

汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数 证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年01月01日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	68
7.1 期末基金资产组合情况	68
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	68
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	70
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	78
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	80
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	81
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	81
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	81

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	81
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	81
7.12 投资组合报告附注.....	81
§ 8 基金份额持有人信息	82
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	82
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	83
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	84
§ 9 开放式基金份额变动	84
§ 10 重大事件揭示	84
10.1 基金份额持有人大会决议.....	85
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.....	85
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
10.4 基金投资策略的改变.....	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
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.....	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
10.8 其他重大事件.....	90
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	92
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	92
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	95
§ 12 备查文件目录	96
12.1 备查文件目录.....	96
12.2 存放地点	96
12.3 查阅方式	96

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证国企一带一路ETF
场内简称	添富国企
基金主代码	515990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年11月06日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额(份)	1,959,350,160.00
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年01月15日

注：扩位简称为“国企一带一路ETF”

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	中证国企一带一路指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95599
传真	021-28932998	010-68121816
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031

法定代表人	李文	周慕冰
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日 - 2020年06月30日)
本期已实现收益	-123,130,950.47
本期利润	-398,570,360.64
加权平均基金份额本期利润	-0.1296
本期加权平均净值利润率	-13.77%
本期基金份额净值增长率	-11.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)
期末可供分配利润	-179,927,946.67
期末可供分配基金份额利润	-0.0918
期末基金资产净值	1,779,422,213.33
期末基金份额净值	0.9082
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-9.18%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.49%	0.84%	1.11%	0.88%	1.38%	-0.04%
过去三个月	0.39%	0.83%	-1.46%	0.86%	1.85%	-0.03%
过去六个月	-11.39%	1.43%	-13.68%	1.49%	2.29%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	-9.18%	1.28%	-8.32%	1.35%	-0.86%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

添富中证国企一带一路ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



注：1、本《基金合同》生效之日为2019年11月06日，截至本报告期末，基金成立未满一年。
 2、本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截止本报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金管理股份有限公司经中国证监会证监基金字【2005】5号文批准，于2005年2月3日正式成立。目前，公司注册资本为132,724,224元人民币。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII基金管理人、RQFII基金管理人及QFII基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

2020上半年，汇添富基金新成立11只公开募集证券投资基金，包括4只债券型基金、5只混合型基金、1只基金中基金、1只指数基金联接基金。截至2020年6月30日，公司共管理154只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理、指数与量化投资部副总监	2019年11月06日		14	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

					<p>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</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>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。</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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有34次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易，基金经理按内部规定履行了审批程序，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初新冠疫情的爆发和石油价格波动等因素对经济金融产生了较大影响。二季度以来，

随着统筹推进疫情防控和经济社会发展成效显著，生产需求持续改善，就业物价总体平稳，积极因素累积增多，国内经济继续呈现恢复态势，主要经济指标与一季度相比明显改善。但当前境外公共卫生事件仍在继续发展演变，外部风险挑战增多，国内经济恢复仍然面临压力。总体而言，推动经济持续复苏有较好的基础和条件，宏观政策效应亦在逐步显现。

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

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

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

报告期内，本基金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

本基金本报告期基金份额净值增长率为-11.39%。同期业绩比较基准收益率为-13.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

策工具，保持流动性合理充裕。”

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

作为稳增长的重要抓手，今年基建板块在政策、资金和项目支持力度上预计都将有较大幅度的增长。国企一带一路指数成份股多为参与一带一路建设的大型央企、国企，或将受益于基建托底的相关政策。同时，国企一带一路指数成份股股息率高、盈利稳定，当前估值水平处于历史低位，具备主题性的长期投资价值。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥

