上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金上市交易公告书

一、 重要声明与提示

《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人汇添富基金管理股份有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2017年11月18日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及汇添富基金管理股份有限公司网站（www.99fund.com）上的《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金招募说明书》。

二、 基金概览

（一）基金名称

上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金

基金简称：上证上海改革发展主题ETF

场内简称：上海改革，证券代码（二级市场交易代码）：510820

（二）基金份额总额

截至2019年7月2日，本基金份额总额为4,758,348,947.00份。

（三）基金份额净值

截至2019年7月2日，本基金基金份额净值为0.9158元。

（四）本次上市交易份额

截至2019年7月2日，本次上市交易份额为4,758,348,947.00份。

（五）上市交易的证券交易所：上海证券交易所

（六）上市交易日期：2019年7月9日

（七）基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

（八）基金托管人：中国工商银行股份有限公司

（九）登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、 基金的募集与上市交易

（一）本基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2017】302号，中国证监会证券基金机构监管部机构部函【2017】2461号

2、基金合同生效日：2017年12月1日

3、基金运作方式：交易型开放式

4、基金合同期限：不定期

5、发售日期：2017年11月22日至2017年11月24日

6、发售价格：人民币1.00元

7、发售方式：网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购
8、发售机构：
（1）网上现金发售机构
网上现金发售代理机构为具有基金代销业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位。
（2）网下现金发售机构
直销机构：汇添富基金管理股份有限公司直销中心
代理机构：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、招商证券股份有限公司
（3）网下股票发售机构
直销机构：汇添富基金管理股份有限公司直销中心
代理机构：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司
9、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
10、募集资金总额及入账情况
本次募集有效认购总户数为 1,837 户，募集期间净认购金额为 4,758,222,947.00 元，认购资金在募集期间产生的利息为 126,000.00 元。
11、本基金募集备案情况
本基金募集资金于 2017 年 11 月 30 日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户，并于 2017 年 12 月 1 日获中国证监会基金备案手续书面确认。
12、基金合同生效日：2017 年 12 月 1 日
13、基金合同生效日的基金份额总额：4,758,348,947.00 份
（二）本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2019]121 号
2、上市交易日期：2019 年 7 月 9 日
3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金场内简称及基金代码（二级市场交易代码）：
场内简称：上海改革，基金代码：510820
5、本次上市交易份额为 4,758,348,947.00 份。
6、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。
四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人
（一）持有人户数
截至 2019 年 7 月 2 日，本基金基金份额持有人户数为 1,837 户，平均每户持有的基金份额为 2,590,282.50 份。
（二）持有人结构
截至 2019 年 7 月 2 日，本基金份额持有人结构如下：
机构投资者持有的基金份额为 4,755,498,947.00 份，占基金总份额的 99.94%；个人投资者持有的基金份额为 2,850,000.00 份，占基金总份额的 0.06%。

（三）前十名基金份额持有人的情况
截至 2019 年 7 月 2 日，前十名基金份额持有人情况
序号 持有人名称（全称） 持有基金份额（份） 占场内基金总份
额比例（%）
1 上海国盛（集团）有限公司 1,318,156,150.00 27.70%
2 光明食品（集团）有限公司 902,432,166.00 18.97%
3 上海国盛集团资产有限公司 482,541,000.00 10.14%
4 申能集团财务有限公司 300,080,000.00 6.31%
5 中国太平洋人寿保险股份有限公司－传
统－普通保险产品 250,021,500.00 5.25%
6 中国太平洋人寿保险股份有限公司－分
红－个人分红 250,021,500.00 5.25%
7 上海盛睿投资有限公司 202,812,203.00 4.26%
8 上海电气（集团）总公司 199,499,000.00 4.19%
9 申能股份有限公司 195,224,000.00 4.10%
10 上海久事（集团）有限公司 193,708,000.00 4.07%
合计 4,294,495,519.00 90.25%
注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的持有人信息编制。
五、 基金主要当事人简介
（一）基金管理人
1、公司概况
名称：汇添富基金管理股份有限公司
住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室
办公地址：上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼
法定代表人：李文
成立时间： 2005 年 2 月 3 日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：证监基金字[2005]5 号
注册资本：人民币 132,724,224 元
联系人：李鹏
联系电话：021－28932888
股东名称及其出资比例：
股东名称 股权比例
东方证券股份有限公司 35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙） 24.656%
上海上报资产管理有限公司 19.966%
东航金控有限责任公司 19.966%
合计 100%
2、内部组织结构及职能
公司目前设置投资研究总部、投资理财总部、机构理财总部、互联网金融总部、指数与量化投资部、国际业务部、战略投资部、产品创新服务中心、基金营运部、信息技术部、稽核监察部、综合办公室，负责投资研究管理、销售管理、信息技术管理等基金运营管理工作；公司设立北京分公司、南方分公司、上海虹桥机场分公司以及成都分公司，分别负责其区域的基金产品推广与销售工作；公司设立香港子公司，负责在港开展资产管理类业务

