,536,414.81             | -416,302,129.60       |

注：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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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     | 8,447,183,552.23 | 99.26        |
|    | 其中：股票    | 8,447,183,552.23 | 99.26        |
| 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      | 61,525,998.40    | 0.72   |
| 8 | 其他资产              | 1,697,446.74     | 0.02   |
| 9 | 合计                | 8,510,406,997.37 | 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 422,075,190.00 元，占期末基金资产净值比例 4.97%。

## 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         | 973,101,731.66   | 11.46        |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 7,302,539,189.44 | 86.03        |
| 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           | 169,751,587.18   | 2.00         |
| 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       | -                | -            |
| 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               | 8,445,392,508.28 | 99.49        |

### 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         | 11,290.28    | 0.00         |
| B  | 采矿业              | -            | -            |
| C  | 制造业              | 1,537,932.65 | 0.02         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39    | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 25,371.37    | 0.00         |

|   |                 |              |      |
|---|-----------------|--------------|------|
| F | 批发和零售业          | 76,061.58    | 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 | 22,407.83    | 0.00 |
| J | 金融业             | 34,721.10    | 0.00 |
| K | 房地产业            | -            | -    |
| L | 租赁和商务服务业        | -            | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      | -            | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 70,238.75    | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -            | -    |
| P | 教育              | -            | -    |
| Q | 卫生和社会工作         | -            | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -            | -    |
| S | 综合              | -            | -    |
|   | 合计              | 1,791,043.95 | 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  | 000858 | 五 粮 液 | 2,885,115  | 859,446,907.35 | 10.12        |
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 397,236    | 816,995,281.20 | 9.62         |
| 3  | 600887 | 伊利股份  | 21,487,407 | 791,381,199.81 | 9.32         |
| 4  | 000568 | 泸州老窖  | 2,587,504  | 610,495,693.76 | 7.19         |
| 5  | 603288 | 海天味业  | 4,464,129  | 575,649,434.55 | 6.78         |
| 6  | 002714 | 牧原股份  | 9,296,475  | 565,411,609.50 | 6.66         |
| 7  | 600809 | 山西汾酒  | 1,231,902  | 551,892,096.00 | 6.50         |

|    |        |      |            |                |      |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 8  | 002304 | 洋河股份 | 2,129,059  | 441,141,024.80 | 5.20 |
| 9  | 002311 | 海大集团 | 2,934,470  | 239,452,752.00 | 2.82 |
| 10 | 300498 | 温氏股份 | 15,760,428 | 226,477,350.36 | 2.67 |
| 11 | 000799 | 酒鬼酒  | 803,000    | 205,246,800.00 | 2.42 |
| 12 | 600132 | 重庆啤酒 | 855,361    | 169,318,709.95 | 1.99 |
| 13 | 000895 | 双汇发展 | 4,896,172  | 155,698,269.60 | 1.83 |
| 14 | 600600 | 青岛啤酒 | 1,253,390  | 144,954,553.50 | 1.71 |
| 15 | 603369 | 今世缘  | 2,216,262  | 120,032,749.92 | 1.41 |
| 16 | 000876 | 新希望  | 7,957,901  | 116,742,407.67 | 1.38 |
| 17 | 300146 | 汤臣倍健 | 3,003,301  | 98,808,602.90  | 1.16 |
| 18 | 000596 | 古井贡酒 | 406,287    | 97,305,736.50  | 1.15 |
| 19 | 603517 | 绝味食品 | 1,084,600  | 91,420,934.00  | 1.08 |
| 20 | 600779 | 水井坊  | 690,097    | 87,193,755.95  | 1.03 |
| 21 | 603589 | 口子窖  | 1,271,981  | 86,100,393.89  | 1.01 |
| 22 | 600872 | 中炬高新 | 1,970,136  | 82,785,114.72  | 0.98 |
| 23 | 002385 | 大北农  | 11,703,702 | 79,585,173.60  | 0.94 |
| 24 | 000860 | 顺鑫农业 | 1,833,696  | 77,345,297.28  | 0.91 |
| 25 | 600315 | 上海家化 | 1,197,968  | 72,045,795.52  | 0.85 |
| 26 | 002507 | 涪陵榨菜 | 1,881,900  | 70,872,354.00  | 0.83 |
| 27 | 603605 | 珀莱雅  | 355,200    | 69,871,392.00  | 0.82 |
| 28 | 002157 | 正邦科技 | 5,560,600  | 66,449,170.00  | 0.78 |
| 29 | 002511 | 中顺洁柔 | 2,317,384  | 63,843,929.20  | 0.75 |
| 30 | 601933 | 永辉超市 | 13,446,812 | 63,603,420.76  | 0.75 |
| 31 | 002299 | 圣农发展 | 2,637,735  | 62,989,111.80  | 0.74 |
| 32 | 000998 | 隆平高科 | 3,721,800  | 59,697,672.00  | 0.70 |

