

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券 投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 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：2019 年 8 月 29 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。本半年度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 2019 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 2019 年 1 月 1 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	5
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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	10
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	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 期末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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	44
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	44

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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金
基金简称	汇添富沪深 300 安中指数
基金主代码	000368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 6 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	218,399,191.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。
投资策略	主要采取完全复制法。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	沪深 300 安中动态策略指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型指数基金，在证券投资基金中属于较高预期风险、较高预期收益的品种，本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李文	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网	www.99fund.com

网址	
基金半年度报告备置地点	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 层

§ 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(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	20,850,438.46
本期利润	61,422,842.18
加权平均基金份额本期利润	0.2774
本期加权平均净值利润率	19.58%
本期基金份额净值增长率	22.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	88,520,803.74
期末可供分配基金份额利润	0.4053
期末基金资产净值	323,809,312.57
期末基金份额净值	1.4826
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	48.26%

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、上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

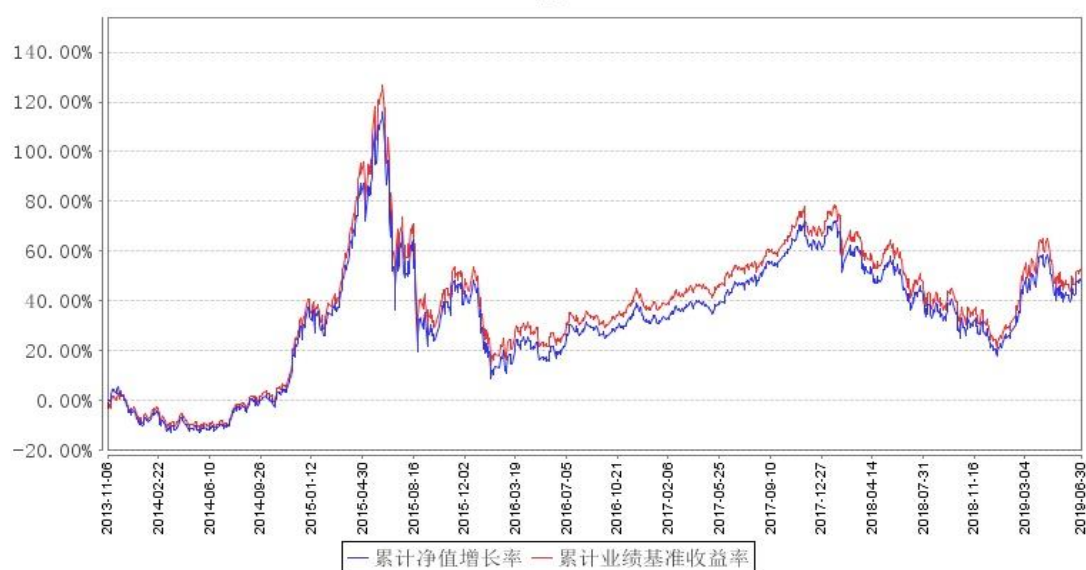
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.36%	1.00%	3.76%	0.99%	0.60%	0.01%

过去三个月	-2.52%	1.44%	-3.63%	1.46%	1.11%	-0.02%
过去六个月	22.80%	1.44%	22.27%	1.45%	0.53%	-0.01%
过去一年	3.72%	1.42%	2.19%	1.43%	1.53%	-0.01%
过去三年	21.81%	1.06%	19.90%	1.06%	1.91%	0.00%
自基金合同 生效日起至 今	48.26%	1.53%	52.17%	1.49%	-3.91%	0.04%

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

汇添富沪深300安中指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013年11月6日）起6个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准，于2005年2月

3 日正式成立。目前，公司注册资本为 132,724,224 元人民币。公司总部设在上海，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。

2019 上半年，汇添富基金新成立 13 只公开募集证券投资基金，包括 5 只债券型基金、4 只混合型基金、2 只基金中基金、2 只指数基金联接基金。截至 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 133 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	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	汇添富上证综合指数、汇添富沪深 300 安中指数基金、汇添富成长多因子股票基金、汇添富主要消费 ETF 联接基金、汇添富中证精准医指数基金、中证上海国企 ETF、汇添富中证互联网医疗指数 (LOF)、汇添富中证	2013 年 11 月 6 日	-	13	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至 2013 年

	<p>500 指数 (LOF)、添富价值多因子股票的基金经理, 指数与量化投资部副总监。</p>			<p>11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金的基金经理, 2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理, 2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金的基金经理, 2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理, 2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理, 2015 年 3 月 24 日至今任汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理, 2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理, 2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理, 2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗指数 (LOF) 的基金经理, 2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数 (LOF) 的基金经理, 2018 年 3 月 23 日至今任添富价值多因子股票的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注:1、基金的首任基金经理, 其“任职日期”为基金合同生效日, 其“离职日期”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。

4.2 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严格遵守《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，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合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，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖开放式基金、特定客户资产管理以及社保与养老委托资产的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 5 次，由于组合投资策略导致。经检查和分析未发现异常情况。

