

汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 更新招募说明书摘要

(2020 年 4 月 14 日更新)

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

重要提示

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，基金代码：000368，以下简称“本基金”）经 2013 年 9 月 24 日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1209 号文准予注册募集。本基金基金合同于 2013 年 11 月 6 日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资者拟认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。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。

本基金更新招募说明书“基金的投资”章节中有关“风险收益特征”的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行“销售适当性风险评价”，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的基金产品“风险等级评价”与“基金的投资”章节中“风险收益特征”的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金本次更新的招募说明书主要根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和修订后的基金合同对相关信息进行更新，同时对基金管理人、基金托管人、财务数据和净值表现等其他信息一并更新，更新所载内容截止日为 2020 年 4 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日。

一、基金管理人

一、基金管理人简况

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%

二、主要人员情况

1、董事会成员

李文先生，2015年4月16日担任董事长。国籍：中国，厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长，汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长，中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副局长、副局长，中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长，东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理，稽核总部总经理，东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，汇添富基金管理股份有限公司督察长。

程峰先生，2016年11月20日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理，上海上报资产管理有限公司董事长，上海文化产权交易所股份有限公司董事长，上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记，上海机械进出口(集团)有限公司副总裁，上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长，上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长，上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任，上海国际集团有限公司行政管理总部总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长，上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

林福杰先生，2018年3月21日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理，东航集团财务有限责任公司副总经理，国泰人寿保险有限责任公司副总经理，东航金控有限责任公司党

委书记、副总经理。

张晖先生，2015 年 4 月 16 日担任董事，总经理。国籍：中国，上海财经大学经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理，汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师，富国基金管理有限公司研究主管和基金经理，汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监，曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

林志军先生，2015 年 4 月 16 日担任独立董事。国籍：中国香港，厦门大学经济学博士，加拿大 Saskatchewan 大学工商管理理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员会计划财务处会计，五大国际会计师事务所 Touche Ross International(现为德勤) 加拿大多伦多分所审计员，厦门大学会计师事务所副主任会计师，厦门大学经济学院讲师、副教授，伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者，美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者，加拿大 Lethbridge 大学管理学院会计学讲师、副教授 (tenured)，香港大学商学院访问教授，香港浸会大学商学院会计与法律系教授，博导，系主任。

杨燕青女士，2011 年 12 月 19 日担任独立董事，国籍：中国，复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑，第一财经研究院院长，国家金融与发展实验室特邀高级研究员，上海政协委员，《第一财经日报》创始编委之一，第一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人，《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003 年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

魏尚进 (Shangjin Wei) 先生，2020 年 1 月 9 日担任独立董事，国籍：美国，加州大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授、哥伦比亚大学终身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授，世界银行顾问，国际货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长。

2、监事会成员

任瑞良先生，2004 年 10 月 20 日担任监事，2015 年 6 月 30 日担任监事会主席。国籍：中国，大学学历，会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管，文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理

等。

王如富先生，2015 年 9 月 8 日担任监事。国籍：中国，硕士研究生，注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员，金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任（主持工作），东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生，2015 年 6 月 30 日担任监事，国籍：中国，国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司，东航集团财务有限责任公司。

王静女士，2008 年 2 月 23 日担任职工监事，国籍：中国，中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部，东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士，2008 年 2 月 23 日担任职工监事，国籍：中国，华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监，汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生，2013 年 8 月 8 日担任职工监事，国籍：中国，北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司，泰科电子（上海）有限公司能源事业部。

3、高管人员

李文先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

张晖先生，2015 年 6 月 25 日担任总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

雷继明先生，2012 年 3 月 7 日担任副总经理。国籍：中国，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011 年 12 月加盟汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

娄焱女士，2013 年 1 月 7 日担任副总经理。国籍：中国，金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上

海代表处工作，负责投资银行、证券投资研究，以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011 年 4 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

袁建军先生，2015 年 8 月 5 日担任副总经理。国籍：中国，金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于 2014 年至 2015 年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005 年 4 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生，2017 年 3 月 3 日担任副总经理。国籍：中国，武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长，厦门建行信用卡部副处长、处长，厦门建行信息技术部处长，建总行北京开发中心负责人，建总行信息技术管理部副总经理，建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任，建总行信息技术管理部资深专员（副总经理级）。2016 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生，2015 年 6 月 25 日担任督察长。国籍：中国，上海财经大学经济学博士，历任上海证监局主任科员、副处长，上海农商银行同业金融部副总经理，汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4、基金经理