和投资顾问业务；公司设立汇添富资本子公司，负责泛资产管理类业务和投资顾问业务的拓展。

3、主要人员情况

截至 2018 年 12 月 31 日，公司共有员工（包括中智公司派遣）654 人，其中博士及博士以上有 22 人，硕士 425 人，本科 171 人，专科及以下 36 人。

4、信息披露负责人：李鹏

电话：021-28932888

5、基金管理业务情况

汇添富基金管理股份有限公司成立于 2005 年 2 月，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京、南方、上海虹桥机场、成都四个分公司，以及两个子公司一一汇添富资产管理(香港)有限公司(China Universal Asset Management (HongKong) Company Limited)与汇添富资本管理有限公司。

汇添富基金是中国第一批获得 QDII 业务资格、专户业务资格、设立海外子公司并且获得 RQFII 业务资格的基金公司，同时是全国社会保障基金投资管理人。在投资管理领域，汇添富已形成公募业务、互联网金融、专户业务、资本业务、国际业务和养老金业务等六大块业务领域以及主动股票投资、指数化投资、固定收益投资、海外投资和另类投资等五大块投资领域协同发展的格局。

截止 2019 年 3 月末，公司管理 125 只开放式证券投资基金，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，包括汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长混合型证券投资基金、汇添富成长焦点混合型证券投资基金、汇添富增强收益债券型证券投资基金、汇添富蓝筹稳健灵活配置混合型证券投资基金、汇添富价值精选混合型证券投资基金、汇添富上证综合指数证券投资基金、汇添富策略回报混合型证券投资基金、汇添富民营活力混合型证券投资基金、汇添富香港优势精选混合型证券投资基金、汇添富医药保健混合型证券投资基金、汇添富双利债券型证券投资基金、汇添富社会责任混合型证券投资基金、汇添富可转换债券债券型证券投资基金、汇添富黄金及贵金属证券投资基金(LOF)、深证 300 交易型开放式指数证券投资基金、汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富逆向投资混合型证券投资基金、汇添富理财 30 天债券型证券投资基金、汇添富理财 60 天债券型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富收益快线货币市场基金、汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金、汇添富消费行业混合型证券投资基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金、汇添富实业债债券型证券投资基金、汇添富美丽 30 混合型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金、中证能源交易型开放式指数证券投资基金、中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金、汇添富年年利定期开放债券型证券投资基金、汇添富现金宝货币市场基金、汇添富纯债债券型证券投资基金（LOF）、汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金、汇添富安心中国债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富添富通货币市场基金、汇添富全额宝货币市场基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富移动互联股票型证券投资基金、汇添富环保行业股票型证券投资基金、汇添富外延增长主题股票型证券投资基金、汇添富收益快钱货币市场基金、汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金、汇添富国企创新增长股票型证券投资基金、汇添富民营新动力股票型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混

合型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富新兴消费股票型证券投资基金、汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金、汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金、汇添富多策略定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、汇添富沪港深新价值股票型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金、汇添富盈稳保本混合型证券投资基金、中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、汇添富保鑫保本混合型证券投资基金、汇添富长添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金(LOF)、汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富鑫瑞债券型证券投资基金、汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金、汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、汇添富中国高端制造股票型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金、汇添富精选美元债债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金、汇添富添福吉祥混合型证券投资基金、汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金、汇添富盈润混合型证券投资基金、汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富民丰回报混合型证券投资基金、汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）、汇添富弘安混合型证券投资基金、汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金、汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富价值创造定期开放混合型证券投资基金、汇添富鑫永定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金、汇添富行业整合主题混合型证券投资基金、汇添富沪港深大盘价值混合型证券投资基金、汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富价值多因子量化策略股票型证券投资基金、汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富智能制造股票型证券投资基金、汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金、汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）、汇添富文体娱乐主题混合型证券投资基金、汇添富 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、汇添富创新医药主题混合型证券投资基金、汇添富全球消费行业混合型证券投资基金、汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金、中证银行交易型开放式指数证券投资基金、汇添富经典成长定期开放混合型证券投资基金、汇添富短债债券型证券投资基金、汇添富消费升级混合型证券投资基金、汇添富丰润中短债债券型证券投资基金、汇添富养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、汇添富丰利短债债券型证券投资基金、汇添富悦享定期开放混合型证券投资基金、汇添富 3 年封闭运作研究优选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富 AAA 级信用纯债债券型证券投资基金、汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

