

# 汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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 .....	6
§ 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 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
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 .....	13
§ 5 托管人报告 .....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
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 .....	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	14
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	17
§ 7 投资组合报告 .....	41
7.1 期末基金资产组合情况 .....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	41
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 .....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	41
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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 本报告期投资基金情况.....	42
7.13 投资组合报告附注.....	48
§ 8 基金份额持有人信息 .....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	49
§ 9 开放式基金份额变动 .....	49
§ 10 重大事件揭示 .....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	50
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§ 12 备查文件目录 .....	55
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	汇添富聚焦价值成长三个月混合 FOF
基金主代码	008168
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 07 月 13 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）	1,496,590,363.93
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金遵循“价值与成长并重”的理念，并通过全方位的定量和定性分析方法精选出基金管理人旗下优质基金构建投资组合，以适度稳定的资产配置策略有效综合基金管理人主动投资管理能力，实现基金资产的长期、持续、稳定增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60% +中债综合指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

## § 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	261,545,367.84
本期利润	173,166,788.98
加权平均基金份额本期利润	0.0906
本期加权平均净值利润率	7.88%
本期基金份额净值增长率	7.68%
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	232,685,665.68
期末可供分配基金份额利润	0.1555
期末基金资产净值	1,822,814,492.35
期末基金份额净值	1.2180
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	21.80%

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。

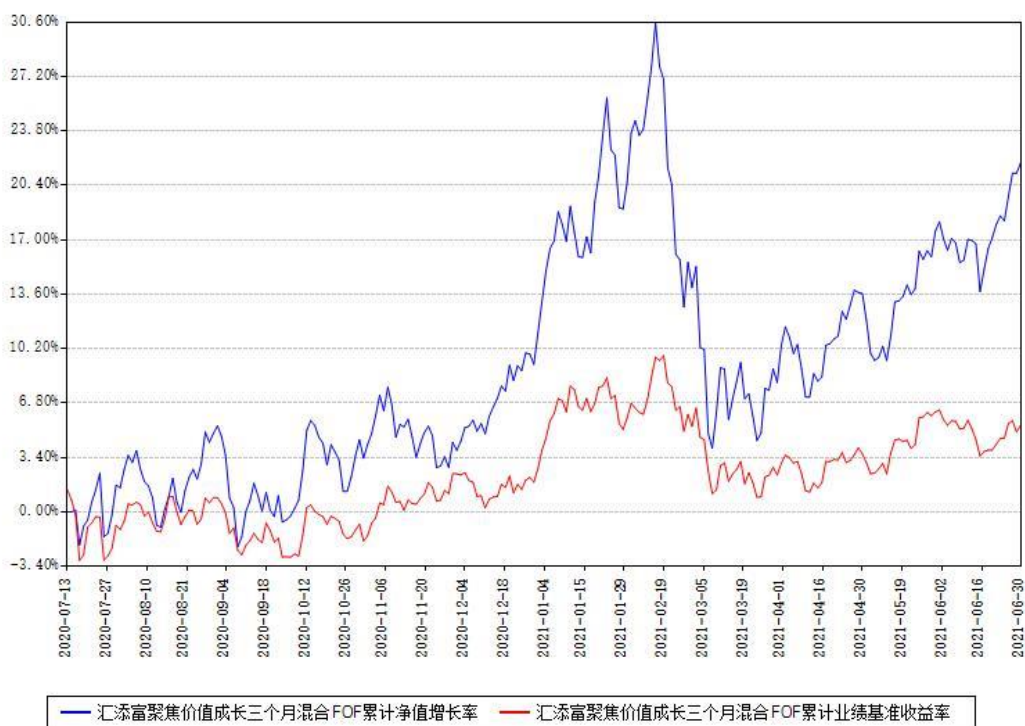
### 3.2 基金净值表现

### 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	3.61%	0.93%	-0.78%	0.46%	4.39%	0.47%
过去三个月	12.68%	0.98%	3.02%	0.53%	9.66%	0.45%
过去六个月	7.68%	1.50%	1.50%	0.73%	6.18%	0.77%
自基金合同生效日起至今	21.80%	1.31%	5.41%	0.74%	16.39%	0.57%