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

2019 年上半年，中美贸易摩擦有所反复。在 6 月底举行的 G20 大阪峰会上，中美元首会晤并取得了最新的阶段性进展：一是美方表示不再对中国出口产品加征新的关税；二是双方同意在平等和相互尊重的基础上重启经贸磋商。三是特朗普同意美国的公司继续向华为出售零件。

中美贸易摩擦的影响是长期的，对国内的经济增长和产业结构调整都将产生深远的影响。同

时，从上半年的实体经济情况来看，房地产投资后续支撑减弱，制造业投资增速有所下滑，专项债对基建投资有所拉动，消费总体保持平稳。二季度经济指标有一定程度的回落，下半年经济下行压力仍较大。因此，今年在宏观调控方面政策仍可能重点实施逆周期调节，通过财政减税降费和货币政策保持流动性合理充裕等对经济形成一定的支撑。

资本市场方面，金融供给侧改革的提出或将加大企业直接融资的比例。科创板的推出定位于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业，有利于更好的发挥资本市场的资源配置功能。另外，资本市场扩大对外开放，也引入了海外长期资金投资 A 股。

市场经过二季度的调整以后，估值重新回到了偏低估的状态。报告期末，沪深 300 指数的市盈率为 12.44，处于历史较低水平，未来存在进一步估值修复的空间。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4826 元；本报告期基金份额净值增长率为 22.80%；同期业绩比较基准收益率为 22.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年国内经济增速下行压力仍然较大，政策将保持定力，仍会坚持逆周期调节，统筹做好“六稳”工作。总体经济形势或将趋于平稳，出现系统性风险的概率较小。

政策方面，强调继续实施好稳健的货币政策。要坚持实施积极的财政政策，减税降费、专项债、平滑地方隐性债务和基建补短板将是主抓手。对内改革和对外开放并举，以开放促改革。

7 月 20 日，国务院金融委办公室宣布了 11 条金融业进一步对外开放的政策措施，涉及债市、保险、理财、券商、基金、期货、信用评级等多个领域，在外资限制放开进程中意义重大，加速 A 股国际化进程，标志着我国金融对外开放进入了新的阶段。

2019 年下半年市场大概率仍将以结构性行情为主。行业上，建议关注受益于政策支持的基建、5G 等通信基础设施建设；以及受益于大规模减税降费的必需消费等。

作为被动投资的指数型基金，汇添富沪深 300 安中动态策略指数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、基金营运部和稽核监察部人员及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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期末未进行利润分配。

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沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，汇添富沪深 300 安

中动态策略指数型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度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沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	17,878,309.03	14,921,853.47
结算备付金		500,979.86	672,584.11
存出保证金		42,304.21	29,846.61
交易性金融资产	6.4.7.2	305,584,436.66	251,972,695.04
其中：股票投资		305,584,436.66	251,940,695.04
基金投资		-	-
债券投资		-	32,000.00
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		8,551,973.22	26,378,887.02
应收利息	6.4.7.5	3,427.86	3,212.50
应收股利		-	-
应收申购款		62,137.37	302,566.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		332,623,568.21	294,281,645.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		7,837,002.07	26,399,500.29
应付赎回款		62,432.73	3,249.61
应付管理人报酬		129,677.19	116,634.62
应付托管费		25,935.44	23,326.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	378,892.73	321,852.77
应交税费		-	0.01
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	380,315.48	430,006.20
负债合计		8,814,255.64	27,294,570.41
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	218,399,191.51	221,135,626.32
未分配利润	6.4.7.10	105,410,121.06	45,851,448.45
所有者权益合计		323,809,312.57	266,987,074.77
负债和所有者权益总计		332,623,568.21	294,281,645.18

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4826 元，基金份额总额 218,399,191.51 份。

6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		63,662,527.70	-39,068,673.33
1. 利息收入		69,962.30	81,487.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	69,886.77	81,342.97
债券利息收入		75.53	144.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,966,396.43	-2,118,519.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,543,147.17	-4,742,340.87
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	42,623.85	25,575.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,380,625.41	2,598,245.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	40,572,403.72	-37,100,222.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	53,765.25	68,581.38
减：二、费用		2,239,685.52	2,870,743.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	775,146.37	871,242.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	155,029.25	174,248.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,079,152.38	1,536,618.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.23	0.47
7. 其他费用	6.4.7.20	230,357.29	288,633.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		61,422,842.18	-41,939,416.66

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 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）	221,135,626.32	45,851,448.45	266,987,074.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	61,422,842.18	61,422,842.18
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）	-2,736,434.81	-1,864,169.57	-4,600,604.38
其中：1. 基金申购款	30,321,643.61	13,211,579.89	43,533,223.50
2. 基金赎回款	-33,058,078.42	-15,075,749.46	-48,133,827.88
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）	218,399,191.51	105,410,121.06	323,809,312.57
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 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）	239,592,806.85	148,377,211.33	387,970,018.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-41,939,416.66	-41,939,416.66
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）	-29,175,578.27	-16,090,739.63	-45,266,317.90
其中：1. 基金申购款	20,448,855.82	11,682,020.17	32,130,875.99
2. 基金赎回款	-49,624,434.09	-27,772,759.80	-77,397,193.89
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）	210,417,228.58	90,347,055.04	300,764,283.62