吴振翔先生，国籍：中国，中国科学技术大学管理学博士，14 年证券从业经验。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 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，2019 年 7 月 26 日至今任添富中证长三角 ETF 的基金经理，2019 年 9 月 24 日至今任汇添富中证长三角 ETF 联接的基金经理，2019 年 11 月 6 日任添富中证国企一带一路 ETF 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。

5、投资决策委员会

主席：袁建军（副总经理）

成员：韩贤旺（首席经济学家）、王栩（总经理助理，权益投资总监）、陆文磊（总经理助理，固定收益投资总监）、劳杰男（研究总监）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

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

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 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。

（三）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 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《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 68 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、相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、直销机构

(1) 汇添富基金管理股份有限公司直销中心

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：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932893

传真：（021）50199035 或（021）50199036

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）

网址：www.99fund.com

邮箱: guitai@htffund.com

(2) 汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统 (trade.99fund.com)

2、代销机构

本基金的其他销售机构请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金,并在基金管理人网站公示。

二、登记机构

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: 上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人: 李文

电话: (021) 28932888

传真: (021) 28932876

联系人: 韩从慧

三、出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

住所: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人: 俞卫锋

电话: (021) 31358666

传真: (021) 31358600

经办律师: 黎明、孙睿

联系人: 陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所

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

四、基金的名称

本基金名称：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

基金代码：000368

五、基金的类型

本基金为股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：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%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照成份股在沪深 300 安中动态策略指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。沪深 300 安中动态策略指数的提供者将每月更新指数组合的成分股以及相关权重并通知本基金管理人，本基金管理人将做出对应的调整以便匹配目标指数的配置。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

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%，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，其余资产可投资于银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。

本基金将采用货币市场工具对基金资产进行流动性管理。在满足安全性和保证流动性的基础上，本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，有效利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。

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%。

（二）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）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%；

（2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的

10%；

(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上(含 **BBB**)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(13) 本基金主动投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(14) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手方开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第 (2)、(10)、(13)、(14) 项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规和监管部门取消上述禁止性规定的，如适用于本基金，则本基金不受上述相关限制。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{沪深 300 安中动态策略指数收益率} \times 95\% + \text{金融机构人民币活期存款基准利率（税后）} \times 5\%$

若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时，本基金管理人可以在与基金托管人协商同意后变更业绩比较基准的组成和权重。若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案并在指定媒介公告。若变更业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应于变更前在指定媒介上公告。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

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。

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 2020 年 03 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。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

投资组合报告

1.1 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	318,489,670.48	88.65
	其中：股票	318,489,670.48	88.65
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	18,623,498.68	5.18
8	其他各项资产	22,168,399.86	6.17
9	合计	359,281,569.02	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 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	2,598,280.21	0.76
B	采矿业	32,434,597.29	9.48
C	制造业	190,136,132.97	55.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,962,834.03	6.42
E	建筑业	5,142,373.26	1.50
F	批发和零售业	2,489,466.65	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	5,148,467.35	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,433,585.74	6.85
J	金融业	19,678,020.72	5.75
K	房地产业	2,394,814.49	0.70
L	租赁和商务服务业	3,045,102.22	0.89
M	科学研究和技术服务业	1,221,511.20	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	218,348.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,854,563.44	0.83
R	文化、体育和娱乐业	1,053,475.60	0.31
S	综合	-	-
	合计	313,811,573.17	91.75

1.2.2 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	275,932.80	0.08
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	2,106,125.53	0.62
J	金融业	2,296,038.98	0.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,678,097.31	1.37

1.2.3 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。

1.3 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

1.3.1 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	600900	长江电力	596,235	10,958,799.30	3.20
2	600585	海螺水泥	159,625	8,747,450.00	2.56
3	600519	贵州茅台	6,832	8,082,256.00	2.36
4	002415	海康威视	228,349	7,476,146.26	2.19
5	002475	立讯精密	196,791	7,182,871.50	2.10
6	600309	万华化学	126,776	7,121,007.92	2.08
7	000063	中兴通讯	196,528	6,955,125.92	2.03
8	000725	京东方A	1,428,338	6,484,654.52	1.90
9	600276	恒瑞医药	70,721	6,189,501.92	1.81
10	600028	中国石化	1,061,533	5,424,433.63	1.59
11	000651	格力电器	76,415	5,011,295.70	1.47
12	601899	紫金矿业	1,050,975	4,823,975.25	1.41
13	601088	中国神华	260,511	4,754,325.75	1.39
14	600050	中国联通	784,568	4,621,105.52	1.35
15	000333	美的集团	76,410	4,450,882.50	1.30
16	601857	中国石油	735,270	4,286,624.10	1.25
17	600019	宝钢股份	731,474	4,198,660.76	1.23
18	601318	中国平安	46,588	3,981,410.48	1.16
19	000858	五粮液	24,969	3,321,126.69	0.97
20	002230	科大讯飞	92,932	3,204,295.36	0.94