|    |        | 科    |            |               |      |
|----|--------|------|------------|---------------|------|
| 33 | 600827 | 百联股份 | 2,833,424  | 57,093,493.60 | 0.67 |
| 34 | 603156 | 养元饮品 | 1,787,832  | 51,096,238.56 | 0.60 |
| 35 | 002557 | 洽洽食品 | 1,074,339  | 46,304,010.90 | 0.55 |
| 36 | 603866 | 桃李面包 | 1,345,473  | 41,978,757.60 | 0.49 |
| 37 | 600737 | 中粮糖业 | 3,777,506  | 37,812,835.06 | 0.45 |
| 38 | 603198 | 迎驾贡酒 | 848,383    | 37,583,366.90 | 0.44 |
| 39 | 600598 | 北大荒  | 2,511,300  | 37,569,048.00 | 0.44 |
| 40 | 002124 | 天邦股份 | 5,194,300  | 36,412,043.00 | 0.43 |
| 41 | 000729 | 燕京啤酒 | 4,978,587  | 36,044,969.88 | 0.42 |
| 42 | 000930 | 中粮科技 | 3,954,793  | 35,632,684.93 | 0.42 |
| 43 | 600811 | 东方集团 | 10,472,494 | 31,941,106.70 | 0.38 |
| 44 | 600597 | 光明乳业 | 2,162,228  | 31,157,705.48 | 0.37 |
| 45 | 002505 | 鹏都农牧 | 11,259,421 | 25,221,103.04 | 0.30 |
| 46 | 300741 | 华宝股份 | 434,800    | 22,053,056.00 | 0.26 |
| 47 | 002458 | 益生股份 | 2,102,000  | 20,956,940.00 | 0.25 |
| 48 | 000869 | 张裕 A | 480,100    | 17,830,914.00 | 0.21 |
| 49 | 603317 | 天味食品 | 535,032    | 15,745,991.76 | 0.19 |
| 50 | 603708 | 家家悦  | 860,194    | 14,941,569.78 | 0.18 |
| 51 | 603983 | 丸美股份 | 183,900    | 9,583,029.00  | 0.11 |
| 52 | 002946 | 新乳业  | 613,000    | 9,286,950.00  | 0.11 |
| 53 | 603719 | 良品铺子 | 197,600    | 8,892,000.00  | 0.10 |