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：

张暉

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

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监

督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1209 号文《关于核准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于 2013 年 11 月 06 日正式生效，首次设立募集规模为 274,994,745.19 基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以沪深 300 安中动态策略指数的成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪沪深 300 安中动态策略指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，以便为投资者带来长期收益。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 安中动态策略指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

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（以下统称“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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〈年度报告和半年度报告〉》、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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年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 2019年6月30日
活期存款	17,878,309.03
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	17,878,309.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	299,167,914.21	305,584,436.66	6,416,522.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	299,167,914.21	305,584,436.66	6,416,522.45

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：本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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
----	-----

	2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,207.81
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	202.95
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	17.10
合计	3,427.86

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 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	378,892.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	378,892.73

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	112.19
应付信息披露费	290,531.71
应付审计费	39,671.58
应付指数使用费	50,000.00
合计	380,315.48

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	221,135,626.32	221,135,626.32
本期申购	30,321,643.61	30,321,643.61
本期赎回（以“-”号填列）	-33,058,078.42	-33,058,078.42
- 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	218,399,191.51	218,399,191.51

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	69,094,773.36	-23,243,324.91	45,851,448.45
本期利润	20,850,438.46	40,572,403.72	61,422,842.18
本期基金份额交易产生的变动数	-1,424,408.08	-439,761.49	-1,864,169.57
其中：基金申购款	10,562,425.50	2,649,154.39	13,211,579.89
基金赎回款	-11,986,833.58	-3,088,915.88	-15,075,749.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,520,803.74	16,889,317.32	105,410,121.06

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	63,421.79
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	5,581.29
其他	883.69
合计	69,886.77

注：表中“其他”指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

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	359,483,824.08
减：卖出股票成本总额	339,940,676.91
买卖股票差价收入	19,543,147.17

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	42,623.85

券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	42,623.85

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	385,703.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	343,000.00
减：应收利息总额	79.65
买卖债券差价收入	42,623.85

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,380,625.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,380,625.41

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	40,572,403.72
股票投资	40,572,403.72
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-

其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
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	40,572,403.72

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	53,765.25
合计	53,765.25

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	1,079,152.38
银行间市场交易费用	-
合计	1,079,152.38

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	90,531.71
指数使用费	100,000.00
银行费用	154.00
合计	230,357.29

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
东方证券股份有限公司	224,143,323.42	31.52	-	-

注：本基金上年度可比期间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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6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 (%)
东方证券股份有 限公司	207,490.96	31.60	207,490.96	54.76

关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6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 (%)

注:本基金上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	775,146.37	871,242.61
其中:支付销售机构的客户维护费	53,761.81	49,041.11

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前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、公休假等,支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	155,029.25	174,248.53

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注:本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	17,878,309.03	63,421.79	20,895,930.56	72,350.47

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注:本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票	停牌日	停牌	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
------	----	-----	----	----	----	----	----	----	----	----

码	名称	期	原因	估值单 价	日期	开盘单 价	(股)	成本总额	估值总额	
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大 资产 重组 停牌	5.76	2019 年 07 月 12 日	13.86	201,904	3,443,861.58	1,162,967.04	-

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

截至本报告期末 2019 年 6 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

截至本报告期末 2019 年 6 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。

6.4.13 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；本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、债券投资、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产及部分应收申购款等；生息负债主要为卖出回购金融资产款。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 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	17,878,309.03						17,878,309.03
结算备付金	500,979.86						500,979.86
存出保证金	42,304.21						42,304.21
交易性金融资产						305,584,436.66	305,584,436.66
买入返售金融资产							0.00
应收利息						3,427.86	3,427.86
应收股利							0.00
应收申购款	29,231.95					32,905.42	62,137.37
衍生金融资产							0.00
应收证券清算款						8,551,973.22	8,551,973.22
其他资产							0.00
资产总计	18,450,825.05	-	-	-	-	314,172,743.16	332,623,568.21
负债							
应付赎回款						62,432.73	62,432.73
应付管理人报酬						129,677.19	129,677.19
应付托管费						25,935.44	25,935.44
应付证券清算款						7,837,002.07	7,837,002.07
卖出回购金融资产款							0.00
应付销售服务费							0.00
应付交易费用						378,892.73	378,892.73
应付税费							0.00
应付利息							0.00
应付利润							0.00
其他负债						380,315.48	380,315.48
负债总计	-	-	-	-	-	8,814,255.64	8,814,255.64
利率敏感度缺口	18,450,825.05	-	-	-	-	305,358,487.52	323,809,312.57
上年度末 2018 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	14,921,853.47	-	-	-	-	-	14,921,853.47
结算备付金	672,584.11	-	-	-	-	-	672,584.11
存出保证金	29,846.61	-	-	-	-	-	29,846.61
交易性金融资产	-	-	32,000.00	-	-	251,940,695.04	251,972,695.04
应收利息	-	-	-	-	-	3,212.50	3,212.50
应收申购款	100,559.25	-	-	-	-	202,007.18	302,566.43
应收证券清算款	-	-	-	-	-	26,378,887.02	26,378,887.02
资产总计	15,724,843.44	-	32,000.00	-	-	278,524,801.74	294,281,645.18
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	3,249.61	3,249.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	116,634.62	116,634.62
应付托管费	-	-	-	-	23,326.91	23,326.91
应付证券清算款	-	-	-	-	26,399,500.29	26,399,500.29
应付交易费用	-	-	-	-	321,852.77	321,852.77
应付税费	-	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	-	430,006.20	430,006.20
负债总计	-	-	-	-	27,294,570.41	27,294,570.41
利率敏感度缺口	15,724,843.44	-32,000.00	-	-	251,230,231.33	266,987,074.77