21	600570	恒生电子	40,085	3,115,807.05	0.91
22	600352	浙江龙盛	211,685	3,063,081.95	0.90
23	600703	三安光电	155,326	2,851,785.36	0.83
24	300136	信维通信	62,800	2,849,864.00	0.83
25	601225	陕西煤业	313,266	2,816,261.34	0.82
26	601138	工业富联	153,300	2,800,791.00	0.82
27	600547	山东黄金	84,204	2,746,734.48	0.80
28	002241	歌尔股份	135,482	2,698,801.44	0.79
29	600346	恒力股份	165,760	2,665,420.80	0.78
30	600010	宝钢股份	1,868,088	2,465,876.16	0.72
31	603993	洛阳钼业	554,176	2,416,207.36	0.71
32	600887	伊利股份	78,032	2,414,310.08	0.71
33	603986	兆易创新	10,900	2,233,301.00	0.65
34	600588	用友网络	78,302	2,223,776.80	0.65
35	002460	赣锋锂业	63,450	2,209,963.50	0.65
36	002236	大华股份	109,307	2,173,023.16	0.64
37	002008	大族激光	52,471	2,098,840.00	0.61
38	600886	国投电力	223,183	2,048,819.94	0.60
39	002493	荣盛石化	156,600	1,940,274.00	0.57
40	600111	北方稀土	175,308	1,900,338.72	0.56
41	002456	欧菲光	121,087	1,888,957.20	0.55
42	600795	国电电力	799,648	1,871,176.32	0.55
43	601600	中国铝业	526,838	1,865,006.52	0.55
44	002271	东方雨虹	70,700	1,860,117.00	0.54
45	600176	中国巨石	168,800	1,839,920.00	0.54
46	600487	亨通光电	112,600	1,830,876.00	0.54
47	601985	中国核电	360,500	1,802,500.00	0.53
48	002555	三七互娱	66,200	1,782,766.00	0.52
49	002466	天齐锂业	57,655	1,740,027.90	0.51
50	000786	北新建材	67,400	1,715,330.00	0.50
51	600522	中天科技	206,400	1,713,120.00	0.50
52	600011	华能国际	302,800	1,689,624.00	0.49
53	600036	招商银行	44,689	1,679,412.62	0.49
54	601668	中国建筑	298,574	1,677,985.88	0.49
55	300498	温氏股份	48,000	1,612,800.00	0.47
56	600516	方大炭素	131,765	1,602,262.40	0.47
57	600498	烽火通信	57,500	1,578,375.00	0.46
58	603160	汇顶科技	7,600	1,567,880.00	0.46
59	000938	紫光股份	49,236	1,555,857.60	0.45
60	600271	航天信息	67,063	1,553,849.71	0.45
61	603501	韦尔股份	10,800	1,548,720.00	0.45

62	300033	同花顺	13,500	1,472,985.00	0.43
63	600183	生益科技	70,200	1,468,584.00	0.43
64	300408	三环集团	65,600	1,461,568.00	0.43
65	002410	广联达	42,100	1,430,558.00	0.42
66	600031	三一重工	82,585	1,408,074.25	0.41
67	600362	江西铜业	82,801	1,401,820.93	0.41
68	000661	长春高新	3,100	1,385,700.00	0.41
69	601888	中国国旅	15,238	1,355,420.10	0.40
70	603019	中科曙光	38,700	1,338,246.00	0.39
71	002624	完美世界	30,200	1,333,028.00	0.39
72	600219	南山铝业	590,360	1,322,406.40	0.39
73	600104	上汽集团	54,682	1,304,165.70	0.38
74	600583	海油工程	175,737	1,296,939.06	0.38
75	600100	同方股份	146,087	1,281,182.99	0.37
76	002601	龙蟒佰利	82,300	1,266,597.00	0.37
77	002179	中航光电	32,343	1,263,317.58	0.37
78	000703	恒逸石化	90,501	1,259,773.92	0.37
79	601166	兴业银行	62,563	1,238,747.40	0.36
80	603259	药明康德	13,260	1,221,511.20	0.36
81	600489	中金黄金	140,833	1,194,263.84	0.35
82	000630	铜陵有色	505,210	1,177,139.30	0.34
83	600674	川投能源	119,191	1,174,031.35	0.34
84	600009	上海机场	14,666	1,154,947.50	0.34
85	603288	海天味业	10,700	1,150,357.00	0.34
86	300017	网宿科技	120,059	1,144,162.27	0.33
87	600690	海尔智家	58,028	1,131,546.00	0.33
88	000338	潍柴动力	70,460	1,118,904.80	0.33
89	300015	爱尔眼科	28,201	1,115,631.56	0.33
90	600023	浙能电力	274,847	1,088,394.12	0.32
91	000538	云南白药	11,735	1,049,461.05	0.31
92	002027	分众传媒	164,212	1,027,967.12	0.30
93	000629	攀钢钒钛	350,100	1,022,292.00	0.30
94	601766	中国中车	141,956	1,013,565.84	0.30
95	601992	金隅集团	269,100	1,003,743.00	0.29
96	002714	牧原股份	11,099	985,480.21	0.29
97	002044	美年健康	65,892	981,131.88	0.29
98	601012	隆基股份	38,585	958,065.55	0.28
99	601988	中国银行	245,634	906,389.46	0.26
100	000709	河钢股份	349,745	902,342.10	0.26
101	002916	深南电路	6,300	895,230.00	0.26
102	000723	美锦能源	94,200	888,306.00	0.26

