

汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 2020 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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
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	61
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	61
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	61
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	61

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
§ 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.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
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.....	71
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.....	71
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	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富沪深 300ETF
场内简称	添富 300
基金主代码	515310
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 04 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	27,611,220.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 25 日

注：本基金扩位证券简称为沪深 300 添富 ETF

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	张燕
	联系电话	021-28932888	0755-83199084
	电子邮箱	service@99fund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-9918	95555
传真		021-28932998	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码	200120	518040
法定代表人	李文	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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(2020 年 01 月 01 日 - 2020 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	2,800,892.39
本期利润	1,489,153.27
加权平均基金份额本期利润	0.0276
本期加权平均净值利润率	2.78%
本期基金份额净值增长率	2.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	1,359,235.17
期末可供分配基金份额利润	0.0492
期末基金资产净值	29,005,022.31
期末基金份额净值	1.0505
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	5.05%

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	8.39%	0.89%	7.68%	0.90%	0.71%	-0.01%
过去三个月	14.04%	0.89%	12.96%	0.90%	1.08%	-0.01%
过去六个月	2.67%	1.48%	1.64%	1.52%	1.03%	-0.04%
自基金合同生效日起至今	5.05%	1.37%	8.12%	1.44%	-3.07%	-0.07%

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

添富沪深300ETF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 2019 年 12 月 04 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，截止本报告期末，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。

2020 上半年，汇添富基金新成立 11 只公开募集证券投资基金，包括 4 只债券型基金、5 只混合型基金、1 只基金中基金、1 只指数基金联接基金。截至 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 154 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		
董瑾	本基金的基金经理	2019 年 12 月 05 日		11	国籍：中国。学历：北京大学西方经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经

					理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司，2017 年 12 月 18 日至 2019 年 8 月 27 日任上证上海改革发展主题 ETF 的基金经理助理，2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任上海国企 ETF 联接、汇添富沪深 300 指数（LOF）、汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经理助理，2019 年 12 月 4 日至今任添富沪深 300ETF 的基金经理，2019 年 12 月 31 日至今任上海国企 ETF 联接、汇添富沪深 300 指数（LOF）、汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经理，2020 年 3 月 5 日任添富中证国企一带一路 ETF 联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”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：本报告期末本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、营运、风险管理以及合规稽核等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

对于同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。根据 95%置信区间下平均价差率的 T 检验显著程度、同向交易占优比等方面进行综合分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。本报告期内，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本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 34 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初新冠疫情的爆发和石油价格波动等因素对经济金融产生了较大影响。二季度以来，随着统筹推进疫情防控和经济社会发展成效显现，生产需求持续改善，就业物价总体平稳，积极因素累积增多，国内经济继续呈现恢复态势，主要经济指标与一季度相比明显改善。但当前境外公共卫生事件仍在继续发展演变，外部风险挑战增多，国内经济恢复仍然面临压力。总体而言，推动经济持续复苏有较好的基础和条件，宏观政策效应亦在逐步显现。

政策方面，按照《政府工作报告》要求，在疫情防控常态化前提下，围绕做好“六稳”工作、落实“六保”任务，狠抓各项政策举措落实落地，着力稳企业保就业，努力实现全年经济社会发展目标。今年为企业新增减负预计超过 2.5 万亿元，发行 1 万亿元抗疫特别国债，新增 1 万亿元财政赤字规模，货币信贷支持力度加大，这些政策预计将继续支持后期经济恢复。

资本市场方面，一季度全球金融资产价格波动幅度加大，流动性冲击引发美元回流。之后全球央行出台积极应对政策，资金面有所恢复，以北上资金为代表的外资亦在二季度加大了对 A 股的配置。当前流动性维持合理充裕，资金利率处于较低水平。宏观流动性的充裕有利于推动资金向股市微观流动性传导，权益市场流动性格局较好。

上半年 A 股行业分化明显，由于全球疫情形势严峻，投资者对疫情冲击下的基本面预期并不明朗，资金更加青睐医药板块、确定性较高的必选消费和中长期行业景气度较高的科技板块。

报告期内，本基金完成了基金建仓，保持了指数基金的本质属性，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 2.67%。同期业绩比较基准收益率为 1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济复苏态势明显，经济或将整体趋稳。二季度末，除防疫用品、电子产品外的一般出口已初步呈现修复态势，预计下半年随欧美复工推进继续好转；专项债、特别国债等广义财政仍待进入落地密集期，基建增速预计将持续高位；而制造业投资也在修复趋势中；服务业当前恢复程度仍低，未来将继续趋势性回升。但同时，市场主体压力和就业压力仍然较为明显，经济压力仍未完全解除。海外疫情发展仍不乐观。随着美国大选临近，中美关系短期内不确定性增加，但是中长期内超市场预期程度可能有限。

下半年宏观政策上预计将维持宽财政、稳货币的组合。财政政策方面，国务院常务会议提出“各地要加快专项债发行和使用，支持两新一重、公共卫生设施建设。”货币政策方面，央行表示“下半年稳健的货币政策要更加灵活适度，保持总量的适度，综合利用各种货币政策工具，保持流动性合理充裕。”