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：基金持有的可转债的市场风险在附注 6.4.13.4.3.2 中进行披露；除此之外，本基金本报告期末及上年度末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末及上年度末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	305,584,436.66	94.37	251,940,695.04	94.36

交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 债券投资	-	-	32,000.00	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	305,584,436.66	94.37	251,972,695.04	94.37

注：本基金投资于沪深 300 安中动态策略指数的成份股的组合比例不低于基金资产的 90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

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 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	沪深 300 安中动态策略 指数上涨 5%	15,237,677.60	12,692,411.64
	沪深 300 安中动态策略 指数下降 5%	-15,237,677.60	-12,692,411.64

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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	305,584,436.66	91.87
	其中：股票	305,584,436.66	91.87
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	18,379,288.89	5.53
8	其他各项资产	8,659,842.66	2.60
9	合计	332,623,568.21	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	9,134,565.21	2.82
B	采矿业	23,525,942.46	7.27
C	制造业	147,808,324.09	45.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,034,616.27	6.50
E	建筑业	5,204,282.75	1.61
F	批发和零售业	4,872,955.80	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	5,424,852.89	1.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,360,631.98	4.43
J	金融业	58,846,071.99	18.17
K	房地产业	7,758,499.25	2.40
L	租赁和商务服务业	3,045,237.58	0.94
M	科学研究和技术服务业	251,372.00	0.08
N	水利、环境和公共	206,668.70	0.06

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,680,254.37	0.52
R	文化、体育和娱乐业	1,008,459.20	0.31
S	综合	-	-
	合计	304,162,734.54	93.93

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,325,121.82	0.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,421,702.12	0.44

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股票投资。

7.3 期末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

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	600519	贵州茅台	15,483	15,235,272.00	4.71
2	601318	中国平安	148,688	13,175,243.68	4.07
3	000858	五粮液	89,869	10,600,048.55	3.27
4	600887	伊利股份	276,532	9,238,934.12	2.85
5	600900	长江电力	487,162	8,720,199.80	2.69
6	000063	中兴通讯	217,028	7,059,920.84	2.18
7	300498	温氏股份	180,300	6,465,558.00	2.00
8	600276	恒瑞医药	84,121	5,551,986.00	1.71
9	600050	中国联通	868,168	5,347,914.88	1.65
10	600036	招商银行	148,389	5,339,036.22	1.65
11	600028	中国石化	972,833	5,321,396.51	1.64
12	601088	中国神华	242,511	4,942,374.18	1.53
13	000651	格力电器	82,115	4,516,325.00	1.39
14	603288	海天味业	39,800	4,179,000.00	1.29
15	000333	美的集团	80,110	4,154,504.60	1.28
16	601857	中国石油	596,570	4,104,401.60	1.27
17	002304	洋河股份	31,078	3,777,841.68	1.17
18	601166	兴业银行	199,663	3,651,836.27	1.13
19	000568	泸州老窖	38,258	3,092,394.14	0.96
20	601988	中国银行	744,934	2,786,053.16	0.86
21	601225	陕西煤业	290,066	2,680,209.84	0.83
22	002714	牧原股份	45,399	2,669,007.21	0.82
23	600030	中信证券	107,104	2,550,146.24	0.79
24	002415	海康威视	90,740	2,502,609.20	0.77
25	601328	交通银行	381,893	2,337,185.16	0.72
26	600795	国电电力	890,748	2,262,499.92	0.70
27	600585	海螺水泥	54,025	2,242,037.50	0.69
28	601933	永辉超市	214,292	2,187,921.32	0.68
29	600016	民生银行	337,076	2,140,432.60	0.66
30	000876	新希望	122,736	2,131,924.32	0.66
31	600522	中天科技	227,600	2,087,092.00	0.64
32	600487	亨通光电	124,300	2,083,268.00	0.64
33	600011	华能国际	332,400	2,070,852.00	0.64
34	600886	国投电力	257,439	2,000,301.03	0.62
35	000725	京东方A	570,338	1,961,962.72	0.61
36	601985	中国核电	351,600	1,954,896.00	0.60
37	600000	浦发银行	162,645	1,899,693.60	0.59