103	601808	中海油服	45,801	879,379.20	0.26
104	601216	君正集团	279,634	875,254.42	0.26
105	300142	沃森生物	26,901	872,668.44	0.26
106	002304	洋河股份	7,778	859,469.00	0.25
107	600030	中信证券	33,804	855,241.20	0.25
108	300003	乐普医疗	25,400	840,232.00	0.25
109	600027	华电国际	223,700	820,979.00	0.24
110	000568	泸州老窖	9,458	819,819.44	0.24
111	000100	TCL 科技	170,865	763,766.55	0.22
112	300347	泰格医药	12,000	757,800.00	0.22
113	600188	兖州煤业	70,938	749,105.28	0.22
114	600436	片仔癀	6,750	741,622.50	0.22
115	601898	中煤能源	145,400	729,908.00	0.21
116	601390	中国中铁	122,570	728,065.80	0.21
117	601989	中国重工	138,700	726,788.00	0.21
118	002938	鹏鼎控股	16,127	724,102.30	0.21
119	002153	石基信息	18,537	722,943.00	0.21
120	601006	大秦铁路	86,893	713,391.53	0.21
121	000001	平安银行	43,161	709,998.45	0.21
122	600016	民生银行	111,076	700,889.56	0.20
123	300433	蓝思科技	50,699	700,660.18	0.20
124	002594	比亚迪	14,547	693,455.49	0.20
125	000002	万 科 A	21,423	689,392.14	0.20
126	601186	中国铁建	67,966	689,175.24	0.20
127	002007	华兰生物	19,187	674,423.05	0.20
128	603799	华友钴业	17,024	670,575.36	0.20
129	002558	巨人网络	37,001	668,238.06	0.20
130	002001	新 和 成	28,700	667,562.00	0.20
131	601328	交通银行	117,693	662,611.59	0.19
132	600989	宝丰能源	67,200	639,072.00	0.19
133	601288	农业银行	170,493	629,119.17	0.18
134	600000	浦发银行	50,545	625,241.65	0.18
135	600741	华域汽车	23,801	618,587.99	0.18
136	600196	复星医药	23,193	616,933.80	0.18
137	600406	国电南瑞	28,870	611,466.60	0.18
138	002010	传化智联	84,900	592,602.00	0.17
139	002024	苏宁易购	58,459	591,020.49	0.17
140	000876	新 希 望	28,536	569,293.20	0.17
141	600660	福耀玻璃	23,416	561,749.84	0.16
142	300122	智飞生物	10,900	541,294.00	0.16
143	600837	海通证券	34,995	541,022.70	0.16