补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—汇添富基金管理股份有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，汇添富基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2020年06月30日	2019年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	49,455,284.69	661,149,895.07
结算备付金		8,347,779.23	32,662,191.03
存出保证金		658,483.97	156,665.12
交易性金融资产	6.4.7.2	1,723,322,248.31	3,018,022,567.43
其中: 股票投资		1,721,912,866.51	3,018,022,567.43
基金投资		-	-
债券投资		1,409,381.80	-
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		3,065,878.68	16,925,341.52
应收利息	6.4.7.5	24,792.59	152,575.89
应收股利		50,996.26	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,784,925,463.73	3,729,069,236.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,522,424.77	10,824,043.62
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		225,733.46	457,259.86
应付托管费		75,244.47	152,419.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,401,372.45	2,957,074.94
应交税费		11.09	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	278,464.16	231,167.79
负债合计		5,503,250.40	14,621,966.16
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,959,350,160.00	3,624,350,160.00
未分配利润	6.4.7.1 0	-179,927,946.67	90,097,109.90

所有者权益合计		1,779,422,213.33	3,714,447,269.90
负债和所有者权益总计		1,784,925,463.73	3,729,069,236.06

注：1、报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9082 元，基金份额总额 1,959,350,160.00 份。

2、本基金合同生效日为 2019 年 11 月 06 日，上年度实际可比期间为 2019 年 11 月 06 日至 2019 年 12 月 31 日，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
一、收入		-390,179,315.02
1. 利息收入		556,289.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	497,254.60
债券利息收入		777.47
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借收入		58,257.30
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-114,954,577.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-149,233,009.46
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.2	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	34,278,431.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-275,439,410.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-341,616.44
减：二、费用		8,391,045.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,169,714.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	723,238.08
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	4,952,339.33
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-

6. 税金及附加		2.78
7. 其他费用	6.4.7.21	545,751.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-398,570,360.64
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-398,570,360.64

注：本基金合同于2019年11月06日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,624,350,160.00	90,097,109.90	3,714,447,269.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-398,570,360.64	-398,570,360.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,665,000,000.00	128,545,304.07	-1,536,454,695.93
其中：1. 基金申购款	1,201,000,000.00	-101,113,764.22	1,099,886,235.78
2. 基金赎回款	-2,866,000,000.00	229,659,068.29	-2,636,340,931.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,959,350,160.00	-179,927,946.67	1,779,422,213.33

注：本基金合同于2019年11月06日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

财务报表由下列负责人签署：

张晖李骁雷青松

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

汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1344号《关于准予汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司于2019年9月11日至2019年10月31日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第60466941_B51号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年11月6日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币3,624,319,973.00元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币30,187.00元，以上实收基金（本息）合计为人民币3,624,350,160.00元，折合3,624,350,160.00份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为中证国企一带一路指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容

与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2020年06月30日的财务状况以及2020年01月01日至2020年06月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 股指/国债期货投资

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

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

(5) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大

事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约

定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配采用现金分红；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

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

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式

证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》

的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	49,455,284.69
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	49,455,284.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,853,107,517.83	1,721,912,866.51	-131,194,651.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,304,500.00	1,409,381.80
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	1,304,500.00	1,409,381.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,854,412,017.83	1,723,322,248.31	-131,089,769.52

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	7,811.29
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	3,380.85
应收债券利息	800.57
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	12,533.21
其他	266.67
合计	24,792.59

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	1,401,372.45
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,401,372.45

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付审计费	39,781.56
应付信息披露费	59,672.34
应付指数使用费	179,010.26
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
其他	-
合计	278,464.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,624,350,160.00	3,624,350,160.00
本期申购	1,201,000,000.00	1,201,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,866,000,000.00	-2,866,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,959,350,160.00	1,959,350,160.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-54,252,530.75	144,349,640.65	90,097,109.90
本期利润	-123,130,950.47	-275,439,410.17	-398,570,360.64
本期基金份额交易产生的变动数	48,057,851.66	80,487,452.41	128,545,304.07
其中：基金申购款	-48,322,600.99	-52,791,163.23	-101,113,764.22
基金赎回款	96,380,452.65	133,278,615.64	229,659,068.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-129,325,629.56	-50,602,317.11	-179,927,946.67

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	448,406.69
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	45,169.95
其他	3,677.96
合计	497,254.60

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,361,859.93
股票投资收益——赎回差价收入	-151,594,869.39

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-149,233,009.46

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	1,529,449,945.25
减：卖出股票成本总额	1,527,088,085.32
买卖股票差价收入	2,361,859.93