### 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

汇添富聚焦价值成长三个月混合FOF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本《基金合同》生效之日为 2020 年 07 月 13 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为自《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5 号文批准，于 2005 年 2 月 3 日正式成立。目前，公司注册资本金为 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		
袁建军	本基金的基金经理，公司副总经理、投资决策委员会主席	2020 年 07 月 13 日		24	国籍:中国。学历:金融学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于

					<p>2014 年至 2015 年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005 年 4 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。2007 年 3 月 12 日至 2009 年 7 月 29 日任汇添富成长焦点混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月 26 日至今任汇添富积极投资核心优势三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2020 年 7 月 13 日至今任汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。</p>
李彪	本基金的基金经理助理	2020 年 11 月 23 日		14	<p>国籍:中国。学历:中国科技大学经济学学士，杜伦大学（University of Durham）国际银行与金融学硕士。从业资格:证券投资基金从业资格, 期货从业资格, 养老 FOF 基金经理资格。从业经历:2008 年 5 月至 2012 年 4 月担任国元证券客户资产管理总部投资经理，2012 年 4 月至 2017 年 4 月担任平安资产管理公司基金投研部投资经理。2017 年 4 月至今担任汇添富基金管理</p>

					<p>股份有限公司资产配置中心投资经理。</p> <p>2020年7月28日至今任汇添富养老目标日期2040五年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。</p> <p>2020年7月28日至今任汇添富养老目标日期2050五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2020年11月23日至今任汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理助理。2020年11月23日至今任汇添富积极投资核心优势三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理助理。</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中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 年上半年市场震荡剧烈，春节前后市场变化较大。春节前市场基本延续了过去两年的趋势，以消费医药为代表的核心资产继续大幅上涨。春节后 10 年期美债收益率上行触发了核心资产的大幅调整，春节后到 3 月底核心资产的跌幅基本都在 20% 以上。美债收益率上行只是表象，本质上经过两年的大幅上涨后核心资产的估值偏贵，而且这类资产业绩增速会比较平稳，增长的可预测性很强但同时大幅度超预期增长的可能较低。当阶段性增速和估值不匹配时就引发了较大幅度的调整。二季度以来市场出现较大分化，创业板指代表的高景

气类资产包括新能源汽车、光伏、半导体大幅上涨，同时白酒代表的消费类资产不断下行。整个上半年指数分化显著，沪深 300、中证 800、创业板指分别上涨 0.24%、1.72%、17.22%。

去年年报中我们明确写到在全球流动性充裕的大背景下国内外的核心资产都存在估值的泡沫化风险，同时我们也警惕两年上涨后核心资产的投资风险。但春节后市场的调整在时间和契机上还是超出了我们的预期，也导致我们的应对不够及时迅速，由于本基金春节前的持仓中偏核心资产风格的底层基金占比较高，因此在市场调整中本基金也产生了较大幅度的回撤，这也值得我们反思和提高。

在市场的调整中我们认为流动性仍然充裕，在核心资产合理偏贵的背景下，资金会不断寻找其他的结构性投资机会。而代表高端制造的几类资产是政策鼓励的硬科技方向，长期的产业趋势和逻辑无懈可击，中短期的行业基本面和景气度非常强劲，市场的调整提供了非常好的布局时机。本基金在二季度逐步降低了部分消费类基金的配置，增加了上述方向的配置。

本基金聚焦在汇添富基金公司内部精选优质的基金并重仓持有。“选股专家”优异的主动投资能力及丰富的产品布局为本基金提供了大量优质的底层资产。整个上半年基于精选底层基金和对组合的动态优化调整，本基金大幅跑赢业绩基准，取得了较好的投资回报。

#### 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 7.68%。同期业绩比较基准收益率为 1.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先从流动性环境看，当前市场流动性充裕，货币政策基调偏松。居民财富再配置的大逻辑仍然存在，资金仍在持续的通过公募基金流入证券市场。其次，从政策导向看产业政策仍然是鼓励发展先进制造业，支持新能源加快发展。从过去 2 年的贷款增速和新股 IPO 来看，支持制造业发展的方向非常显著。未来 2-3 年甚至更长时期内，先进制造板块可能会成为市场的核心投资主题之一。从中短期基本面来看新能源汽车、光伏、半导体、创新医药等基本面仍然强劲，产业链景气度依旧很高。再次，下半年的经济增速大概率缓慢下行，但是有基建作为后备政策，经济也不存在失速的风险。