资本市场方面，我们认为宽松的流动性、经济复苏和深化资本市场改革三大因素或将对 A 股形成支撑，更多行业板块将迎来配置机遇。下半年稳增长政策下，地产、基建投资持续回升，基建作为主要抓手，有望进一步发力。若基本面回升至正常水平后，市场交易的逻辑或将从偏防守的确定性逻辑转向偏进攻的成长性逻辑。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，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，实现投资目标。

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：每一基金份额享有同等分配权；本基金的收益分配采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益

分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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

本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	6.4.7.1	2,460,244.48	16,768,206.30
结算备付金		614,299.49	2,795,083.19
存出保证金		339,176.86	864,750.00
交易性金融资产	6.4.7.2	26,503,508.00	111,097,434.20
其中：股票投资		26,495,108.00	111,088,934.20
基金投资		-	-
债券投资		8,400.00	8,500.00
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		-	5,545,304.59
应收利息	6.4.7.5	504.19	17,402.97
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		29,917,733.02	137,088,181.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		834,656.11	11,730,554.57
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,297.90	27,936.33
应付托管费		1,432.66	9,312.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,044.82	286,123.14
应交税费		-	2,333.87
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	58,279.22	85,217.39
负债合计		912,710.71	12,141,477.42
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	27,611,220.00	122,111,220.00
未分配利润	6.4.7.10	1,393,802.31	2,835,483.83
所有者权益合计		29,005,022.31	124,946,703.83
负债和所有者权益总计		29,917,733.02	137,088,181.25

注：1、报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0505 元，基金份额总额 27,611,220.00 份。

2、本基金合同生效日为 2019 年 12 月 04 日，上年度实际可比期间为 2019 年 12 月 04 日至 2019 年 12 月 31 日，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		1,764,370.23
1. 利息收入		25,355.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,343.71
债券利息收入		11.47
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）		2,949,652.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,493,039.06
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	19,074.08
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	83,742.06
股利收益	6.4.7.17	353,796.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-1,311,739.12
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	101,102.12
减：二、费用		275,216.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	40,226.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,408.96
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	110,036.09
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		488.88
7. 其他费用	6.4.7.21	111,056.09

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,489,153.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,489,153.27

注：本基金合同于 2019 年 12 月 04 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：汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	122,111,220.00	2,835,483.83	124,946,703.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,489,153.27	1,489,153.27
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）	-94,500,000.00	-2,930,834.79	-97,430,834.79
其中：1. 基金申购款	21,000,000.00	-901,289.21	20,098,710.79
2. 基金赎回款	-115,500,000.00	-2,029,545.58	-117,529,545.58
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）	27,611,220.00	1,393,802.31	29,005,022.31

注：本基金合同于 2019 年 12 月 04 日生效，本报表无上年度可比期间，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
基金管理人负责人

李骁
主管会计工作负责人

雷青松
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富沪深 300 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[2019]525 号《关于准予汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由汇添富基金管理股份有限公司于 2019 年 9 月 27 日起至 2019 年 11 月 28 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(2019)验字第 60466941_B54 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 2019 年 12 月 4 日生效。本基金为交易型开放式,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 276,110,500.00 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 720.00 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 276,111,220.00 元,折合 276,111,220.00 份基金份额。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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为标的指数收益率,即沪深 300 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益,股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转;

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并

在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息

收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金的收益分配采用现金分红；

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

(4) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

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 2020 年 06 月 30 日
活期存款	2,460,244.48
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	2,460,244.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	24,972,458.53	26,495,108.00	1,522,649.47

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	8,400.00	8,400.00	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	8,400.00	8,400.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		24,980,858.53	26,503,508.00	1,522,649.47

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,341,740.00	-	-	-
（股指期货投资）	2,341,740.00			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,341,740.00	-	-	-

注：本报告期末 2020 年 6 月 30 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量（买/卖）	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IF2009	1	1,203,420.00	1,220,280.00	16,860.00
IF2012	1	1,138,320.00	1,208,700.00	70,380.00
总额合计：		87,240.00		
减：可抵销期货暂收款		87,240.00		
股指期货投资净额：		0.00		

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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
----	-----

	2020 年 06 月 30 日
应收活期存款利息	210.77
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	249.35
应收债券利息	0.77
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	43.30
合计	504.19

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 2020 年 06 月 30 日
交易所市场应付交易费用	14,044.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,044.82

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	39,781.56
应付信息披露费	-
应付指数使用费	18,497.66
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
其他	-
合计	58,279.22

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,111,220.00	122,111,220.00
本期申购	21,000,000.00	21,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-115,500,000.00	-115,500,000.00
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	27,611,220.00	27,611,220.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	782,386.41	2,053,097.42	2,835,483.83
本期利润	2,800,892.39	-1,311,739.12	1,489,153.27
本期基金份额交易产生的变动数	-2,224,043.63	-706,791.16	-2,930,834.79
其中：基金申购款	829,964.76	-1,731,253.97	-901,289.21
基金赎回款	-3,054,008.39	1,024,462.81	-2,029,545.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,359,235.17	34,567.14	1,393,802.31