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
赎回基金份额对价总额	2,636,340,931.71
减：现金支付赎回款总额	580,810,887.71
减：赎回股票成本总额	2,207,124,913.39
赎回差价收入	-151,594,869.39

6.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	34,278,431.68
其中：证券出借权益补偿收入	444,713.26

基金投资产生的股利收益	-
合计	34,278,431.68

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	-275,439,410.17
——股票投资	-275,544,291.97
——债券投资	104,881.80
——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	-
——期货投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-275,439,410.17

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-341,616.44
其他	-
合计	-341,616.44

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	4,952,339.33
银行间市场交易费用	-
合计	4,952,339.33

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期

	2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	12,354.36
指数使用费	433,942.85
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
其他	-
合计	545,751.11

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	818,452,778.18	24.23

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期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 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	759,055.25	24.57	354,051.17	25.26

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,169,714.32
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	723,238.08

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	125,242,028.00	58,257.30	55,942,285.00	12,533.21

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

注：本基金本报告期末不存在与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	49,455,284.69	448,406.69

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688027	国盾量子	2020年06月30日	2020年07月09日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	
300843	胜蓝股份	2020年06月23日	2020年07月02日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	
688377	迪威尔	2020年06月	2020年07月	新股流通	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	

		29 日	08 日	受 限						
300846	首 都 在 线	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 01 日	新 股 流 通 受 限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	
688528	秦 川 物 联	2020 年 06 月 19 日	2021 年 01 月 04 日	新 股 流 通 受 限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	
688277	天 智 航	2020 年 06 月 24 日	2020 年 07 月 07 日	新 股 流 通 受 限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	
688568	中 科 星 图	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 08 日	新 股 流 通 受 限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	
300845	捷 安 高	2020 年 06 月	2020 年 07 月	新 股 流 通	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	

	科	月 24 日	月 03 日	通 受 限						
300847	中 船 汉 光	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 09 日	新 股 流 通 受 限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	
300840	酷 特 智 能	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 08 日	新 股 流 通 受 限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代	证	成交	出借	期末	数量(单位:	期末估值总额
------	-----	---	----	----	----	--------	--------

	码	券 名 称	时 间	到 期 日	估 值 单 价	张)	
2020062900000487	002415	海 康 威 视	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	30.35	262800	7,975,980.00
2020062200003852	600023	浙 能 电 力	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	3.51	127600	447,876.00
2020062900000212	000338	潍 柴 动 力	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	13.72	496500	6,811,980.00
2020062200002807	600808	马 钢 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	2.58	1000000	2,580,000.00
2020062200002794	600808	马 钢 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	2.58	350000	903,000.00
2020062200012186	601003	柳 钢 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.43	10000	44,300.00
2020062900001098	601717	郑 煤	2020 年 06	2020 年 07	5.89	22500	132,525.00

		机	月 29 日	月 13 日			
2020062200012162	601766	中 国 中 车	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.57	65000	362,050.00
2020062900001058	600528	中 铁 工 业	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	8.82	19400	171,108.00
2020062200012020	600026	中 远 海 能	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	6.46	10000	64,600.00
2020062900001107	600026	中 远 海 能	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	6.46	12600	81,396.00
2020062900001152	600026	中 远 海 能	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	6.46	23500	151,810.00
2020062200011726	600028	中 国 石 化	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	3.91	91000	355,810.00
2020062900000381	002092	中 泰 化	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	4.53	21200	96,036.00

		学	日	日			
2020062200003865	600023	浙 能 电 力	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	3.51	104800	367,848.00
2020062900000897	601866	中 远 海 发	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	1.84	40900	75,256.00
2020062900001236	601985	中 国 核 电	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	4.09	70100	286,709.00
2020062200000313	000039	中 集 集 团	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	7.23	53800	388,974.00
2020062900000181	000060	中 金 岭 南	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	3.72	55800	207,576.00
2020062900000975	600795	国 电 电 力	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	1.85	427000	789,950.00
2020062200012060	600808	马 钢 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	2.58	40900	105,522.00