6、本基金基金经理

楚天舒女士，国籍：中国，南开大学经济学博士，19 年证券从业经验。曾任职于深圳商业银行、华安证券、华富基金管理公司、深圳证券交易所、上海证券交易所、华宝兴业基金管理公司，2014 年 5 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部副总监。2016 年 8 月 8 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理，2016 年 9 月 18 日至今任上海国企 ETF 联接的基金经理，2017 年 9 月 6 日至今任汇添富沪深 300 指数（LOF）的基金经理，

2017 年 12 月 1 日至今担任上证上海改革发展主题 ETF 的基金经理，2017 年 12 月 4 日至今担任汇添富中证全指证券公司指数（LOF）的基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

注册资本：人民币 34,932,123.46 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

2、主要人员情况

截至 2018 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 202 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 64 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）验资机构

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

邮政编码：100738

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话： 010-58153000

传真： 010-85188298

业务联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、许培菁

六、 基金合同摘要

一、基金合同当事人及权利义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在

《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。
每份基金份额具有同等的合法权益。
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（1）分享基金财产收益；
（2）参与分配清算后的剩余基金财产；
（3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或召集基金份额持有人大会；
（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
（7）监督基金管理人的投资运作；
（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

（1）认真阅读并遵守《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件；
（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
（4）缴纳基金认购款项、申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
（9）发起资金提供方持有认购的基金份额不少于 3 年；
（10）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
（二） 基金管理人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：
（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）按照规定召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；
（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等业务规则；
（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
（2）办理基金备案手续；
（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
（7）依法接受基金托管人的监督；
（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购对价、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的对价，编制申购赎回清单；
（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
（10）编制季度、半年度和年度基金报告；
（11） 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人，同时将已冻结的股票解冻；
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（26）建立并保存基金份额持有人名册；
（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
（三）基金托管人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：
（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户、为基金办理证券、期货交易资金清算；
（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；
（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：
（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回对价；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
（12）建立并保存基金份额持有人名册；
（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价的现金部分；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
二、基金份额持有人大会
基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。本基金份额持有人大会不设日常机构。
（一）召开事由
1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会规定或基金合同另有约定的除外：
（1）终止《基金合同》；
（2）更换基金管理人；
（3）更换基金托管人；
（4）转换基金运作方式；
（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
（6）变更基金类别；
（7）本基金与其他基金的合并；
（8）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
（9）变更基金投资目标、范围或策略；
（10）变更基金份额持有人大会程序；
（11）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
（12）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
（13）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
2、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：
（1）法律法规要求增加的基金费用的收取；
（2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内，调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式；
（3）因相应的法律法规、相关证券/期货交易所或登记机构的相关业务规则以及中国证监会的相关规定发生变动，而应当对《基金合同》进行修改；
（4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
（5）基金管理人、相关证券交易所和登记机构等调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；
（6）基金推出新业务或服务；
（7）在法律法规和《基金合同》规定的范围内，按照指数编制公司的要求，根据指数使用许可协议的约定，变更标的指数许可使用费费率和计算方法；
（8）调整基金份额类别设置、调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成、开通基金的场外申购赎回、跨系统转托管等业务；
（9）基金管理人调整基金收益分配原则；
（10）在不违反法律法规的情况下，本基金的联接基金采用股票或现金特殊申购本基金；
（11）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式
1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。
2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。
3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起
60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。
4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起
10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起
60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。
5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、

干扰。
6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：
（1）会议召开的时间、地点和会议形式；
（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
（5）会务常设联系人姓名及联系电话；
（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
（7）召集人需要通知的其他事项。
2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。
3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。
（四）基金份额持有人出席会议的方式
基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。
1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：
（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；
（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。
2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。
在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：
（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；
（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人

为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人也可以采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。
基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：
1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。
2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除《基金合同》另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。
基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。
基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（七）计票
1、现场开会
（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。
（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。
（4）计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。
2、通讯开会
在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。
（八）生效与公告
基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。
基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。
基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。
基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。
生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约