### 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  | 300957 | 贝泰妮  | 853    | 214,921.88 | 0.00         |
| 2  | 688609 | 九联科技 | 10,372 | 158,587.88 | 0.00         |
| 3  | 688661 | 和林微纳 | 1,452  | 121,982.52 | 0.00         |
| 4  | 688575 | 亚辉龙  | 3,435  | 110,229.15 | 0.00         |
| 5  | 688499 | 利元亨  | 2,149  | 83,488.65  | 0.00         |
| 6  | 300979 | 华利集团 | 925    | 80,937.50  | 0.00         |
| 7  | 301018 | 申菱环境 | 7,811  | 64,753.19  | 0.00         |
| 8  | 688117 | 圣诺生物 | 1,672  | 60,141.84  | 0.00         |
| 9  | 688611 | 杭州柯林 | 1,400  | 59,276.00  | 0.00         |
| 10 | 688359 | 三孚新科 | 2,213  | 58,312.55  | 0.00         |
| 11 | 300981 | 中红医疗 | 601    | 54,324.39  | 0.00         |
| 12 | 688087 | 英科再生 | 2,469  | 54,219.24  | 0.00         |
| 13 | 688195 | 腾景科技 | 2,693  | 53,509.91  | 0.00         |
| 14 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550  | 49,173.00  | 0.00         |
| 15 | 300973 | 立高食品 | 360    | 41,655.60  | 0.00         |
| 16 | 688395 | 正弦电气 | 1,627  | 36,395.99  | 0.00         |
| 17 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230  | 34,721.10  | 0.00         |
| 18 | 688565 | 力源科技 | 2,464  | 34,496.00  | 0.00         |
| 19 | 688367 | 工大高科 | 1,717  | 30,802.98  | 0.00         |
| 20 | 301021 | 英诺激光 | 2,899  | 27,424.54  | 0.00         |
| 21 | 001207 | 联科科技 | 682    | 22,581.02  | 0.00         |
| 22 | 301015 | 百洋医药 | 462    | 17,939.46  | 0.00         |
| 23 | 688226 | 威腾电气 | 2,693  | 17,289.06  | 0.00         |
| 24 | 300982 | 苏文电能 | 317    | 14,356.93  | 0.00         |
| 25 | 300968 | 格林精密 | 1,162  | 14,025.34  | 0.00         |
| 26 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754  | 13,558.42  | 0.00         |
| 27 | 300614 | 百川畅银 | 329    | 13,285.02  | 0.00         |
| 28 | 300942 | 易瑞生物 | 443    | 12,634.36  | 0.00         |
| 29 | 603171 | 税友股份 | 637    | 12,230.40  | 0.00         |
| 30 | 300997 | 欢乐家  | 928    | 12,110.40  | 0.00         |
| 31 | 300933 | 中辰股份 | 1,112  | 11,609.28  | 0.00         |
| 32 | 605287 | 德才股份 | 349    | 11,014.44  | 0.00         |
| 33 | 300955 | 嘉亨家化 | 232    | 10,688.24  | 0.00         |
| 34 | 300996 | 普联软件 | 241    | 10,177.43  | 0.00         |
| 35 | 300952 | 恒辉安防 | 340    | 9,207.20   | 0.00         |
| 36 | 301016 | 雷尔伟  | 275    | 9,069.50   | 0.00         |
| 37 | 300966 | 共同药业 | 286    | 9,020.44   | 0.00         |
| 38 | 300945 | 曼卡龙  | 474    | 8,949.12   | 0.00         |
| 39 | 300948 | 冠中生态 | 324    | 8,884.08   | 0.00         |

|    |        |       |       |          |      |
|----|--------|-------|-------|----------|------|
| 40 | 300950 | 德固特   | 219   | 8,569.47 | 0.00 |
| 41 | 605162 | 新 中 港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 42 | 300958 | 建工修复  | 300   | 8,166.00 | 0.00 |
| 43 | 300986 | 志特新材  | 264   | 8,070.48 | 0.00 |
| 44 | 300993 | 玉马遮阳  | 410   | 7,908.90 | 0.00 |
| 45 | 300930 | 屹通新材  | 322   | 7,882.56 | 0.00 |
| 46 | 300971 | 博亚精工  | 245   | 6,931.05 | 0.00 |
| 47 | 300991 | 创益通   | 254   | 6,733.54 | 0.00 |
| 48 | 300962 | 中金辐照  | 393   | 6,433.41 | 0.00 |
| 49 | 301011 | 华立科技  | 175   | 5,922.00 | 0.00 |
| 50 | 300943 | 春晖智控  | 255   | 5,867.55 | 0.00 |
| 51 | 300967 | 晓鸣股份  | 507   | 5,850.78 | 0.00 |
| 52 | 300972 | 万辰生物  | 430   | 5,439.50 | 0.00 |
| 53 | 300929 | 华骐环保  | 183   | 5,407.65 | 0.00 |
| 54 | 605011 | 杭州热电  | 525   | 4,662.00 | 0.00 |
| 55 | 300995 | 奇德新材  | 191   | 4,454.12 | 0.00 |
| 56 | 301007 | 德迈仕   | 303   | 4,375.32 | 0.00 |
| 57 | 301012 | 扬电科技  | 170   | 4,124.20 | 0.00 |
| 58 | 300992 | 泰福泵业  | 200   | 4,064.00 | 0.00 |
| 59 | 301010 | 晶雪节能  | 218   | 3,838.98 | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 600887 | 伊利股份 | 300,398,946.96 | 3.57           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 222,369,363.59 | 2.64           |
| 3  | 603288 | 海天味业 | 204,380,532.50 | 2.43           |
| 4  | 000799 | 酒鬼酒  | 185,910,427.56 | 2.21           |
| 5  | 600809 | 山西汾酒 | 173,175,141.19 | 2.06           |
| 6  | 603517 | 绝味食品 | 86,548,018.75  | 1.03           |
| 7  | 600438 | 通威股份 | 81,366,994.80  | 0.97           |
| 8  | 000895 | 双汇发展 | 45,484,222.83  | 0.54           |
| 9  | 600600 | 青岛啤酒 | 42,481,184.08  | 0.51           |
| 10 | 600132 | 重庆啤酒 | 38,566,888.07  | 0.46           |
| 11 | 603369 | 今世缘  | 37,368,223.57  | 0.44           |
| 12 | 600872 | 中炬高新 | 35,817,931.38  | 0.43           |
| 13 | 603605 | 珀莱雅  | 31,574,755.37  | 0.38           |
| 14 | 002714 | 牧原股份 | 30,838,749.10  | 0.37           |
| 15 | 000568 | 泸州老窖 | 30,028,321.14  | 0.36           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 16 | 603589 | 口子窖  | 28,205,799.15 | 0.34 |
| 17 | 601933 | 永辉超市 | 26,281,758.00 | 0.31 |
| 18 | 600779 | 水井坊  | 21,776,949.78 | 0.26 |
| 19 | 002157 | 正邦科技 | 21,499,002.24 | 0.26 |
| 20 | 300498 | 温氏股份 | 20,881,700.92 | 0.25 |