基于以上分析我们未来会加强在先进制造方向的布局。投资要看大的经济背景和产业发展趋势，而不能拘泥于短期估值的高低。回归到现金流折现模型的本质，估值应该是基于企业动态和长期的增长。PE 和 PB 只是静态的截面信息，并不能充分反映企业长期增长和发展的全貌，也不能作为对上市公司估值的主要标准。

在积极把握结构性投资机会的同时，我们也必须注意到由于短期内上涨速度较快，优质

资产的波动也可能加大，我们也要从组合管理的角度做好应对。下半年来看，市场可能的主要风险还是美联储货币政策转向，目前看在四季度美联储有一定概率宣布削减 QE 额度，我们会密切关注可能的风险。

FOF 型公募基金的特点是组合更加分散，组合的波动及回撤相对较低，中长期更加有利于实现稳健增值，因此本基金更适合看作投资中的“马拉松选手”，而不是一个 500 米选手。投资者要充分享受长期的复利增值，唯一需要付出的是时间和耐心。因此我们希望本基金的持有人能够尽量坚持长期投资，而不要基于短期的交易进行频繁的申赎。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

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，本基金托管人在对汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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，汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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：汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

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 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	97,531,299.82	119,082,247.30
结算备付金		-	928,315.08
存出保证金		11,473.31	14,076.74
交易性金融资产	6.4.7.2	1,762,032,834.63	3,151,081,427.72
其中：股票投资		-	-
基金投资		1,701,932,834.63	3,048,115,457.72

债券投资		60,100,000.00	102,965,970.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,247,466.55	1,042,368.08
应收股利		-	-
应收申购款		698,425.20	5,263,912.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,861,521,499.51	3,277,412,347.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<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		-	-
应付赎回款		38,386,156.97	89,952,919.70
应付管理人报酬		103,962.87	168,248.93
应付托管费		104,412.83	172,109.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	112,474.49	386,012.18
负债合计		38,707,007.16	90,679,289.95
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,496,590,363.93	2,817,406,996.10
未分配利润	6.4.7.1 0	326,224,128.42	369,326,061.65
所有者权益合计		1,822,814,492.35	3,186,733,057.75
负债和所有者权益总计		1,861,521,499.51	3,277,412,347.70

注：1、报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2180 元，基金份额总额 1,496,590,363.93 份。

2、本基金合同生效日为 2020 年 07 月 13 日，上年度实际可比期间为 2020 年 07 月 13 日至 2020 年 12 月 31 日，特此说明。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

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 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>178,023,600.84</b>
1. 利息收入		1,129,415.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	111,640.48
债券利息收入		1,017,775.39
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		264,613,840.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益	6.4.7.13	255,552,698.77
债券投资收益	6.4.7.14	131,731.10
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	8,929,410.58
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-88,378,578.86
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	658,923.38
<b>减：二、费用</b>		<b>4,856,811.86</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	656,522.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	813,052.65
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	3,235,563.61
5. 利息支出		47,423.25
其中：卖出回购金融资产支出		47,423.25
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.21	104,250.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>173,166,788.98</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>173,166,788.98</b>

注：本基金合同于 2020 年 07 月 13 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

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 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）	2,817,406,996.10	369,326,061.65	3,186,733,057.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	173,166,788.98	173,166,788.98
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）	-1,320,816,632.17	-216,268,722.21	-1,537,085,354.38
其中：1. 基金申购款	143,422,520.40	28,711,308.98	172,133,829.38
2. 基金赎回款	-1,464,239,152.57	-244,980,031.19	-1,709,219,183.76
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）	1,496,590,363.93	326,224,128.42	1,822,814,492.35

注：本基金合同于 2020 年 07 月 13 日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

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：

财务报表由下列负责人签署：

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）（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[2019]1865 号文《关于准

予汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司于2020年4月9日起至2020年7月8日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第60466941\_B34号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2020年7月13日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币4,472,139,013.97元，在募集期间产生的利息为人民币1,369,423.39元，以上实收基金（本息）合计为人民币4,473,508,437.36元，折合4,473,508,437.36份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（以下简称“证券投资基金”，包含封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金（LOF）和交易型开放式指数基金（ETF）、QDII基金、香港互认基金等）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于股票（包含主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