38	601288	农业银行	520,493	1,873,774.80	0.58
39	000002	万科A	66,023	1,836,099.63	0.57
40	600309	万华化学	42,876	1,834,664.04	0.57
41	600498	烽火通信	64,800	1,805,328.00	0.56
42	300059	东方财富	131,165	1,777,285.75	0.55
43	300136	信维通信	71,100	1,738,395.00	0.54
44	601668	中国建筑	299,874	1,724,275.50	0.53
45	600438	通威股份	120,701	1,697,056.06	0.52
46	000001	平安银行	118,161	1,628,258.58	0.50
47	600019	宝钢股份	245,274	1,594,281.00	0.49
48	601601	中国太保	43,355	1,582,891.05	0.49
49	600837	海通证券	111,195	1,577,857.05	0.49
50	002311	海大集团	49,498	1,529,488.20	0.47
51	600104	上汽集团	59,482	1,516,791.00	0.47
52	000895	双汇发展	60,642	1,509,379.38	0.47
53	601888	中国国旅	16,838	1,492,688.70	0.46
54	002475	立讯精密	58,455	1,449,099.45	0.45
55	600023	浙能电力	306,111	1,353,010.62	0.42
56	601138	工业富联	110,100	1,326,705.00	0.41
57	600809	山西汾酒	18,300	1,263,615.00	0.39
58	601899	紫金矿业	333,375	1,256,823.75	0.39
59	000661	长春高新	3,700	1,250,600.00	0.39
60	600048	保利地产	97,893	1,249,114.68	0.39
61	600674	川投能源	133,491	1,188,069.90	0.37
62	601169	北京银行	200,850	1,187,023.50	0.37
63	000538	云南白药	14,035	1,170,799.70	0.36
64	600009	上海机场	13,666	1,144,937.48	0.35
65	600352	浙江龙盛	72,585	1,144,665.45	0.35
66	601211	国泰君安	61,700	1,132,195.00	0.35
67	601766	中国中车	139,756	1,130,626.04	0.35
68	601688	华泰证券	50,458	1,126,222.56	0.35
69	002230	科大讯飞	33,682	1,119,589.68	0.35
70	603156	养元饮品	29,800	1,104,984.00	0.34
71	600031	三一重工	84,385	1,103,755.80	0.34
72	600690	青岛海尔	62,228	1,075,922.12	0.33
73	600570	恒生电子	15,785	1,075,747.75	0.33
74	000596	古井贡酒	9,000	1,066,590.00	0.33
75	300015	爱尔眼科	32,901	1,018,943.97	0.31
76	600436	片仔癀	8,350	961,920.00	0.30
77	002027	分众传媒	181,112	958,082.48	0.30
78	300142	沃森生物	33,001	935,908.36	0.29
79	600027	华电国际	248,100	935,337.00	0.29

80	600583	海油工程	161,237	902,927.20	0.28
81	601229	上海银行	73,336	869,031.60	0.27
82	002142	宁波银行	35,823	868,349.52	0.27
83	601818	光大银行	226,210	861,860.10	0.27
84	601012	隆基股份	37,085	857,034.35	0.26
85	000338	潍柴动力	69,560	854,892.40	0.26
86	600010	包钢股份	504,888	853,260.72	0.26
87	600688	上海石化	161,341	832,519.56	0.26
88	600547	山东黄金	19,846	817,059.82	0.25
89	600588	用友网络	30,302	814,517.76	0.25
90	002594	比亚迪	15,847	803,759.84	0.25
91	600111	北方稀土	61,808	793,614.72	0.25
92	600340	华夏幸福	23,661	770,638.77	0.24
93	603993	洛阳钼业	193,976	768,144.96	0.24
94	002024	苏宁易购	64,659	742,285.32	0.23
95	601006	大秦铁路	89,693	725,616.37	0.22
96	002008	大族激光	20,871	717,544.98	0.22
97	600516	方大炭素	58,065	713,618.85	0.22
98	601600	中国铝业	178,738	700,652.96	0.22
99	002007	华兰生物	22,787	694,775.63	0.21
100	601989	中国重工	124,900	694,444.00	0.21
101	600188	兖州煤业	63,738	692,832.06	0.21
102	002422	科伦药业	23,300	692,709.00	0.21
103	002001	新和成	35,700	688,653.00	0.21
104	601390	中国中铁	105,570	688,316.40	0.21
105	600919	江苏银行	94,100	683,166.00	0.21
106	600196	复星医药	26,993	682,922.90	0.21
107	300003	乐普医疗	29,600	681,392.00	0.21
108	601939	建设银行	91,074	677,590.56	0.21
109	601009	南京银行	81,836	675,965.36	0.21
110	001979	招商蛇口	32,248	673,983.20	0.21
111	002044	美年健康	53,160	661,310.40	0.20
112	600999	招商证券	38,156	652,086.04	0.20
113	601898	中煤能源	135,800	651,840.00	0.20
114	601186	中国铁建	65,466	651,386.70	0.20
115	600703	三安光电	57,526	648,893.28	0.20
116	601628	中国人寿	22,811	646,007.52	0.20
117	600015	华夏银行	83,710	644,567.00	0.20
118	601336	新华保险	11,524	634,165.72	0.20
119	600332	白云山	15,451	633,027.47	0.20
120	002236	大华股份	42,807	621,557.64	0.19
121	600271	XD 航天信	26,963	621,497.15	0.19