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  | 600438 | 通威股份 | 413,344,887.94 | 4.92           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 311,208,651.89 | 3.70           |
| 3  | 600887 | 伊利股份 | 230,229,702.49 | 2.74           |
| 4  | 603288 | 海天味业 | 170,349,758.04 | 2.03           |
| 5  | 600809 | 山西汾酒 | 137,957,077.10 | 1.64           |
| 6  | 603345 | 安井食品 | 106,467,917.84 | 1.27           |
| 7  | 002568 | 百润股份 | 96,968,301.29  | 1.15           |
| 8  | 000858 | 五粮液  | 35,730,757.00  | 0.42           |
| 9  | 600600 | 青岛啤酒 | 33,481,273.90  | 0.40           |
| 10 | 600872 | 中炬高新 | 32,001,752.77  | 0.38           |
| 11 | 603369 | 今世缘  | 29,015,111.76  | 0.35           |
| 12 | 600132 | 重庆啤酒 | 28,791,337.12  | 0.34           |
| 13 | 601933 | 永辉超市 | 23,525,133.08  | 0.28           |
| 14 | 600073 | 上海梅林 | 23,487,504.92  | 0.28           |
| 15 | 603589 | 口子窖  | 22,879,430.00  | 0.27           |
| 16 | 600779 | 水井坊  | 15,137,761.54  | 0.18           |
| 17 | 603866 | 桃李面包 | 14,463,952.08  | 0.17           |
| 18 | 600315 | 上海家化 | 12,896,648.72  | 0.15           |
| 19 | 600827 | 百联股份 | 12,762,754.08  | 0.15           |
| 20 | 603156 | 养元饮品 | 11,002,703.53  | 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 | 1,984,554,181.15 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,873,918,944.81 |

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 787,879.17 |
| 2  | 应收证券清算款 | 244,795.53 |
| 3  | 应收股利    | 419,288.00 |
| 4  | 应收利息    | 245,484.04 |
| 5  | 应收申购款   | —          |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 8 | 其他 | -            |
| 9 | 合计 | 1,697,446.74 |

#### 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  | 002304 | 洋河股份 | 63,631,120.00 | 0.75          | 转融通出借流通受限 |
| 2  | 000568 | 泸州老窖 | 39,095,258.00 | 0.46          | 转融通出借流通受限 |
| 3  | 002311 | 海大集团 | 35,022,720.00 | 0.41          | 转融通出借流通受限 |
| 4  | 600887 | 伊利股份 | 25,066,498.00 | 0.30          | 转融通出借流通受限 |
| 5  | 002714 | 牧原股份 | 3,059,246.00  | 0.04          | 转融通出借流通受限 |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 2,978,900.00  | 0.04          | 转融通出借流通受限 |
| 7  | 603288 | 海天味业 | 1,289,500.00  | 0.02          | 转融通出借流通受限 |
| 8  | 300498 | 温氏股份 | 143,700.00    | 0.00          | 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  | 300957 | 贝泰妮  | 214,921.88  | 0.00          | 新股流通受限   |

|   |        |      |            |      |        |
|---|--------|------|------------|------|--------|
| 2 | 688609 | 九联科技 | 158,587.88 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 3 | 688661 | 和林微纳 | 121,982.52 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 4 | 688575 | 亚辉龙  | 110,229.15 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 5 | 688499 | 利元亨  | 83,488.65  | 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<br>(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构            |           |                  |           |                                          |           |
|--------------|-----------|------------------|-----------|------------------|-----------|------------------------------------------|-----------|
|              |           | 机构投资者            |           | 个人投资者            |           | 中国工商银行股份有限公司—汇添富中证主要消费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(%) |
| 69,074       | 97,527.71 | 5,178,878,156.00 | 76.88     | 1,557,750,884.00 | 23.12     | 3,675,783,504.00                         | 54.56     |