#### 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 2021 年 06 月 30 日
活期存款	97,531,299.82
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	97,531,299.82

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 06 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	59,909,411.30	60,100,000.00	190,588.70
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	59,909,411.30	60,100,000.00	190,588.70
资产支持证券	-	-	-	
基金	1,440,034,777.08	1,701,932,834.63	261,898,057.55	
其他	-	-	-	
合计	1,499,944,188.3	1,762,032,834.6	262,088,646.25	

	8	3	
--	---	---	--

#### 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 2021年06月30日
应收活期存款利息	8,413.92
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	-
应收债券利息	1,239,047.95
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	-
其他	4.68
合计	1,247,466.55

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

注：本基金本报告期末无应付交易费用余额。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,336.14
应付证券出借违约金	-
应付审计费	44,630.98

应付信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
其他	-
合计	112,474.49

#### 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	2,817,406,996.10	2,817,406,996.10
本期申购	143,422,520.40	143,422,520.40
本期赎回（以“-”号填列）	-1,464,239,152.57	-1,464,239,152.57
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,496,590,363.93	1,496,590,363.93

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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	89,243,732.87	280,082,328.78	369,326,061.65
本期利润	261,545,367.84	-88,378,578.86	173,166,788.98
本期基金份额交易产生的变动数	-118,103,435.03	-98,165,287.18	-216,268,722.21
其中：基金申购款	14,780,249.18	13,931,059.80	28,711,308.98
基金赎回款	-132,883,684.21	-112,096,346.98	-244,980,031.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	232,685,665.68	93,538,462.74	326,224,128.42

#### 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	108,923.93
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	1,234.66
其他	1,481.89
合计	111,640.48

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	2,594,338,303.18
减：卖出/赎回基金成本总额	2,338,785,604.41
基金投资收益	255,552,698.77

#### 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
	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	52,867,186.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	51,855,593.20
减：应收利息总额	879,862.09
买卖债券差价收入	131,731.10

##### 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
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	8,929,410.58
合计	8,929,410.58

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-88,378,578.86
——股票投资	-
——债券投资	-2,331.30
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-88,376,247.56
——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	-88,378,578.86

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	658,923.38
替代损益	-
其他	-
合计	658,923.38

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	61.95
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	3,235,501.66

其中：申购费	-
赎回费	1,887,628.48
转换费	1,347,873.18
交易费	-
合计	3,235,563.61

#### 6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

金额单位：人民币元

项目	本期费用
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	14,523,080.58
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	2,389,160.32

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	112.00
指数使用费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	104,250.35

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情

况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
中国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

注: 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	60,979,278.80	100.00

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例 (%)
东方证券	158,000,000.00	100.00

##### 6.4.10.1.4 基金交易

注: 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

##### 6.4.10.1.5 权证交易

注: 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注: 本基金本报告期不存在向关联方支付佣金的情况。

## 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
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	656,522.00
其中：支付销售机构的客户维护费	3,925,250.82

注：本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人自身管理的基金所对应的资金资产净值后余额（若为负数，则取0）的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金所对应的资金资产净值后余额，若为负数，则取0

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	813,052.65

注：本基金对基金财产中持有的本基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人自身托管的基金所对应的资金资产净值后余额（若为负数，则取0）的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除所持有本基金托管人自身托管的其他基金所对应的资金资产净值后余额，若为负数，则取0

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人本报告期末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：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

#### 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	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	97,531,299.82	108,923.93

#### 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：本基金本报告期末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。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月
----	----------------------------------

	30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	1,887,628.48
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	14,523,080.58
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	2,389,160.32
当期持有基金产生的应支付交易费（元）	-
当期持有基金产生的应支付转换费（元）	1,347,873.18

注：上述费用为本基金持有管理人及管理人关联方所管理的基金产生的费用，申购费、赎回费是实际产生的费用，销售服务费、管理费和托管费等其他费用为估算费用；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

#### 6.4.12 期末（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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 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

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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 202 1 年 06 月 30 日	1 个月以内	1- 3 个 月	3 个月-1 年	1- 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	97,531,299.82	-	-	-	-	-	97,531,299.82
结 算 备 付 金	-	-	-	-	-	-	-
存 出 保	11,473.31	-	-	-	-	-	11,473.31