122	000100	TCL 集团	186,565	621,261.45	0.19
123	000166	申万宏源	123,730	619,887.30	0.19
124	000963	华东医药	23,583	612,214.68	0.19
125	600741	华域汽车	26,701	576,741.60	0.18
126	601669	中国电建	108,543	574,192.47	0.18
127	601607	上海医药	31,460	570,999.00	0.18
128	600176	中国巨石	58,600	558,458.00	0.17
129	000776	广发证券	40,628	558,228.72	0.17
130	300122	智飞生物	12,900	555,990.00	0.17
131	300033	同花顺	5,600	550,816.00	0.17
132	600025	华能水电	135,000	549,450.00	0.17
133	600660	福耀玻璃	24,016	545,883.68	0.17
134	000413	东旭光电	106,076	545,230.64	0.17
135	002271	东方雨虹	23,800	539,308.00	0.17
136	603019	中科曙光	15,000	526,500.00	0.16
137	600100	同方股份	57,887	523,877.35	0.16
138	002410	广联达	15,900	522,951.00	0.16
139	300017	网宿科技	47,959	516,998.02	0.16
140	600339	中油工程	120,700	509,354.00	0.16
141	600867	通化东宝	32,300	497,420.00	0.15
142	600406	国电南瑞	26,470	493,400.80	0.15
143	000423	东阿阿胶	12,358	492,095.56	0.15
144	601155	新城控股	12,300	489,663.00	0.15
145	002460	赣锋锂业	20,850	488,515.50	0.15
146	002202	金风科技	38,684	480,842.12	0.15
147	300408	三环集团	24,600	478,470.00	0.15
148	002466	天齐锂业	18,635	471,092.80	0.15
149	600489	中金黄金	45,133	463,515.91	0.14
150	600362	江西铜业	28,301	445,457.74	0.14
151	600219	南山铝业	195,160	441,061.60	0.14
152	600085	同仁堂	15,044	436,276.00	0.13
153	601377	兴业证券	64,626	435,579.24	0.13
154	000157	中联重科	72,415	435,214.15	0.13
155	000630	铜陵有色	173,010	425,604.60	0.13
156	000786	北新建材	23,100	418,803.00	0.13
157	000703	恒逸石化	30,501	416,643.66	0.13
158	600535	天士力	25,081	415,090.55	0.13
159	601808	中海油服	43,101	415,062.63	0.13
160	000783	长江证券	52,842	412,696.02	0.13
161	002493	荣盛石化	34,100	411,246.00	0.13
162	002241	歌尔股份	46,082	409,668.98	0.13
163	000629	攀钢钒钛	119,100	403,749.00	0.12

164	601901	方正证券	56,700	403,137.00	0.12
165	002179	中航光电	12,043	402,958.78	0.12
166	600705	中航资本	73,938	400,743.96	0.12
167	601111	中国国航	41,765	399,691.05	0.12
168	000069	华侨城 A	56,187	390,499.65	0.12
169	600177	雅戈尔	61,348	389,559.80	0.12
170	601108	财通证券	35,000	384,300.00	0.12
171	600089	特变电工	52,957	383,938.25	0.12
172	600637	东方明珠	36,153	381,052.62	0.12
173	601800	中国交建	33,575	380,069.00	0.12
174	603799	华友钴业	17,524	373,436.44	0.12
175	600029	南方航空	48,131	371,571.32	0.11
176	600383	金地集团	31,130	371,380.90	0.11
177	002456	欧菲光	46,087	361,322.08	0.11
178	600346	恒力股份	29,460	358,233.60	0.11
179	600115	东方航空	55,811	349,934.97	0.11
180	002555	三七互娱	25,600	346,880.00	0.11
181	603986	兆易创新	4,000	346,800.00	0.11
182	000709	河钢股份	115,945	346,675.55	0.11
183	601555	东吴证券	33,785	346,296.25	0.11
184	601992	金隅集团	91,000	342,160.00	0.11
185	300296	利亚德	43,000	336,690.00	0.10
186	600606	绿地控股	49,000	334,670.00	0.10
187	600221	海航控股	161,117	327,067.51	0.10
188	002624	完美世界	12,600	325,206.00	0.10
189	600061	国投资本	23,200	325,032.00	0.10
190	300124	汇川技术	14,069	322,320.79	0.10
191	600109	国金证券	33,102	321,751.44	0.10
192	002065	东华软件	45,748	319,778.52	0.10
193	600018	上港集团	46,630	318,016.60	0.10
194	603858	步长制药	12,251	315,708.27	0.10
195	000768	中航飞机	19,632	309,204.00	0.10
196	601788	光大证券	26,908	307,289.36	0.09
197	603160	汇顶科技	2,200	305,360.00	0.09
198	601618	中国中冶	100,121	304,367.84	0.09
199	601216	君正集团	92,034	302,791.86	0.09
200	000898	鞍钢股份	79,850	302,631.50	0.09
201	000425	徐工机械	67,483	300,974.18	0.09
202	600066	宇通客车	23,030	299,850.60	0.09
203	002252	上海莱士	41,670	289,606.50	0.09
204	601877	正泰电器	12,400	286,316.00	0.09
205	600893	航发动力	12,607	286,304.97	0.09