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证主要消费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  | 易方达基金-中央汇金资产管理有限责任公司-易方达基金-汇金资管单一资产管理计划 | 704,000,240.00 | 10.45       |
| 2  | 华夏基金-中央汇金资产管理有限责任公司-华                   | 245,963,384.00 | 3.65        |

|    |                                          |                  |       |
|----|------------------------------------------|------------------|-------|
|    | 夏基金-汇金资管单一资产管理计划                         |                  |       |
| 3  | 中信证券-交通银行-中信证券固收多元 1 号集合资产管理计划           | 56,999,940.00    | 0.85  |
| 4  | 浦银安盛基金-上海银行-浦银安盛博悦 2 号 FOF 集合资产管理计划      | 40,083,500.00    | 0.60  |
| 5  | 中融国际信托有限公司-中融-日进斗金 53 号集合资金信托计划          | 35,069,588.00    | 0.52  |
| 6  | 吴政平                                      | 30,592,800.00    | 0.45  |
| 7  | 众安在线财产保险股份有限公司-自有资金                      | 23,489,200.00    | 0.35  |
| 8  | 民生通惠资产-工商银行-民生通惠通汇 1 号资产管理产品             | 20,000,000.00    | 0.30  |
| 9  | 兵工财务有限责任公司                               | 19,861,200.00    | 0.29  |
| 10 | 太平资管-招商银行-太平资产太平之星 97 号资管产品              | 17,250,556.00    | 0.26  |
| 11 | 中国工商银行股份有限公司-汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 3,675,783,504.00 | 54.56 |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|----|-------------------|
|----|-------------------|

|                                |   |
|--------------------------------|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                     |                  |
|-------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2013 年 08 月 23 日）<br>基金份额总额 | 794,657,260.00   |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 1,612,157,260.00 |
| 本报告期基金总申购份额                         | 586,500,000.00   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 450,000,000.00   |
| 本报告期基金拆分变动份额                        | 4,987,971,780.00 |
| 本报告期期末基金份额总额                        | 6,736,629,040.00 |

注：1、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。

2、本基金于 2021 年 6 月 24 日进行了基金份额拆分，基金份额拆分比例为 1:4。拆分前基金份额总额为 1,662,657,260.00 份，拆分后基金份额总额为 6,650,629,040.00 份。

## § 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，本基金管理人未发生重大人事变动。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本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 (%) |    |
| 广发证券   | 1      | 2,297,196,858.96 | 59.65            | 2,139,383.72 | 59.87          |    |
| 东吴证券   | 1      | 716,309,129.65   | 18.60            | 667,100.49   | 18.67          |    |
| 中泰证券   | 1      | 563,930,728.08   | 14.64            | 513,911.27   | 14.38          |    |
| 瑞银证券   | 2      | 54,401,513.08    | 1.41             | 50,660.75    | 1.42           |    |
| 长江证券   | 1      | 46,442,542.66    | 1.21             | 43,251.76    | 1.21           |    |
| 信达证券   | 1      | 36,934,460.96    | 0.96             | 33,658.40    | 0.94           |    |
| 国泰君安   | 1      | 28,687,032.80    | 0.74             | 26,142.65    | 0.73           |    |
| 兴业证券   | 1      | 25,706,544.25    | 0.67             | 23,940.60    | 0.67           |    |
| 中金公司   | 2      | 24,211,580.62    | 0.63             | 22,548.31    | 0.63           |    |
| 中信建投证券 | 1      | 16,849,083.83    | 0.44             | 15,691.59    | 0.44           |    |