束力。
（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致，报监管机关并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。
三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算
（一）《基金合同》的变更
1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。
2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，自决议生效后 2 日内在指定媒介公告。
（二）《基金合同》的终止事由
有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：
1、基金份额持有人大会决定终止的；
2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
3、《基金合同》约定的其他情形；
4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。
（三）基金财产的清算
1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。
2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。
3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。
4、基金财产清算程序：
（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
（3）对基金财产进行估值和变现；
（4）制作清算报告；
（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
（7）对基金剩余财产进行分配。
5、基金财产清算的期限为 6 个月。
（四）清算费用
清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。
（五）基金财产清算剩余资产的分配
依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议可通过友好协商解决，如未能协商解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

七、 基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付，其他各基金发售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金 2019 年 7 月 2 日资产负债表如下：

单位：人民币元

资产 期末余额

银行存款 65,234,968.08

结算备付金 1,317,944.34

存出保证金 2,737.43

交易性金融资产 4,292,114,804.91

其中：股票投资 4,292,114,804.91

基金投资

债券投资

资产支持证券投资

衍生金融资产

买入返售金融资产

应收证券清算款

应收利息 13,862.25

应收股利

应收申购款

其他资产

资产总计： 4,358,684,317.01

负债

短期借款

交易性金融负债
衍生金融负债
卖出回购金融资产款
应付证券清算款
应付赎回款
应付管理人报酬 106,144.59
应付托管费 23,587.69
应付销售服务费
应付交易费用 225,458.04
应付税费
应付利息
应付利润
其他负债 657,444.69
负债合计 1,012,635.01
所有者权益:
实收基金 4,758,348,947.00
未分配利润 -400,677,265.00
所有者权益合计 4,357,671,682.00
负债与持有人权益总计： 4,358,684,317.01
八、 基金投资组合
截止到 2019 年 7 月 2 日，本基金的投资组合如下：
8.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）
1 权益投资 4,292,114,804.91 98.47
其中：股票 4,292,114,804.91 98.47
2 基金投资
3 固定收益投资
其中：债券
资产支持证券
4 贵金属投资
5 金融衍生品投资
6 买入返售金融资产
其中：买断式回购的买入返售金融资产
7 银行存款和结算备付金合计 66,552,912.42 1.53
8 其他资产 16,599.68 0.00
9 合计 4,358,684,317.01 100.00
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
8.2.1 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 6,006,660.00 0.14%
B 采矿业 0.00%
C 制造业 1,170,503,342.21 26.86%
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 64,771,105.00 1.49%
E 建筑业 157,020,952.00 3.60%

F 批发和零售业 242,643,071.13 5.57%
G 交通运输、仓储和邮政业 840,196,534.33 19.28%
H 住宿和餐饮业 50,615,306.00 1.16%
I 信息传输、软件和信息技术服务业 227,768,063.30 5.23%
J 金融业 760,024,242.24 17.44%
K 房地产业 489,221,992.62 11.23%
L 租赁和商务服务业 10,341,513.00 0.24%
M 科学研究和技术服务业 11,670,156.00 0.27%
N 水利、环境和公共设施管理业 55,871,235.00 1.28%
O 居民服务、修理和其他服务业 0.00%
P 教育 15,371,902.00 0.35%
Q 卫生和社会工作 0.00%
R 文化、体育和娱乐业 25,856,160.08 0.59%
S 综合 164,232,570.00 3.77%
合计 4,292,114,804.91 98.50%

8.2.2 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股票投资。

8.2.3 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股票投资。

8.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600009	上海机场	4,226,631	356,854,455.33	8.19
2	600104	上汽集团	12,954,409	346,919,073.02	7.96
3	600018	上港集团	49,219,500	343,552,110.00	7.88
4	600741	华域汽车	14,286,504	332,589,813.12	7.63
5	600000	浦发银行	21,060,400	244,511,244.00	5.61
6	601601	中国太保	4,510,701	167,076,365.04	3.83
7	601727	上海电气	28,105,100	155,421,203.00	3.57
8	600895	张江高科	7,018,000	146,606,020.00	3.36
9	600663	陆家嘴	6,433,812	100,110,114.72	2.30
10	601211	国泰君安	5,392,300	99,811,473.00	2.29

8.3.2 报告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前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极股票投资。