206	002352	顺丰控股	8,400	285,264.00	0.09
207	600398	海澜之家	31,300	283,891.00	0.09
208	002153	石基信息	7,837	283,621.03	0.09
209	002602	世纪华通	25,900	282,828.00	0.09
210	300144	宋城演艺	12,200	282,308.00	0.09
211	600566	济川药业	9,203	277,102.33	0.09
212	601727	上海电气	50,891	273,793.58	0.08
213	601919	中远海控	54,414	273,158.28	0.08
214	002739	万达电影	14,700	271,068.00	0.08
215	002558	巨人网络	14,801	268,934.17	0.08
216	002010	传化智联	35,700	268,821.00	0.08
217	600004	白云机场	14,700	267,540.00	0.08
218	300072	三聚环保	33,077	262,300.61	0.08
219	002294	信立泰	11,602	259,652.76	0.08
220	000728	国元证券	27,788	254,815.96	0.08
221	603259	药明康德	2,900	251,372.00	0.08
222	002773	康弘药业	7,600	250,192.00	0.08
223	601998	中信银行	41,709	249,002.73	0.08
224	601018	宁波港	56,589	248,425.71	0.08
225	002601	龙蟠佰利	16,700	247,661.00	0.08
226	600297	广汇汽车	55,290	246,593.40	0.08
227	600068	葛洲坝	39,350	245,150.50	0.08
228	002673	西部证券	23,780	239,702.40	0.07
229	300024	机器人	15,558	236,948.34	0.07
230	002081	金螳螂	22,982	236,944.42	0.07
231	603833	欧派家居	2,200	236,764.00	0.07
232	600482	中国动力	10,000	236,200.00	0.07
233	600170	上海建工	62,242	234,029.92	0.07
234	600926	杭州银行	27,900	232,407.00	0.07
235	601021	春秋航空	5,110	229,950.00	0.07
236	601997	贵阳银行	26,500	229,225.00	0.07
237	002146	荣盛发展	23,996	225,322.44	0.07
238	601198	东兴证券	18,900	224,532.00	0.07
239	002411	延安必康	12,700	220,980.00	0.07
240	002032	苏泊尔	2,900	219,907.00	0.07
241	002508	老板电器	8,100	219,834.00	0.07
242	601881	中国银河	17,900	219,275.00	0.07
243	000625	长安汽车	32,938	218,378.94	0.07
244	601838	成都银行	24,700	218,101.00	0.07
245	000961	中南建设	25,100	217,366.00	0.07
246	601360	三六零	10,100	215,938.00	0.07
247	002050	三花智控	19,990	210,894.50	0.07

248	300070	碧水源	26,530	206,668.70	0.06
249	600998	九州通	16,400	202,704.00	0.06
250	600977	中国电影	12,800	200,448.00	0.06
251	000938	紫光股份	7,336	199,906.00	0.06
252	600118	中国卫星	8,540	192,577.00	0.06
253	600369	西南证券	38,758	191,464.52	0.06
254	600208	新湖中宝	58,833	184,735.62	0.06
255	600663	陆家嘴	11,700	181,350.00	0.06
256	600760	中航沈飞	6,200	179,986.00	0.06
257	601238	广汽集团	16,400	179,252.00	0.06
258	600153	建发股份	20,166	179,074.08	0.06
259	002938	鹏鼎控股	6,000	176,160.00	0.05
260	000627	天茂集团	27,100	175,879.00	0.05
261	601633	长城汽车	21,239	175,646.53	0.05
262	600038	中直股份	4,278	175,483.56	0.05
263	000656	金科股份	29,100	175,473.00	0.05
264	601878	浙商证券	18,300	170,190.00	0.05
265	601117	中国化学	27,500	165,550.00	0.05
266	600816	安信信托	32,664	164,953.20	0.05
267	600415	小商品城	38,920	160,350.40	0.05
268	300413	芒果超媒	3,600	147,780.00	0.05
269	000671	阳光城	22,300	144,504.00	0.04
270	300433	蓝思科技	20,099	140,090.03	0.04
271	000553	安道麦 A	12,800	137,216.00	0.04
272	000408	藏格控股	16,400	135,628.00	0.04
273	600704	物产中大	24,200	131,164.00	0.04
274	601066	中信建投	6,200	130,696.00	0.04
275	002120	韵达股份	4,230	130,368.60	0.04
276	000402	金融街	15,834	124,138.56	0.04
277	603260	合盛硅业	2,600	122,356.00	0.04
278	002468	申通快递	4,600	114,724.00	0.04
279	601228	广州港	27,300	114,114.00	0.04
280	600372	中航电子	7,276	107,975.84	0.03
281	300251	光线传媒	15,714	106,855.20	0.03
282	601212	白银有色	22,900	100,531.00	0.03
283	000415	渤海租赁	24,500	96,040.00	0.03
284	601319	中国人保	9,800	93,002.00	0.03
285	002925	盈趣科技	2,300	89,723.00	0.03
286	600299	安迪苏	8,100	83,997.00	0.03
287	601162	天风证券	7,200	78,048.00	0.02
288	002939	长城证券	4,500	75,105.00	0.02
289	601828	美凯龙	5,700	69,255.00	0.02