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	13,020.01
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	11,581.34
其他	742.36
合计	25,343.71

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——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,278,741.08
股票投资收益——赎回差价收入	214,297.98
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	2,493,039.06

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	44,609,669.70
减：卖出股票成本总额	42,330,928.62
买卖股票差价收入	2,278,741.08

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	117,529,545.58
减：现金支付赎回款总额	42,713,496.58
减：赎回股票成本总额	74,601,751.02
赎回差价收入	214,297.98

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
----	--

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	82,385.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	63,300.00
减：应收利息总额	11.15
买卖债券差价收入	19,074.08

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入应缴纳增值税	-
买卖权证差价收入	-
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	83,742.06
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	353,796.85
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	353,796.85

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,160,743.12
——股票投资	-1,160,743.12
——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	-150,996.00
——权证投资	-
——期货投资	-150,996.00
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	-1,311,739.12

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	101,102.12
其他	-
合计	101,102.12

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
交易所市场交易费用	110,036.09
银行间市场交易费用	-
合计	110,036.09

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
审计费用	39,781.56
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	2,776.87
指数使用费	68,497.66
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	111,056.09

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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（%）
东方证券	8,793,091.00	13.51

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 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	2,206.60	2.68

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	8,105.50	13.67	3,670.13	26.13

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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	40,226.94

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 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

项目	本期
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	13,408.96

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。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：本基金本报告期末不存在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。

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：本基金本报告期末不存在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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 06 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
东方证券股份有限公司	1,876,820.00	6.80	2,254,420.00	1.85

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,460,244.48	13,020.01

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

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金托管人招商银行发行的股票招商银行。

于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 6,300 股，持有招商银行 18,200 股。

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。

6.4.12 期末（2020 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

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
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转债2	2020年06月12日	2020年07月13日	新债流通受限	100.00	100.00	66	6,600.00	6,600.00	
128114	正邦转债	2020年06月17日	2020年07月15日	新债流通	100.00	100.00	18	1,800.00	1,800.00	

	债	日	日	通 受 限						
--	---	---	---	-------------	--	--	--	--	--	--

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 2020 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金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 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金融资产款余额。

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 2020 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。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，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，本报告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。本基金的

生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资、买入返售金融资产及部分应收申购款等。本基金的生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	2,460,244.48	-	-	-	-	-	2,460,244.48
结算备付金	614,299.49	-	-	-	-	-	614,299.49
存出保证金	96,278.86	-	-	-	-	242,898.00	339,176.86
交易性金融资产	-	-	8,400.00	-	-	26,495,108.00	26,503,508.00
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	504.19	504.19
应收	-	-	-	-	-	-	-

申购款							
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	3,170,822.83	-	8,400.00	-	-	26,738,510.19	29,917,733.02
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,297.90	4,297.90
应付托管费	-	-	-	-	-	1,432.66	1,432.66
应付	-	-	-	-	-	834,656.11	834,656.11

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	-	-	-	-	-	14,044.82	14,044.82
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	58,279.22	58,279.22
负债 总计	-	-	-	-	-	912,710.71	912,710.71
利率 敏感 度缺 口	3,170,822.83	-	8,400.00	-	-	25,825,799.48	29,005,022.31

上年 度末 2019 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	16,768,206.30	-	-	-	-	-	16,768,206.30
结算 备付 金	2,795,083.19	-	-	-	-	-	2,795,083.19
存出 保证 金	-	-	-	-	-	864,750.00	864,750.00
交易 性金 融资 产	-	-	8,500.00	-	-	111,088,934.20	111,097,434.20
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 利息	-	-	-	-	-	17,402.97	17,402.97
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-

应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	5,545,304.59	5,545,304.59
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	19,563,289.49	-	8,500.00	-	-	117,516,391.76	137,088,181.25
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	27,936.33	27,936.33
应付 托管 费	-	-	-	-	-	9,312.12	9,312.12
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	11,730,554.57	11,730,554.57
卖出 回购	-	-	-	-	-	-	-

金融 资产 款							
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	286,123.14	286,123.14
应交 税费	-	-	-	-	-	2,333.87	2,333.87
应付 利息	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	85,217.39	85,217.39
负债 总计	-	-	-	-	-	12,141,477.42	12,141,477.42
利率 敏感 度缺 口	19,563,289.49	-	8,500.00	-	-	105,374,914.34	124,946,703.83

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:本基金持有的可转换债和可交换债的市场风险在附注 6.4.13.4.3.1 中进行披露;除此

之外，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

注：本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日		上年度末 2019 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	26,495,108.00	91.35	111,088,934.20	88.91
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	8,400.00	0.03	8,500.00	0.01
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	26,503,508.00	91.38	111,097,434.20	88.92

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 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
		—	—