证金							
交易性金融资产	60,100,000.00	-	-	-	-	1,701,932,834.63	1,762,032,834.63
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,247,466.55	1,247,466.55
应收申购款	121,840.29	-	-	-	-	576,584.91	698,425.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-

他资产							
资产总计	157,764,613.42	-	-	-	-	1,703,756,886.09	1,861,521,499.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	38,386,156.97	38,386,156.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	103,962.87	103,962.87
应付托管费	-	-	-	-	-	104,412.83	104,412.83
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	-	-

销售服务费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	112,474.49	112,474.49
负债总计	-	-	-	-	-	38,707,007.16	38,707,007.16
利率敏感度缺口	157,764,613.42	-	-	-	-	1,665,049,878.93	1,822,814,492.35
上年度末 2020 年	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

12月31日							
资产							
银行存款	119,082,247.30	-	-	-	-	-	119,082,247.30
结算备付金	928,315.08	-	-	-	-	-	928,315.08
存出保证金	14,076.74	-	-	-	-	-	14,076.74
交易性金融资产	-	-	102,965,970.00	-	-	3,048,115,457.72	3,151,081,427.72
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,042,368.08	1,042,368.08
应收申购款	256,889.13	-	-	-	-	5,007,023.65	5,263,912.78
衍生金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	120,281,528.25	-	102,965,970.00	-	-	3,054,164,849.45	3,277,412,347.70
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	89,952,919.70	89,952,919.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	168,248.93	168,248.93
应付托管费	-	-	-	-	-	172,109.14	172,109.14

应付 证券 清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出 回购 金融 资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
其他 负	-	-	-	-	-	386,012.18	386,012.18

债							
负债总计	-	-	-	-	-	90,679,289.95	90,679,289.95
利率敏感度缺口	120,281,528.25	-	102,965,970.00	-	-	2,963,485,559.50	3,186,733,057.75

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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 06 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	6,581.66	137,384.95
基准利率增加 25 个基点	-6,580.24	-137,019.36	

#### 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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	1,701,932,834.63	93.37	3,048,115,457.72	95.65
交易性金融资产—债券投资	60,100,000.00	3.30	102,965,970.00	3.23
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	1,762,032,834.63	96.67	3,151,081,427.72	98.88

注:本基金为混合型基金中基金(FOF),投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%,其中投资于股票型证券投资基金、偏股混合型证券投资基金(指基金合同中约定股票及存托凭证投资比例不低于 60%的混合型证券投资基金)的比例合计为基金资产的 55%-85%,投资于货币市场基金的比例不高于基金资产的 15%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别,法律法规另有规定的从其规定。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 800 指数	-82,669,964.62	-114,991,867.14

	下跌 5%		
	中证 800 指数	82,669,964.62	114,991,867.14
	上涨 5%		

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,701,932,834.63	91.43
3	固定收益投资	60,100,000.00	3.23
	其中：债券	60,100,000.00	3.23
	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	97,531,299.82	5.24
8	其他资产	1,957,365.06	0.11
9	合计	1,861,521,499.51	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

注：本基金本报告期末投资股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	60,100,000.00	3.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	60,100,000.00	3.30

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019640	20 国债 10	601,000	60,100,000.00	3.30

### 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：本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 本报告期投资基金情况

#### 7.12.1 投资政策与风险说明

1. 投资政策：

### （1）核心投资策略

本基金使用 Fama-French 三因子模型分析基金风格特征（大小盘、价值成长）。基于对市场中长期投资趋势的判断，精选基金管理人旗下不同风格类优质主动权益类基金构建核心组合，并采取均衡风格配置，兼顾价值和成长风格。同时，根据证券市场运行所处的不同阶段，对核心组合进行适时调整，把握市场风格切换带来的投资机会，以实现较好的中长期投资回报。

Fama-French 三因子模型将基金收益率序列回归到市场因子、市值因子和估值因子，通过对回归结果的分析可以判断基金持股的大小盘、成长价值风格。若基金收益率系列在估值因子上具有正向显著暴露则表明基金持股更偏价值，若具有负向显著暴露则表明基金持股偏成长，若在估值因子上暴露不显著则表明基金持股没有明显的价值成长偏向。此外，通过对基金重仓股和全部持股的估值水平、盈利水平、成长能力等的分析可以进一步明确基金成长价值风格的判断。