144	601601	中国太保	14,255	539,409.20	0.16
145	601360	三六零	22,600	531,326.00	0.16
146	002202	金风科技	43,184	516,048.80	0.15
147	000157	中联重科	76,815	513,124.20	0.15
148	600048	保利地产	31,693	512,792.74	0.15
149	600025	华能水电	120,500	508,510.00	0.15
150	601669	中国电建	117,143	508,400.62	0.15
151	000898	鞍钢股份	151,650	508,027.50	0.15
152	000963	华东医药	19,883	484,747.54	0.14
153	601607	上海医药	26,360	484,233.20	0.14
154	300124	汇川技术	15,569	477,034.16	0.14
155	600332	白云山	12,851	457,624.11	0.13
156	002422	科伦药业	19,300	453,357.00	0.13
157	601111	中国国航	44,465	430,865.85	0.13
158	600867	通化东宝	32,600	412,390.00	0.12
159	600177	雅戈尔	58,848	410,170.56	0.12
160	600115	东方航空	68,011	395,143.91	0.12
161	300144	宋城演艺	12,400	383,284.00	0.11
162	601933	永辉超市	50,492	380,709.68	0.11
163	601169	北京银行	66,750	379,140.00	0.11
164	601211	国泰君安	20,500	379,045.00	0.11
165	000895	双汇发展	13,042	378,609.26	0.11
166	002050	三花智控	21,690	375,887.70	0.11
167	600029	南方航空	51,931	372,864.58	0.11
168	600089	特变电工	55,957	372,114.05	0.11
169	002311	海大集团	10,298	370,728.00	0.11
170	300059	东方财富	23,365	368,466.05	0.11
171	000425	徐工机械	67,283	368,038.01	0.11
172	002142	宁波银行	13,023	366,597.45	0.11
173	000423	东阿阿胶	10,358	366,362.46	0.11
174	002352	顺丰控股	9,700	360,743.00	0.11
175	601877	正泰电器	13,000	348,400.00	0.10
176	000768	中航飞机	21,032	344,504.16	0.10
177	600438	通威股份	26,101	342,706.13	0.10
178	002252	上海莱士	45,370	336,645.40	0.10
179	601688	华泰证券	16,558	336,292.98	0.10
180	000625	长安汽车	33,138	332,374.14	0.10
181	600085	同仁堂	11,744	330,945.92	0.10
182	600637	东方明珠	34,653	324,352.08	0.09
183	601800	中国交建	34,975	320,371.00	0.09
184	600535	天士力	20,681	318,901.02	0.09

185	002602	世纪华通	27,800	317,754.00	0.09
186	601818	光大银行	71,810	316,682.10	0.09
187	600968	海油发展	108,000	316,440.00	0.09
188	600066	宇通客车	22,130	315,352.50	0.09
189	601919	中远海控	59,114	311,530.78	0.09
190	600809	山西汾酒	3,400	304,980.00	0.09
191	601618	中国中冶	108,821	304,698.80	0.09
192	601229	上海银行	32,037	304,031.13	0.09
193	600893	航发动力	13,807	299,335.76	0.09
194	600018	上港集团	49,530	285,788.10	0.08
195	600068	葛洲坝	41,850	279,558.00	0.08
196	600004	白云机场	15,900	277,455.00	0.08
197	002508	老板电器	8,200	277,242.00	0.08
198	601727	上海电气	53,391	265,887.18	0.08
199	601628	中国人寿	7,411	258,421.57	0.08
200	002841	视源股份	3,000	257,100.00	0.08
201	002739	万达电影	14,000	254,100.00	0.07
202	601021	春秋航空	5,710	250,611.90	0.07
203	601698	中国卫通	21,800	246,776.00	0.07
204	603833	欧派家居	2,100	245,700.00	0.07
205	601009	南京银行	27,336	239,736.72	0.07
206	600999	招商证券	12,956	236,965.24	0.07
207	600170	上海建工	66,842	236,620.68	0.07
208	300024	机器人	16,758	234,612.00	0.07
209	600919	江苏银行	31,400	227,336.00	0.07
210	601018	宁波港	59,689	226,818.20	0.07
211	300413	芒果超媒	6,460	225,841.60	0.07
212	002773	康弘药业	6,100	225,517.00	0.07
213	002032	苏泊尔	2,900	222,662.00	0.07
214	002411	延安必康	14,100	220,383.00	0.06
215	601939	建设银行	30,274	218,881.02	0.06
216	600038	中直股份	4,578	218,416.38	0.06
217	300070	碧水源	28,730	218,348.00	0.06
218	600015	华夏银行	27,910	214,069.70	0.06
219	001979	招商蛇口	10,648	211,575.76	0.06
220	600760	中航沈飞	6,600	208,560.00	0.06
221	600482	中国动力	10,400	208,000.00	0.06
222	000166	申万宏源	40,530	207,513.60	0.06
223	002081	金螳螂	23,382	206,229.24	0.06
224	000596	古井贡酒	1,500	203,880.00	0.06
225	600118	中国卫星	9,140	195,321.80	0.06