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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	26,495,108.00	88.56
	其中：股票	26,495,108.00	88.56
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	8,400.00	0.03
	其中：债券	8,400.00	0.03
	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	3,074,543.97	10.28
8	其他资产	339,681.05	1.14
9	合计	29,917,733.02	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	382,472.00	1.32
B	采矿业	630,985.00	2.18
C	制造业	12,805,496.80	44.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	524,358.00	1.81
E	建筑业	515,967.00	1.78
F	批发和零售业	269,303.00	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	754,648.00	2.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,074,446.00	3.70
J	金融业	7,448,165.20	25.68
K	房地产业	978,185.00	3.37
L	租赁和商务服务业	387,712.00	1.34
M	科学研究和技术服务业	177,744.00	0.61
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	33,300.00	0.11
Q	卫生和社会工作	336,730.00	1.16
R	文化、体育和娱乐业	175,596.00	0.61

S	综合	-	-
	合计	26,495,108.00	91.35

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票组合。

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	601318	中国平安	19,200	1,370,880.00	4.73
2	600519	贵州茅台	900	1,316,592.00	4.54
3	600276	恒瑞医药	6,760	623,948.00	2.15
4	600036	招商银行	18,200	613,704.00	2.12
5	000858	五 粮 液	3,500	598,920.00	2.06
6	000333	美的集团	8,800	526,152.00	1.81
7	000651	格力电器	8,500	480,845.00	1.66
8	002475	立讯精密	7,460	383,071.00	1.32
9	600030	中信证券	15,100	364,061.00	1.26
10	601166	兴业银行	22,000	347,160.00	1.20
11	600887	伊利股份	10,500	326,865.00	1.13
12	000002	万 科 A	12,000	313,680.00	1.08
13	601398	工商银行	61,700	307,266.00	1.06

14	600900	长江电力	15,200	287,888.00	0.99
15	601888	中国中免	1,800	277,254.00	0.96
16	601328	交通银行	48,400	248,292.00	0.86
17	300059	东方财富	11,660	235,532.00	0.81
18	600585	海螺水泥	4,300	227,513.00	0.78
19	000725	京东方 A	48,700	227,429.00	0.78
20	603288	海天味业	1,820	226,408.00	0.78
21	000661	长春高新	514	223,744.20	0.77
22	000001	平安银行	17,200	220,160.00	0.76
23	600000	浦发银行	20,600	217,948.00	0.75
24	600016	民生银行	37,400	212,058.00	0.73
25	002714	牧原股份	2,580	211,560.00	0.73
26	601688	华泰证券	10,700	201,160.00	0.69
27	002415	海康威视	6,600	200,310.00	0.69
28	600031	三一重工	10,600	198,856.00	0.69
29	000063	中兴通讯	4,800	192,624.00	0.66
30	600048	保利地产	12,800	189,184.00	0.65
31	601012	隆基股份	4,600	187,358.00	0.65
32	600837	海通证券	14,700	184,926.00	0.64
33	603259	药明康德	1,840	177,744.00	0.61
34	601668	中国建筑	36,700	175,059.00	0.60
35	601288	农业银行	50,700	171,366.00	0.59
36	300498	温氏股份	7,840	170,912.00	0.59
37	300015	爱尔眼科	3,780	164,241.00	0.57
38	600570	恒生电子	1,460	157,242.00	0.54
39	601601	中国太保	5,700	155,325.00	0.54
40	300142	沃森生物	2,900	151,844.00	0.52
41	000100	TCL 科技	24,200	150,040.00	0.52
42	603986	兆易创新	620	146,264.20	0.50

43	002142	宁波银行	5,500	144,485.00	0.50
44	601229	上海银行	17,400	144,420.00	0.50
45	600309	万华化学	2,800	139,972.00	0.48
46	601211	国泰君安	8,000	138,080.00	0.48
47	002352	顺丰控股	2,400	131,280.00	0.45
48	600009	上海机场	1,800	129,726.00	0.45
49	601988	中国银行	37,100	129,108.00	0.45
50	601169	北京银行	26,000	127,400.00	0.44
51	600588	用友网络	2,870	126,567.00	0.44
52	002594	比亚迪	1,700	122,060.00	0.42
53	601766	中国中车	21,700	120,869.00	0.42
54	002241	歌尔股份	4,100	120,376.00	0.42
55	000568	泸州老窖	1,300	118,456.00	0.41
56	600690	海尔智家	6,600	116,820.00	0.40
57	000338	潍柴动力	8,500	116,620.00	0.40
58	002304	洋河股份	1,100	115,654.00	0.40
59	000876	新希望	3,800	113,240.00	0.39
60	600999	招商证券	5,100	111,945.00	0.39
61	002410	广联达	1,600	111,520.00	0.38
62	300122	智飞生物	1,100	110,165.00	0.38
63	002555	三七互娱	2,300	107,640.00	0.37
64	600703	三安光电	4,300	107,500.00	0.37
65	601899	紫金矿业	24,400	107,360.00	0.37
66	600104	上汽集团	6,100	103,639.00	0.36
67	002027	分众传媒	18,500	103,045.00	0.36
68	300347	泰格医药	1,000	101,880.00	0.35
69	002230	科大讯飞	2,700	101,061.00	0.35
70	600745	闻泰科技	800	100,760.00	0.35
71	601818	光大银行	27,900	99,882.00	0.34