290	600390	五矿资本	7,300	68,839.00	0.02
291	002625	光启技术	7,400	68,746.00	0.02
292	002945	华林证券	3,600	66,600.00	0.02
293	600233	圆通速递	5,400	66,582.00	0.02
294	600733	北汽蓝谷	7,200	59,472.00	0.02
295	601298	青岛港	6,900	57,891.00	0.02
296	601577	长沙银行	5,100	48,654.00	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

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	600485	信威集团	201,904	1,162,967.04	0.36
2	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.02
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
4	603217	元利科技	584	39,268.16	0.01
5	603863	N 松炆	1,612	37,204.96	0.01
6	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
7	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
8	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

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	601318	中国平安	15,814,142.00	5.92
2	600276	恒瑞医药	10,922,721.52	4.09
3	000651	格力电器	10,238,922.00	3.83
4	000333	美的集团	9,270,267.91	3.47
5	000858	五粮液	8,522,186.00	3.19
6	600900	长江电力	7,926,723.00	2.97
7	600887	伊利股份	7,692,512.98	2.88
8	600519	贵州茅台	7,459,486.00	2.79
9	002415	海康威视	6,952,864.70	2.60
10	600036	招商银行	6,609,310.00	2.48
11	600886	国投电力	6,548,487.44	2.45
12	300498	温氏股份	6,483,807.00	2.43
13	600795	国电电力	6,013,682.00	2.25
14	601985	中国核电	5,522,880.00	2.07
15	600011	华能国际	5,484,885.04	2.05
16	000725	京东方 A	5,299,834.00	1.99
17	601166	兴业银行	4,629,752.98	1.73

18	600023	浙能电力	4,255,795.96	1.59
19	300059	东方财富	3,980,713.90	1.49
20	601988	中国银行	3,913,034.00	1.47

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	000858	五粮液	13,694,986.08	5.13
2	600900	长江电力	13,332,028.00	4.99
3	600519	贵州茅台	12,454,886.41	4.66
4	600887	伊利股份	12,450,119.01	4.66
5	600886	国投电力	11,683,794.85	4.38
6	600276	恒瑞医药	10,618,342.04	3.98
7	600795	国电电力	10,315,713.00	3.86
8	000651	格力电器	9,906,773.29	3.71
9	601985	中国核电	9,452,891.91	3.54
10	600011	华能国际	9,386,107.33	3.52
11	000333	美的集团	8,951,275.47	3.35
12	601318	中国平安	7,872,976.54	2.95
13	600023	浙能电力	7,045,084.00	2.64
14	002415	海康威视	7,020,389.00	2.63
15	600674	川投能源	6,576,133.00	2.46
16	603288	海天味业	5,878,178.99	2.20
17	002304	洋河股份	5,857,854.40	2.19
18	600027	华电国际	5,552,622.00	2.08
19	000725	京东方 A	4,981,271.00	1.87
20	601991	大唐发电	4,720,686.00	1.77

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	353,012,014.81
卖出股票收入(成交)总额	359,483,824.08

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

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：本基金本报告期内未投资国债期货。

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、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。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未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	42,304.21
2	应收证券清算款	8,551,973.22
3	应收股利	-
4	应收利息	3,427.86
5	应收申购款	62,137.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,659,842.66

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未存在流通受限的情况。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	1,162,967.04	0.36	重大资产重组停牌

§ 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 (%)
4,431	49,288.92	153,401,711.95	70.24	64,997,479.56	29.76

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	11,567.93	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 (2013 年 11 月 6 日) 基金份额总额	274,994,745.19
本报告期期初基金份额总额	221,135,626.32
本报告期基金总申购份额	30,321,643.61
减：本报告期基金总赎回份额	33,058,078.42
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	218,399,191.51

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、基金托管人的专门基金托管部门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，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	2	486,863,217.30	68.48%	449,090.85	68.40%	-
东方证券	2	224,143,323.42	31.52%	207,490.96	31.60%	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

长江证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	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	
	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

				比例		的比例
国金证券	385,703.50	100.00%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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，基金会会计应负责协助及时催缴。

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内退租 3 家证券公司的 4 个交易单元：联讯证券（上交所单元）、江海证券（深交所单元）、民族证券（上交所单元和深交所单元）。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 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
2	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
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加浙商银行作为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-23
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大智慧基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-01-26
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞农商银行为代销机构的公告	中证报, 证券时报, 上证报, 公司网站	2019-02-01
6	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告（信威集团）	上证报, 公司网站	2019-02-15
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加前海财厚为代销机构并参与费率优惠活动的公告	证券时报, 公司网站	2019-03-22
8	汇添富基金旗下 115 只基金 2018 年年	中证报, 上交所, 证券时	2019-03-26

	度报告	报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	上证报, 公司网站	2019-03-27
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中证报, 公司网站	2019-04-02
11	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
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加广发银行为代销机构的公告	上证报, 公司网站	2019-04-26
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	上证报, 公司网站	2019-05-21
14	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金更新招募说明书 (2019 年第 1 号)	证券时报, 公司网站	2019-06-15

§ 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超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		区 间					
机 构	1	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	152,645,529.99	-	-	152,645,529.99	69.89
个 人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

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 安中动态策略指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型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 安中动态策略指数型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

2019 年 8 月 29 日