226	600153	建发股份	21,666	194,777.34	0.06
227	601336	新华保险	3,924	192,864.60	0.06
228	601117	中国化学	29,700	191,268.00	0.06
229	600977	中国电影	12,500	190,250.00	0.06
230	600998	九州通	12,900	182,535.00	0.05
231	601633	长城汽车	20,439	180,885.15	0.05
232	002294	信立泰	9,002	179,499.88	0.05
233	600566	济川药业	7,403	179,004.54	0.05
234	601238	广汽集团	15,200	177,688.00	0.05
235	600297	广汇汽车	52,590	171,443.40	0.05
236	600398	海澜之家	21,000	161,280.00	0.05
237	601901	方正证券	18,600	161,262.00	0.05
238	002120	韵达股份	4,730	157,509.00	0.05
239	603156	养元饮品	5,400	156,762.00	0.05
240	601377	兴业证券	21,326	150,988.08	0.04
241	600383	金地集团	10,230	148,335.00	0.04
242	600340	华夏幸福	5,161	148,120.70	0.04
243	002736	国信证券	11,400	143,070.00	0.04
244	000069	华侨城 A	18,187	141,676.73	0.04
245	601108	财通证券	11,500	130,410.00	0.04
246	000783	长江证券	17,642	125,963.88	0.04
247	603260	合盛硅业	4,140	122,005.80	0.04
248	600372	中航电子	8,376	119,274.24	0.03
249	600705	中航资本	24,338	118,039.30	0.03
250	601788	光大证券	8,908	116,694.80	0.03
251	600061	国投资本	7,700	116,578.00	0.03
252	600606	绿地控股	16,400	113,980.00	0.03
253	601555	东吴证券	10,985	109,740.15	0.03
254	600109	国金证券	11,102	103,248.60	0.03
255	002468	申通快递	4,700	91,650.00	0.03
256	601212	白银有色	24,600	90,528.00	0.03
257	601998	中信银行	13,909	85,818.53	0.03
258	600926	杭州银行	9,300	85,188.00	0.02
259	000728	国元证券	9,188	85,172.76	0.02
260	000961	中南建设	8,000	84,400.00	0.02
261	601997	贵阳银行	8,700	83,172.00	0.02
262	601198	东兴证券	6,300	82,782.00	0.02
263	600208	新潮中宝	21,333	80,638.74	0.02
264	002673	西部证券	7,880	77,224.00	0.02
265	002146	荣盛发展	7,796	76,634.68	0.02
266	600299	安迪苏	6,800	75,208.00	0.02

267	000656	金科股份	9,600	73,728.00	0.02
268	601838	成都银行	8,100	73,467.00	0.02
269	601828	美凯龙	6,100	69,113.00	0.02
270	601878	浙商证券	6,200	69,006.00	0.02
271	601881	中国银河	5,900	68,499.00	0.02
272	600233	圆通速递	5,400	68,310.00	0.02
273	600369	西南证券	12,858	66,733.02	0.02
274	601066	中信建投	2,100	63,840.00	0.02
275	000627	天茂集团	8,800	61,952.00	0.02
276	000671	阳光城	7,000	59,500.00	0.02
277	600663	陆家嘴	4,000	54,040.00	0.02
278	601298	青岛港	7,400	50,838.00	0.01
279	600816	安信信托	10,264	45,572.16	0.01
280	600733	北汽蓝谷	7,300	42,632.00	0.01
281	601319	中国人保	5,000	37,950.00	0.01
282	600390	五矿资本	2,880	23,788.80	0.01
283	002939	长城证券	1,600	22,176.00	0.01
284	002945	华林证券	1,300	19,422.00	0.01
285	601162	天风证券	2,500	18,400.00	0.01
286	601577	长沙银行	1,800	16,326.00	0.00

1.3.2 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	688111	金山办公	14,659	1,885,587.17	0.55
2	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.40
3	601077	渝农商行	147,778	925,090.28	0.27
4	688168	安博通	2,252	220,538.36	0.06
5	688138	清溢光电	10,066	139,816.74	0.04
6	002970	锐明技术	787	96,478.33	0.03
7	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
8	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01

1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.4.1 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	600276	恒瑞医药	29,555,023.55	11.07