72	002007	华兰生物	1,970	98,716.70	0.34
73	300601	康泰生物	600	97,296.00	0.34
74	000538	云南白药	1,000	93,810.00	0.32
75	600028	中国石化	23,700	92,667.00	0.32
76	001979	招商蛇口	5,600	92,064.00	0.32
77	600919	江苏银行	16,200	91,854.00	0.32
78	603160	汇顶科技	400	89,160.00	0.31
79	600436	片仔癀	500	85,125.00	0.29
80	300413	芒果超媒	1,300	84,760.00	0.29
81	600547	山东黄金	2,300	84,226.00	0.29
82	601088	中国神华	5,800	83,288.00	0.29
83	600406	国电南瑞	4,100	83,025.00	0.29
84	000895	双汇发展	1,800	82,962.00	0.29
85	600438	通威股份	4,700	81,686.00	0.28
86	601628	中国人寿	3,000	81,630.00	0.28
87	300014	亿纬锂能	1,700	81,345.00	0.28
88	002129	中环股份	3,600	80,856.00	0.28
89	600050	中国联通	16,700	80,828.00	0.28
90	603501	韦尔股份	400	80,780.00	0.28
91	300003	乐普医疗	2,200	80,344.00	0.28
92	000166	申万宏源	15,900	80,295.00	0.28
93	000938	紫光股份	1,800	77,364.00	0.27
94	002271	东方雨虹	1,900	77,197.00	0.27
95	601009	南京银行	10,500	76,965.00	0.27
96	002460	赣锋锂业	1,400	74,998.00	0.26
97	000776	广发证券	5,300	74,836.00	0.26
98	600196	复星医药	2,200	74,470.00	0.26
99	000977	浪潮信息	1,900	74,442.00	0.26
100	300136	信维通信	1,400	74,228.00	0.26

101	601939	建设银行	11,700	73,827.00	0.25
102	601006	大秦铁路	10,400	73,216.00	0.25
103	002050	三花智控	3,340	73,146.00	0.25
104	603019	中科曙光	1,900	72,960.00	0.25
105	601390	中国中铁	14,400	72,288.00	0.25
106	601857	中国石油	17,200	72,068.00	0.25
107	600019	宝钢股份	15,500	70,680.00	0.24
108	002044	美年健康	4,900	70,609.00	0.24
109	002602	世纪华通	4,500	68,895.00	0.24
110	601186	中国铁建	8,200	68,716.00	0.24
111	300124	汇川技术	1,800	68,382.00	0.24
112	002371	北方华创	400	68,364.00	0.24
113	002001	新 和 成	2,300	66,930.00	0.23
114	002311	海大集团	1,400	66,626.00	0.23
115	601336	新华保险	1,500	66,420.00	0.23
116	600015	华夏银行	10,800	66,096.00	0.23
117	300433	蓝思科技	2,300	64,492.00	0.22
118	601989	中国重工	16,100	64,400.00	0.22
119	002624	完美世界	1,100	63,404.00	0.22
120	601933	永辉超市	6,700	62,846.00	0.22
121	002236	大华股份	3,200	61,472.00	0.21
122	002456	欧菲光	3,300	60,687.00	0.21
123	002916	深南电路	360	60,307.20	0.21
124	600352	浙江龙盛	4,700	60,113.00	0.21
125	600958	东方证券	6,300	59,787.00	0.21
126	002120	韵达股份	2,420	59,169.00	0.20
127	000157	中联重科	9,200	59,156.00	0.20
128	002024	苏宁易购	6,700	58,759.00	0.20
129	600183	生益科技	2,000	58,540.00	0.20

130	600741	华域汽车	2,800	58,212.00	0.20
131	600809	山西汾酒	400	58,000.00	0.20
132	002008	大族激光	1,600	57,520.00	0.20
133	000860	顺鑫农业	1,000	56,980.00	0.20
134	601377	兴业证券	8,200	56,170.00	0.19
135	601788	光大证券	3,400	54,604.00	0.19
136	600660	福耀玻璃	2,600	54,262.00	0.19
137	600383	金地集团	3,900	53,430.00	0.18
138	300033	同花顺	400	53,232.00	0.18
139	600346	恒力石化	3,800	53,200.00	0.18
140	002463	沪电股份	2,100	52,458.00	0.18
141	601901	方正证券	7,300	51,684.00	0.18
142	601138	工业富联	3,400	51,510.00	0.18
143	300144	宋城演艺	2,940	50,862.00	0.18
144	601225	陕西煤业	7,000	50,470.00	0.17
145	600522	中天科技	4,400	50,380.00	0.17
146	601877	正泰电器	1,900	50,065.00	0.17
147	601155	新城控股	1,600	49,984.00	0.17
148	300408	三环集团	1,800	49,860.00	0.17
149	002841	视源股份	500	49,760.00	0.17
150	002736	国信证券	4,400	49,720.00	0.17
151	000425	徐工机械	8,400	49,644.00	0.17
152	600109	国金证券	4,300	49,063.00	0.17
153	002202	金风科技	4,900	48,853.00	0.17
154	603658	安图生物	300	48,732.00	0.17
155	600340	华夏幸福	2,100	48,006.00	0.17
156	601669	中国电建	13,500	46,710.00	0.16
157	603799	华友钴业	1,200	46,632.00	0.16
158	601108	财通证券	4,500	46,125.00	0.16