|        |   |               |      |           |      |  |
|--------|---|---------------|------|-----------|------|--|
| 国海证券   | 2 | 16,825,259.66 | 0.44 | 15,333.12 | 0.43 |  |
| 中信证券   | 2 | 11,609,007.16 | 0.30 | 10,579.37 | 0.30 |  |
| 国信证券   | 2 | 7,103,505.96  | 0.18 | 6,615.51  | 0.19 |  |
| 中银国际   | 1 | 2,981,306.61  | 0.08 | 2,776.59  | 0.08 |  |
| 东北证券   | 2 | 935,937.03    | 0.02 | 871.67    | 0.02 |  |
| 东方证券   | 3 | 617,203.19    | 0.02 | 568.35    | 0.02 |  |
| 申万宏源证券 | 1 | 615,473.46    | 0.02 | 573.17    | 0.02 |  |
| 海通证券   | 1 | 11,508.04     | 0.00 | 10.72     | 0.00 |  |
| 长城证券   | 2 | -             | -    | -         | -    |  |
| 东兴证券   | 1 | -             | -    | -         | -    |  |
| 恒泰证券   | 2 | -             | -    | -         | -    |  |
| 华泰证券   | 2 | -             | -    | -         | -    |  |
| 华西证券   | 1 | -             | -    | -         | -    |  |
| 平安证券   | 1 | -             | -    | -         | -    |  |
| 太平洋证券  | 2 | -             | -    | -         | -    |  |
| 银河证券   | 1 | -             | -    | -         | -    |  |

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |      | 债券回购交易 |     | 权证交易 |     | 基金交易 |     |
|------|------|------|--------|-----|------|-----|------|-----|
|      | 成交金额 | 占当期债 | 成交     | 占当期 | 成交   | 占当期 | 成交   | 占当期 |

|                |               | 券成交总<br>额的比例<br>(%) | 金额 | 债券回<br>购成交<br>总额的比例 (%) | 金额 | 权证成<br>交总额<br>的比例<br>(%) | 金额 | 基金成<br>交总额<br>的比例<br>(%) |
|----------------|---------------|---------------------|----|-------------------------|----|--------------------------|----|--------------------------|
| 广发<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 东吴<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 中泰<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 瑞银<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 长江<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 信达<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 国泰<br>君安       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 兴业<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 中金<br>公司       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 中信<br>建投<br>证券 | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 国海<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 中信<br>证券       | 21,303,527.53 | 100.00              | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 国信<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 中银<br>国际       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 东北<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 东方<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 申万<br>宏源<br>证券 | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 海通<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |
| 长城<br>证券       | -             | -                   | -  | -                       | -  | -                        | -  | -                        |

|       |   |   |   |   |   |   |   |   |
|-------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 东兴证券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券  | - | - | - | - | - | - | - | - |

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

(2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

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

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

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

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 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  | 汇添富基金旗下 164 只基金 2020 年 4 季度报告                                | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2021 年 01 月 22 日 |
| 2  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年年度报告                                 | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2021 年 03 月 30 日 |
| 3  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告                          | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2021 年 03 月 31 日 |
| 4  | 汇添富基金管理股份有限公司关于中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告             | 中证报, 公司网站, 深交所      | 2021 年 04 月 02 日 |
| 5  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金修订的招募说明书、产品资料概要                           | 上交所, 公司网站, 深交所      | 2021 年 04 月 02 日 |
| 6  | 汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告                             | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2021 年 04 月 22 日 |
| 7  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加第一创业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 | 2021 年 05 月 19 日 |
| 8  | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中信证券华南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 | 2021 年 06 月 09 日 |
| 9  | 汇添富基金管理股份有限公司关于中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分业务并调整最小申购、赎回单位的公告 | 中证报, 公司网站, 深交所      | 2021 年 06 月 21 日 |
| 10 | 汇添富基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告                                    | 上交所, 上证报, 公司网站, 深交所 | 2021 年 06 月 24 日 |
| 11 | 汇添富基金管理股份有限公司关于中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复申购、赎回的公告       | 中证报, 公司网站, 深交所      | 2021 年 06 月 25 日 |
| 12 | 中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2021 年 6 月 25 日更新)              | 公司网站, 深交所           | 2021 年 06 月 25 日 |
| 13 | 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中金财富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 | 2021 年 06 月 29 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

| 投资者类别              | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                 |                |                  |               | 报告期末持有基金情况       |          |
|--------------------|----------------|---------------------------------|----------------|------------------|---------------|------------------|----------|
|                    | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间         | 期初份额           | 申购份额             | 赎回份额          | 持有份额             | 份额占比 (%) |
| 中国工商银行股份有限公司—汇添富中证 | 1              | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 916,445,876.00 | 2,829,337,628.00 | 70,000,000.00 | 3,675,783,504.00 | 54.56    |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |  |  |  |  |  |  |  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|
| 主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金                                                                                                                                                                                                                                                                                      |  |  |  |  |  |  |  |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |  |  |  |  |  |  |  |
| <p>1、持有人大会投票权集中的风险<br/>当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险<br/>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险<br/>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p> |  |  |  |  |  |  |  |

## 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主要消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

- 3、《中证主要消费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、报告期内中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金在指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

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

## 12.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 08 月 31 日