8.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金报告期末未进行债券投资。

8.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

8.6 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。

8.7 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:报告期末本基金无股指货持仓。

8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期内未投资国债期货。
8.10 投资组合报告附注
8.10.11
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、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
8.10.12
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。
8.10.13 其他资产构成
序号 名称 金额（元）
1 存出保证金 2,737.43
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 13,862.25
5 应收申购款 -
6 其他应收款 -
7 待摊费用 -
9 其他 -
10 合计 16,599.68
8.10.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金报告期末未持有可转换债券。
8.10.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
8.10.15.1 报告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的情况
8.10.15.2 报告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股票投资。
九、 重大事件揭示
本基金以下信息披露事项已通过中国证监会指定报刊以及基金管理人的公司网站(www.99fund.com)进行公开披露，并已报送相关监管部门备案。
序号 公告事项 法定披露方式 法定披露日期
1 上证上海改革发展主题交易型开放式指数
发起式证券投资基金发行文件
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站 2017-11-18
2
关于上证上海改革发展主题交易型开放式
指数发起式证券投资基金增加基金管理人
为网下股票认购办理机构的公告
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站 2017-11-18
3 上证上海改革发展主题交易型开放式指数
发起式证券投资基金上网发售提示性公告
中证报,上交所,证券时报,上
证报 2017-11-22

4
关于上证上海改革发展主题交易型开放式
指数发起式证券投资基金增加网下股票发
售代理机构的公告
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站 2017-11-22
5 上证上海改革发展主题交易型开放式指数
发起式证券投资基金基金合同生效公告
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站 2017-12-02
6 汇添富基金管理股份有限公司关于聘任基
金经理助理的公告
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站 2017-12-14
7 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基
金 2017 年资产净值的公告 公司网站 2018-01-02
8
上证上海改革发展主题交易型开放式指数
发起式证券投资基金开放日常申购赎回业
务公告
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站 2018-02-24
9
上证上海改革发展主题交易型开放式指数
发起式证券投资基金暂停申购、赎回业务的
公告
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站 2018-02-28
10 汇添富基金旗下 99 只基金 2018 年第 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 2018-04-21
11 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基
金 2018 半年资产净值的公告
中证报,证券时报,上证报,公
司网站 2018-06-30
12
上证上海改革发展主题交易型开放式指数
发起式证券投资基金更新招募说明书及摘
要（2018 年第 1 号）
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站 2018-07-14
13 汇添富基金管理股份有限公司旗下 108 只基
金 2018 年 2 季度报告

中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站,深交所 2018-07-18
14 汇添富基金管理股份有限公司旗下 108 只基
金 2018 年半年度报告
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站,深交所 2018-08-25
15 汇添富基金旗下 111 只基金 2018 年第 3 季度报
告
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站,深交所 2018-10-26
16 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基
金 2018 年资产净值的公告
中证报,证券时报,上证报,公
司网站 2019-01-01
17
上证上海改革发展主题交易型开放式指数
发起式证券投资基金更新招募说明书（2018
年第 2 号）
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站 2019-01-15
18 汇添富基金管理股份有限公司关于旗下 115
只基金 2018 年第 4 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
2019-01-21
19 汇添富基金旗下 115 只基金 2018 年年度报告
中证报,上交所,证券时报,上
证报,公司网站,深交所,证券
日报
2019-03-26
20 汇添富基金旗下 123 只基金 2019 年第 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
2019-04-20
21
汇添富基金管理股份有限公司关于召开上
证上海改革发展主题交易型开放式指数发
起式证券投资基金基金份额持有人大会的
公告
上交所,证券时报,公司网站 2019-06-06
22

汇添富基金管理股份有限公司关于召开上
证上海改革发展主题交易型开放式指数发
起式证券投资基金基金份额持有人大会第
一次提示性公告
上交所,证券时报,公司网站 2019-06-10
23
汇添富基金管理股份有限公司关于召开上
证上海改革发展主题交易型开放式指数发
起式证券投资基金基金份额持有人大会第
二次提示性公告
上交所,证券时报,公司网站 2019-06-11
十、 基金管理人承诺
本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。
十一、 基金托管人承诺
基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：
（一）严格遵守《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
（二）根据《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。
十二、 备查文件目录
（一）本基金备查文件包括下列文件：
1、中国证监会准予上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金注册的文件；
2、《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》；
3、《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金托管协议》；
4、法律意见书；
5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
7、注册登记协议；
8、中国证监会要求的其他文件。
（二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式：
以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。
汇添富基金管理股份有限公司
2019 年 7 月 4 日