159	000783	长江证券	6,800	45,832.00	0.16
160	601800	中国交建	6,200	45,508.00	0.16
161	603993	洛阳钼业	12,400	45,508.00	0.16
162	000596	古井贡酒	300	45,072.00	0.16
163	600089	特变电工	6,600	44,682.00	0.15
164	601985	中国核电	10,900	44,581.00	0.15
165	000768	中航飞机	2,500	44,350.00	0.15
166	600010	包钢股份	40,700	43,956.00	0.15
167	603369	今世缘	1,100	43,769.00	0.15
168	601555	东吴证券	5,360	43,737.60	0.15
169	000069	华侨城 A	7,200	43,632.00	0.15
170	600867	通化东宝	2,500	43,575.00	0.15
171	000066	中国长城	3,200	42,240.00	0.15
172	600487	亨通光电	2,500	41,025.00	0.14
173	002179	中航光电	1,000	41,010.00	0.14
174	002493	荣盛石化	3,300	40,590.00	0.14
175	000963	华东医药	1,600	40,480.00	0.14
176	600029	南方航空	7,800	40,326.00	0.14
177	601100	恒立液压	500	40,100.00	0.14
178	600606	绿地控股	6,400	39,552.00	0.14
179	600061	国投资本	3,100	39,463.00	0.14
180	601066	中信建投	1,000	39,380.00	0.14
181	002157	正邦科技	2,200	38,456.00	0.13
182	603899	晨光文具	700	38,220.00	0.13
183	600795	国电电力	20,500	37,925.00	0.13
184	002466	天齐锂业	1,640	37,638.00	0.13
185	600893	航发动力	1,600	37,568.00	0.13
186	000625	长安汽车	3,400	37,400.00	0.13
187	600705	中航资本	9,400	37,224.00	0.13

188	600886	国投电力	4,700	36,942.00	0.13
189	601607	上海医药	2,000	36,760.00	0.13
190	601162	天风证券	6,060	36,723.60	0.13
191	600926	杭州银行	4,100	36,572.00	0.13
192	600111	北方稀土	3,900	36,348.00	0.13
193	002422	科伦药业	1,700	35,700.00	0.12
194	601111	中国国航	5,400	35,694.00	0.12
195	600332	白云山	1,100	35,563.00	0.12
196	603833	欧派家居	300	34,770.00	0.12
197	600637	东方明珠	3,600	34,740.00	0.12
198	600498	烽火通信	1,200	34,692.00	0.12
199	300628	亿联网络	500	34,130.00	0.12
200	600118	中国卫星	1,100	33,913.00	0.12
201	600176	中国巨石	3,700	33,855.00	0.12
202	600233	圆通速递	2,300	33,488.00	0.12
203	002607	中公教育	1,200	33,300.00	0.11
204	002601	龙蟠佰利	1,800	33,300.00	0.11
205	601727	上海电气	6,600	33,264.00	0.11
206	601816	京沪高铁	5,300	33,019.00	0.11
207	600115	东方航空	7,800	32,916.00	0.11
208	600011	华能国际	7,600	32,072.00	0.11
209	601600	中国铝业	11,600	32,016.00	0.11
210	000786	北新建材	1,500	31,995.00	0.11
211	601618	中国中冶	12,500	31,375.00	0.11
212	601360	三六零	1,700	31,127.00	0.11
213	003816	中国广核	10,500	31,080.00	0.11
214	601838	成都银行	3,900	31,044.00	0.11
215	000656	金科股份	3,800	31,008.00	0.11
216	600271	航天信息	1,900	30,856.00	0.11

217	600221	海航控股	20,500	30,750.00	0.11
218	000728	国元证券	3,600	30,240.00	0.10
219	601919	中远海控	8,600	29,842.00	0.10
220	002252	上海莱士	3,500	29,610.00	0.10
221	000703	恒逸石化	3,230	29,489.90	0.10
222	600066	宇通客车	2,400	29,280.00	0.10
223	600489	中金黄金	3,200	29,248.00	0.10
224	600177	雅戈尔	4,900	29,204.00	0.10
225	600068	葛洲坝	4,800	28,560.00	0.10
226	000961	中南建设	3,200	28,480.00	0.10
227	002032	苏泊尔	400	28,400.00	0.10
228	600390	五矿资本	4,000	28,240.00	0.10
229	002508	老板电器	900	27,999.00	0.10
230	601997	贵阳银行	3,900	27,924.00	0.10
231	600004	白云机场	1,800	27,432.00	0.09
232	601998	中信银行	5,300	27,295.00	0.09
233	601198	东兴证券	2,500	27,250.00	0.09
234	600085	同仁堂	1,000	27,120.00	0.09
235	601881	中国银河	2,300	26,381.00	0.09
236	600760	中航沈飞	800	26,256.00	0.09
237	600018	上港集团	6,100	25,620.00	0.09
238	002673	西部证券	3,100	25,296.00	0.09
239	600516	方大炭素	4,020	25,245.60	0.09
240	600219	南山铝业	12,400	25,172.00	0.09
241	002146	荣盛发展	3,100	25,110.00	0.09
242	002773	康弘药业	500	24,800.00	0.09
243	601021	春秋航空	700	24,668.00	0.09
244	601319	中国人保	3,800	24,472.00	0.08
245	601018	宁波港	6,800	24,276.00	0.08