2	601318	中国平安	25,935,815.92	9.71
3	002415	海康威视	17,756,468.90	6.65
4	600900	长江电力	17,366,441.99	6.50
5	002475	立讯精密	14,445,370.68	5.41
6	000725	京东方 A	13,760,975.00	5.15
7	601088	中国神华	13,526,744.11	5.07
8	600886	国投电力	13,502,203.20	5.06
9	600028	中国石化	12,185,550.93	4.56
10	600011	华能国际	12,032,525.04	4.51
11	601985	中国核电	11,652,420.00	4.36
12	300059	东方财富	11,462,896.90	4.29
13	601857	中国石油	10,803,026.00	4.05
14	000651	格力电器	10,558,162.00	3.95
15	600036	招商银行	10,501,886.00	3.93
16	000333	美的集团	9,846,634.25	3.69
17	600023	浙能电力	8,994,829.48	3.37
18	000858	五粮液	8,843,705.00	3.31
19	000661	长春高新	8,391,470.13	3.14
20	600519	贵州茅台	8,328,278.59	3.12
21	600674	川投能源	8,312,524.00	3.11
22	002230	科大讯飞	7,976,155.23	2.99
23	600887	伊利股份	7,936,469.98	2.97
24	600795	国电电力	7,688,595.00	2.88
25	000538	云南白药	7,579,573.57	2.84
26	601166	兴业银行	7,574,197.98	2.84
27	300015	爱尔眼科	7,300,070.32	2.73
28	601225	陕西煤业	7,134,548.01	2.67
29	600027	华电国际	7,097,178.00	2.66
30	600570	恒生电子	6,994,291.80	2.62
31	300498	温氏股份	6,890,087.00	2.58
32	600585	海螺水泥	6,388,601.00	2.39
33	300142	沃森生物	6,260,705.44	2.34
34	002044	美年健康	6,091,572.55	2.28
35	601988	中国银行	6,053,969.00	2.27
36	600436	片仔癀	5,912,604.70	2.21
37	600025	华能水电	5,484,675.00	2.05

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。

1.4.2 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	600276	恒瑞医药	30,282,084.59	11.34
2	601318	中国平安	26,542,206.54	9.94
3	000858	五粮液	21,929,733.08	8.21
4	600519	贵州茅台	21,768,352.41	8.15
5	600900	长江电力	20,776,859.00	7.78
6	600886	国投电力	19,841,736.05	7.43
7	600887	伊利股份	18,882,081.01	7.07
8	600011	华能国际	15,885,418.90	5.95
9	601985	中国核电	15,312,469.91	5.74
10	002415	海康威视	13,794,862.45	5.17
11	002475	立讯精密	13,161,480.15	4.93
12	300059	东方财富	13,055,267.64	4.89
13	600795	国电电力	12,148,736.00	4.55
14	600023	浙能电力	11,571,753.00	4.33
15	600674	川投能源	11,437,555.00	4.28
16	600036	招商银行	10,984,607.99	4.11
17	601088	中国神华	10,770,082.20	4.03
18	600028	中国石化	10,712,058.00	4.01
19	000651	格力电器	10,600,431.29	3.97
20	000333	美的集团	9,763,560.47	3.66
21	000725	京东方 A	9,541,887.00	3.57
22	600027	华电国际	9,347,269.00	3.50
23	601857	中国石油	9,160,063.75	3.43
24	000661	长春高新	8,921,135.00	3.34
25	603288	海天味业	8,849,279.42	3.31
26	002304	洋河股份	8,606,484.31	3.22
27	000538	云南白药	7,991,831.72	2.99
28	300015	爱尔眼科	7,914,461.14	2.96
29	601166	兴业银行	7,837,210.26	2.94
30	600025	华能水电	6,997,503.00	2.62
31	300142	沃森生物	6,667,500.72	2.50
32	000568	泸州老窖	6,601,512.00	2.47
33	601225	陕西煤业	6,535,595.00	2.45
34	002714	牧原股份	6,388,411.82	2.39
35	600436	片仔癀	6,143,243.00	2.30
36	601988	中国银行	6,103,345.00	2.29
37	002230	科大讯飞	5,991,853.37	2.24
38	300498	温氏股份	5,795,343.00	2.17

39	002044	美年健康	5,582,937.40	2.09
40	300003	乐普医疗	5,537,694.00	2.07
41	600030	中信证券	5,500,306.00	2.06
42	600570	恒生电子	5,424,167.95	2.03
43	002007	华兰生物	5,362,187.04	2.01

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。

1.4.3 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	768,456,580.34
卖出股票收入(成交)总额	791,724,532.94

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。

1.5 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。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 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。

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

1.11 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。

1.12 投资组合报告附注**1.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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。

1.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

1.12.3 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	47,207.06
2	应收证券清算款	22,080,565.21
3	应收股利	-
4	应收利息	3,945.46
5	应收申购款	36,682.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,168,399.86

1.12.4 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。

1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**1.12.5.1 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的情况。

1.12.5.2 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	688111	金山办公	1,885,587.17	0.55	新股流通受限
2	601916	浙商银行	1,370,948.70	0.40	新股流通受限
3	601077	渝农商行	925,090.28	0.27	新股流通受限
4	688168	安博通	220,538.36	0.06	新股流通受限
5	688138	清溢光电	139,816.74	0.04	新股流通受限