本基金根据基金管理人 FOF 基金经理精选方法，通过金字塔定性分析框架和量化立体分析模型交叉验证的方式，判断基金产品风格和基金经理风格是否匹配。基金管理人对旗下基金的基金经理提出“三化”要求，即风格稳定化、业绩持续化和价值观正确化。基金经理在投资中做到投资风格不偏移、投资业绩长期可持续，以及始终确保价值观正确，以此形成基金业绩的坚实保障，为投资者带来长期持续稳定的投资回报，也是本基金实现长期增值的基础。基于对不同风格基金的深入研究，本基金将运用各有效指标进行基金筛选，剔除投资风格不稳定的基金。

本基金将采用定量和定性分析相结合的方法进行基金精选，按照“设定核心配置比例—精选优质基金—构建核心组合”的路径，实现核心投资策略。具体而言主要包括以下方面：

**设定核心配置比例：**结合对市场中长期投资趋势的研判、本基金风格定位和业绩比较基准中不同行业的占比和权重等因素，初步设定本基金核心组合在不同风格类基金中的投资比例；并根据基金管理人对市场短、中、长期发展走势的分析和预期，适度调整本基金核心组合在不同风格类基金中的投资比例。

**精选优质基金：**定量和定性相结合的方式精选基金，本基金根据基金的历史业绩、风险调整后的收益、基金的规模和流动性、基金评级等一系列量化指标对基金进行分析，并运用基金分析评价体系，对基金进行表现分析、归因分析和风险分析：

- 1) 基金的表现分析：分析并确认基金绝对和相对表现优于同类基金平均水平；
- 2) 基金表现的归因分析：了解基金的择时和选券能力；

3) 基金的风险分析：确认基金总体投资风险水平适当可控，分析风险的来源。

构建核心组合：基金管理人在前述配置比例基础上，根据本基金的投资决策流程审慎精选，并在权衡风险收益特征后，最终科学合理地构建出核心投资组合。

#### (2) 卫星投资策略

基金管理人对行业投资机会的把握贯穿于投资的全过程，在市场环境的各种变化中，本基金将始终坚持寻找最优性价比的行业基金来提升组合收益率。本基金将采用定量和定性分析相结合的方法进行基金精选，按照“挖掘优势行业—优选代表基金—构建卫星组合”的路径，实现卫星投资策略。具体而言主要包括以下方面：

**挖掘优势行业：**本基金管理人深入研究宏观经济和行业周期等因素，挖掘经济周期变化中的具有超额投资收益的行业投资机会，分析本基金投资此类行业获得超额收益的可行性，最终定位卫星策略投资的优势行业。

**优选代表基金：**根据卫星策略投资的优势行业，本基金管理人从定性和定量两方面选择旗下最优和最具代表性的行业基金。

**构建卫星组合：**结合定量和定性研究结论，根据本基金的投资决策流程审慎精选，运用最优化技术实现卫星组合配置，并随着行业轮动过程中不同行业面临的不同投资机会，适时动态调整。

#### 2. 风险说明：

本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，净值表现将主要受其投资的其他基金表现之影响，并须承担投资其他基金有关的风险，其中包括市场、利率、货币、经济、流动性和政治等风险。

本基金除了承担投资其他基金的管理费、托管费和销售费用（其中申购本基金基金管理人自身管理的其他基金不收取申购费、赎回费（不包括按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金财产的赎回费用）、销售服务费等）外，还须承担本基金本身的管理费、托管费和销售费用（其中不收取基金财产中持有本基金管理人管理的其他基金部分的管理费、本基金托管人托管的其他基金部分的托管费），因此，本基金最终获取的回报与直接投资于其他基金获取的回报存在差异。

本基金主动管理风险指的是基金经理对基金的主动性操作导致的风险。本基金为主动管理型的基金中基金，在精选基金的操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的基金的业绩表现并不一定持续的优于其他基金。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	004424	汇添富文体娱乐混合	契约型开放式	69,416,885.48	207,188,578.09	11.37	是
2	470006	汇添富医药保健混合	契约型开放式	50,110,466.84	187,663,698.32	10.30	是
3	000696	汇添富环保行业股票	契约型开放式	59,911,292.87	162,179,869.80	8.90	是
4	470098	汇添富逆向投	契约	34,588,282.18	149,455,967.30	8.20	是