246	600362	江西铜业	1,800	24,228.00	0.08
247	600998	九州通	1,300	24,206.00	0.08
248	601117	中国化学	4,400	24,112.00	0.08
249	601231	环旭电子	1,100	24,024.00	0.08
250	600655	豫园股份	2,700	23,922.00	0.08
251	601878	浙商证券	2,400	23,784.00	0.08
252	600170	上海建工	7,700	23,639.00	0.08
253	600848	上海临港	1,100	23,617.00	0.08
254	002153	石基信息	600	23,418.00	0.08
255	002739	万达电影	1,500	22,905.00	0.08
256	600369	西南证券	4,900	22,491.00	0.08
257	600297	广汇汽车	7,000	22,330.00	0.08
258	600674	川投能源	2,400	22,248.00	0.08
259	600208	新湖中宝	7,400	22,052.00	0.08
260	002958	青农商行	4,800	21,264.00	0.07
261	603156	养元饮品	980	21,070.00	0.07
262	601658	邮储银行	4,600	21,022.00	0.07
263	002939	长城证券	1,700	20,944.00	0.07
264	600038	中直股份	500	20,535.00	0.07
265	002938	鹏鼎控股	400	20,024.00	0.07
266	600027	华电国际	5,700	19,494.00	0.07
267	002558	巨人网络	1,100	19,140.00	0.07
268	000671	阳光城	2,900	18,386.00	0.06
269	601992	金隅集团	5,800	17,748.00	0.06
270	600583	海油工程	3,900	17,745.00	0.06
271	000627	天茂集团	3,400	17,714.00	0.06
272	600482	中国动力	1,100	17,270.00	0.06
273	600977	中国电影	1,300	17,069.00	0.06
274	601633	长城汽车	2,200	16,984.00	0.06

275	002468	申通快递	1,000	16,410.00	0.06
276	601238	广汽集团	1,700	15,300.00	0.05
277	601216	君正集团	5,900	14,986.00	0.05
278	601916	浙商银行	3,800	14,972.00	0.05
279	000709	河钢股份	7,300	14,892.00	0.05
280	601808	中海油服	1,100	14,454.00	0.05
281	600188	兖州煤业	1,600	14,016.00	0.05
282	600398	海澜之家	2,400	13,968.00	0.05
283	000723	美锦能源	2,200	13,772.00	0.05
284	601236	红塔证券	700	13,580.00	0.05
285	601577	长沙银行	1,700	13,498.00	0.05
286	600372	中航电子	1,000	13,320.00	0.05
287	600928	西安银行	2,400	12,624.00	0.04
288	601698	中国卫通	700	12,607.00	0.04
289	600025	华能水电	3,200	12,128.00	0.04
290	600989	宝丰能源	1,400	11,788.00	0.04
291	601898	中煤能源	3,100	11,780.00	0.04
292	000708	中信特钢	600	10,254.00	0.04
293	601077	渝农商行	2,000	9,440.00	0.03
294	603260	合盛硅业	300	8,202.00	0.03
295	600968	海油发展	3,500	8,155.00	0.03
296	601828	美凯龙	700	7,413.00	0.03
297	601298	青岛港	1,200	6,816.00	0.02
298	601212	白银有色	2,500	6,375.00	0.02
299	600299	安迪苏	500	6,110.00	0.02
300	002945	华林证券	400	5,524.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	000333	美的集团	712,942.00	0.57
2	000651	格力电器	711,385.00	0.57
3	000002	万 科 A	452,904.00	0.36
4	000858	五 粮 液	403,354.00	0.32
5	600036	招商银行	344,058.00	0.28
6	000001	平安银行	337,836.00	0.27
7	300498	温氏股份	335,544.00	0.27
8	002415	海康威视	323,504.00	0.26
9	000725	京东方 A	310,939.00	0.25
10	601398	工商银行	271,525.00	0.22
11	002475	立讯精密	270,092.00	0.22
12	000063	中兴通讯	260,742.00	0.21
13	600276	恒瑞医药	252,523.00	0.20
14	601166	兴业银行	240,762.00	0.19
15	300059	东方财富	240,630.00	0.19
16	600009	上海机场	207,861.00	0.17
17	600030	中信证券	185,178.00	0.15
18	000100	TCL 科技	177,970.00	0.14
19	002142	宁波银行	172,245.00	0.14
20	002714	牧原股份	165,692.00	0.13

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	000651	格力电器	2,607,946.00	2.09
2	000333	美的集团	2,429,191.51	1.94
3	000858	五 粮 液	2,240,323.00	1.79