十二、基金的业绩

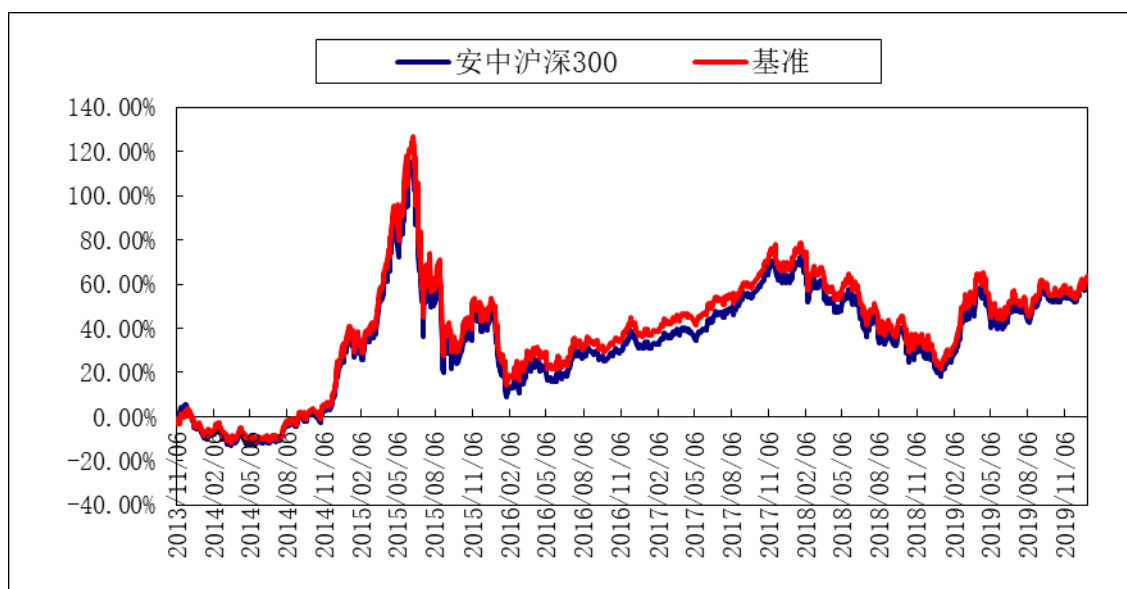
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段	净值增长率 (1)	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)
2013年11月6日(基金合同生效日)至2013年12月31日	-4.02%	1.01%	-3.14%	1.13%	-0.88%	-0.12%
2014年1月1日至2014年12月31日	37.53%	1.09%	39.84%	1.10%	-2.31%	-0.01%
2015年1月1日至2015年12月31日	8.48%	2.61%	9.52%	2.47%	-1.04%	0.14%
2016年1月1日至2016年12月31日	-8.39%	1.43%	-7.83%	1.39%	-0.56%	0.04%
2017年1月1日至2017年12月31日	23.44%	0.66%	22.27%	0.65%	1.17%	0.01%
2018年1月1日至2018年12月31日	-25.44%	1.27%	-25.27%	1.27%	-0.17%	0.00%
2019年1月1日至2019年12月31日	34.26%	1.17%	31.28%	1.19%	2.98%	-0.02%
2013年11月6日(基金合同生效日)至2019年12月31日	62.09%	1.49%	63.47%	1.44%	-1.38%	0.05%

(二) 自基金合同生效以来基金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图



十三、基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数使用许可费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

2、基金托管人的托管费

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

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 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。

3、标的指数使用许可费

基金的标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times \text{标的指数使用许可费年费率} \div \text{当年天数}$ ，根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数使用许可费年费率为 0.02%。

H 为每日应计提的基金标的指数使用许可费

E 为前一日基金资产净值

标的指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，于每年 1 月，4 月，7 月，10 月的前十个工作日内按照指定的账户路径将上季度标的指数使用许可费从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

标的指数使用许可费的收取下限为每季度人民币 50000 元，若计费期间不足一季度的，则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。若当季已计提的

标的指数使用许可费累计未达到该计费期间的收取下限，则在当季末一次性补提差额部分。

基金管理人可根据指数许可协议和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费率及计费方式，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介上刊登公告。

本基金转换为“汇添富沪深 300 安中动态策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金”后，本基金不再收取指数使用许可费，基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费、托管费。

上述“一、基金费用的种类中第 4—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

(一) 根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订，更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基

金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容。

- (二) 针对“基金管理人”章节：更新了基金管理人的相关信息。
- (三) 针对“基金托管人”章节：更新了基金托管人的相关信息。
- (四) 针对“基金的投资”章节：更新了基金的投资组合报告。
- (五) 针对“基金的业绩”章节：更新了基金的业绩。
- (六) 针对“其他应披露事项”章节：更新了本基金的相关公告。

汇添富基金管理股份有限公司

2020 年 4 月 14 日