		资混合	型 开 放 式				
5	519068	汇添富 成长焦 点混合	契 约 型 开 放 式	33,612,109.88	120,052,372.86	6.59	是
6	002959	汇添富 盈泰混 合	契 约 型 开 放 式	38,282,798.19	100,683,759.24	5.52	是
7	001668	汇添富 全球互 联混合 (QDII)	契 约 型 开 放 式	32,427,524.83	97,704,132.31	5.36	是
8	000925	汇添富 外延增 长主题 股票 A	契 约 型 开 放 式	41,943,081.21	79,607,968.14	4.37	是
9	006408	添富消 费升级 混合	契 约 型 开 放 式	26,607,085.75	78,387,135.33	4.30	是
10	501057	汇添富 中证新 能源汽 车产业 指数 (LOF)A	契 约 型 开 放 式	25,058,252.89	68,762,351.76	3.77	是
11	006884	添富 AAA 级信用 纯债 A	契 约 型 开	61,504,473.80	67,033,725.99	3.68	是

			放式				
12	004270	汇添富民丰回报混合 A	契约型开放式	38,696,619.86	61,407,666.06	3.37	是
13	006308	添富全球消费混合 (QDII) 人民币 A	契约型开放式	21,843,962.03	60,289,335.20	3.31	是
14	000174	汇添富高息债债券 A	契约型开放式	35,872,136.54	56,283,382.23	3.09	是
15	006259	添富红利增长混合 A	契约型开放式	28,556,155.17	55,753,037.35	3.06	是
16	470018	汇添富双利债券 A	契约型开放式	26,437,369.29	54,540,292.85	2.99	是
17	004877	添富全球医疗混合 (QDII) 人民币	契约型开放式	13,407,750.26	33,874,681.03	1.86	是
18	005351	添富行业整合混合	契约型开放式	12,071,463.06	26,263,882.18	1.44	是

19	001685	汇添富沪港深新价值股票	契约型开放式	13,221,302.98	24,565,180.94	1.35	是
20	002419	汇添富盈安混合	契约型开放式	4,592,107.44	10,235,807.48	0.56	是
21	005590	添富鑫永定开债券 A	契约型开放式	9.53	10.17	0.00	是

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1

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。

#### 7.13.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,473.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,247,466.55
5	应收申购款	698,425.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,957,365.06

#### 7.13.4 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。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
28,906	51,774.38	43,735,959.24	2.92	1,452,854,404.69	97.08

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	188,593.46	0.01

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发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（2020年07月13日）基金份额总额	4,473,508,437.36
本报告期期初基金份额总额	2,817,406,996.10
本报告期基金总申购份额	143,422,520.40
减：本报告期基金总赎回份额	1,464,239,152.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,496,590,363.93

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

注：本基金本报告期持有的基金无重大影响事件。

### 10.6 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）。

### 10.7 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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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	佣金	占当期佣金	

			成交总额的 比例 (%)		总量的比例 (%)	
东方证券	3	-	-	-	-	
长城证券	2	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东吴证券	1	-	-	-	-	
东兴证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国海证券	2	-	-	-	-	
国泰君安	1	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
海通证券	1	-	-	-	-	
恒泰证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
华西证券	1	-	-	-	-	
平安证券	1	-	-	-	-	
瑞银证券	2	-	-	-	-	
申万宏源 证券	1	-	-	-	-	
太平洋证 券	2	-	-	-	-	
信达证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投 证券	1	-	-	-	-	
中信证券	2	-	-	-	-	
中银国际	1	-	-	-	-	

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

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券 商 名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的	成 交 金 额	占当 期权 证成 交总	成 交 金 额	占当 期基 金成 交总

		(%)		比例 (%)		额的 比例 (%)		额的 比例 (%)
东方 证券	60,979,278.80	100.00	158,000,000.00	100.00	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海	-	-	-	-	-	-	-	-

通 证 券									
恒 泰 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华 泰 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华 西 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平 安 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞 银 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申 万 宏 源 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太 平 洋 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信 达 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴 业 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银 河	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

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

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理机构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。

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的提示性公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2021 年 01 月 09 日
2	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
3	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
4	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 04 月 20 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所	2021 年 04 月 21 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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件；

2、《汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

3、《汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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