4	000002	万 科 A	1,497,456.00	1.20
5	000001	平安银行	1,266,437.00	1.01
6	002475	立讯精密	1,164,930.00	0.93
7	300498	温氏股份	1,100,060.00	0.88
8	002415	海康威视	1,099,178.00	0.88
9	000725	京东方 A	959,718.00	0.77
10	000063	中兴通讯	823,537.00	0.66
11	600519	贵州茅台	802,363.00	0.64
12	002714	牧原股份	797,968.38	0.64
13	300059	东方财富	797,567.06	0.64
14	000661	长春高新	754,018.00	0.60
15	002142	宁波银行	641,612.00	0.51
16	000100	TCL 科技	612,845.00	0.49
17	002304	洋河股份	607,865.54	0.49
18	000568	泸州老窖	599,720.00	0.48
19	000338	潍柴动力	584,355.00	0.47
20	002027	分众传媒	525,820.00	0.42

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	20,509,597.56
卖出股票收入（成交）总额	44,609,669.70

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,400.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,400.00	0.03

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	128112	歌尔转 2	66	6,600.00	0.02
2	128114	正邦转债	18	1,800.00	0.01

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 （买/ 卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2012	IF2012	1	1,208,700.00	70,380.00	

IF2009	IF2009	1	1,220,280.00	16,860.00	
公允价值变动总额合计					87,240.00
股指期货投资本期收益					83,742.06
股指期货投资本期公允价值变动					-150,996.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合股指期货定价模型，主要选择估值合理、流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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	339,176.86
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	504.19
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	339,681.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 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（%）
1,182	23,359.75	3,498,420.00	12.67	24,112,800.00	87.33

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	东方证券股份有限公司	1,876,820.00	6.80
2	中信建投证券股份有限公司	1,561,600.00	5.66
3	陈大鸽	644,300.00	2.33
4	李广涛	545,100.00	1.97

5	李松	500,000.00	1.81
6	李晶	500,000.00	1.81
7	徐刚	500,000.00	1.81
8	贺旦明	500,000.00	1.81
9	冯素贞	500,000.00	1.81
10	吕向东	500,000.00	1.81
11	朱启然	500,000.00	1.81

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（2019 年 12 月 04 日） 基金份额总额	276,111,220.00
本报告期期初基金份额总额	122,111,220.00
本报告期基金总申购份额	21,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	115,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	27,611,220.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2019 年 12 月 18 日起，姜然女士不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务。

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2019 年 12 月 04 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			(%)			
广发证 券	3	45,408,257.61	69.75	41,387.60	69.82	
东方证 券	2	8,793,091.00	13.51	8,105.50	13.67	
东方财 富	2	3,387,421.00	5.20	2,846.69	4.80	
天风证 券	2	3,377,516.00	5.19	3,093.59	5.22	
北京高 华	2	2,079,205.00	3.19	1,936.33	3.27	
国信证 券	2	1,082,370.00	1.66	1,007.85	1.70	
东北证 券	2	320,110.00	0.49	294.84	0.50	
安信证 券	2	283,508.09	0.44	263.45	0.44	
招商证 券	2	239,321.56	0.37	222.52	0.38	
中信建 投证券	2	75,594.00	0.12	70.40	0.12	
海通证 券	2	35,617.00	0.05	33.16	0.06	
中原证 券	2	13,652.00	0.02	12.44	0.02	
国泰君 安	2	5,460.00	0.01	5.08	0.01	
财达证 券	2	-	-	-	-	

国金证 券	2	-	-	-	-	
华泰证 券	1	-	-	-	-	
申万宏 源证券	2	-	-	-	-	
中信证 券	2	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交 金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例(%)	成交 金额	占当期 权证成 交总额 的比例 (%)	成交 金额	占当期 基金成 交总额 的比例 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	2,206.60	2.68	-	-	-	-	-	-
东方财富	10,830.11	13.15	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	69,348.52	84.18	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中信建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理人托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内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	汇添富基金管理股份有限公司关于调整基金经理的公告（沪深 300ETF）	上交所, 证券时报, 公司网站	2020 年 01 月 02 日
2	汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年 1 月 4 日更新）	上交所, 证券时报, 公司网站	2020 年 01 月 04 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富上海证券交易所跨市场 ETF 修改申购赎回业务规则并更新招募说明书的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2020 年 01 月 18 日
4	汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年 1 月 20 日更新）	上交所, 证券时报, 公司网站	2020 年 01 月 20 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金暂停申购、赎回 等业务的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 01 月 31 日
6	汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020 年 2 月 17 日更新）	上交所, 证券时报, 公司网站	2020 年 02 月 17 日

7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分沪市上市基金增加扩位证券简称的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2020 年 03 月 14 日
8	汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2020 年 3 月 19 日更新)	上交所, 证券时报, 公司网站	2020 年 03 月 19 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所	2020 年 04 月 01 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议并更新招募说明书	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 04 月 14 日
11	汇添富基金旗下 145 只基金 2020 年 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 04 月 21 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分 ETF 修改标的指数使用许可费并修改基金合同、托管协议、招募说明书的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所	2020 年 04 月 29 日
13	汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2020 年	上交所, 证券时报, 公司网站	2020 年 05 月 07 日

	5 月 7 日更新)		
--	------------	--	--

§ 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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 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、报告期内汇添富沪深 300 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 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

2020 年 08 月 28 日