2020063000008158	600808	马 钢 股 份	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 14 日	2.58	126900	327,402.00
2020062200003493	601003	柳 钢 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.43	10000	44,300.00
2020062900000809	601018	宁 波 港	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	3.57	150000	535,500.00
2020062200012082	601717	郑 煤 机	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.89	10000	58,900.00
2020062200003397	600335	国 机 汽 车	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.62	73500	339,570.00
2020062900001015	600377	宁 沪 高 速	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	9.81	34900	342,369.00
2020062200011818	600497	驰 宏 锌 锆	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	3.44	10000	34,400.00
2020062900000881	600028	中	2020	2020	3.91	63000	246,330.00

		国 石 化	年 06 月 29 日	年 07 月 13 日			
2020062900000932	600153	建 发 股 份	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	8.10	21000	170,100.00
2020062900000296	000898	鞍 钢 股 份	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	2.45	29500	72,275.00
2020062900000382	002110	三 钢 闽 光	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	6.66	10400	69,264.00
2020062200004201	600021	上 海 电 力	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	7.40	207500	1,535,500.00
2020062900001191	600021	上 海 电 力	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	7.40	16100	119,140.00
2020062200004405	601117	中 国 化 学	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.48	66700	365,516.00
2020062200003629	601717	郑 煤	2020 年 06	2020 年 07	5.89	32900	193,781.00

		机	月 22 日	月 06 日			
2020062200004332	600348	阳 泉 煤 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.22	59400	250,668.00
2020062200011878	600688	上 海 石 化	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	3.48	105000	365,400.00
2020062200001689	600188	充 州 煤 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	8.76	10000	87,600.00
2020062200011794	600010	包 钢 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	1.08	347000	374,760.00
2020062200002888	600011	华 能 国 际	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.22	87100	367,562.00
2020062200002292	601866	中 远 海 发	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	1.84	205600	378,304.00
2020062900000219	000528	柳 工	2020 年 06 月 29	2020 年 07 月 13	6.31	70700	446,117.00

			日	日			
2020062900000982	600970	中材国际	2020年06月29日	2020年07月13日	5.28	66200	349,536.00
2020062200012190	601117	中国化学	2020年06月22日	2020年07月06日	5.48	68000	372,640.00
2020062200003489	601800	中国交建	2020年06月22日	2020年07月06日	7.34	127000	932,180.00
2020062200011690	600332	白云山	2020年06月22日	2020年07月06日	32.33	13700	442,921.00
2020062200003420	600528	中铁工业	2020年06月22日	2020年07月06日	8.82	62900	554,778.00
2020062200003990	600026	中远海能	2020年06月22日	2020年07月06日	6.46	72500	468,350.00
2020062200012446	600068	葛洲坝	2020年06月22日	2020年07月06日	5.95	222700	1,325,065.00

2020062200000949	000825	太 钢 不 锈	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	3.32	120900	401,388.00
2020062200001020	000877	天 山 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	15.10	55900	844,090.00
2020063000000919	000977	浪 潮 信 息	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 14 日	39.18	10500	411,390.00
2020062200000351	000060	中 金 岭 南	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	3.72	55800	207,576.00
2020062900000269	000778	新 兴 铸 管	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	3.43	32600	111,818.00
2020062200002399	600737	中 粮 糖 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	7.78	60000	466,800.00
2020062900000936	600782	新 钢 股 份	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	4.08	42300	172,584.00
2020062200012142	600970	中	2020	2020	5.28	76000	401,280.00

		材 国 际	年 06 月 22 日	年 07 月 06 日			
2020062200011648	601390	中 国 中 铁	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.02	75900	381,018.00
2020062900000970	600704	物 产 中 大	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	4.21	34200	143,982.00
2020062200012026	600028	中 国 石 化	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	3.91	63000	246,330.00
2020062900000280	000830	鲁 西 化 工	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	7.46	45300	337,938.00
2020062900000291	000877	天 山 股 份	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	15.10	55400	836,540.00
2020062900000497	002449	国 星 光 电	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	11.60	28700	332,920.00
2020062200004741	601985	中 国	2020 年 06	2020 年 07	4.09	89900	367,691.00

		核 电	月 22 日	月 06 日			
2020062200000312	000039	中 集 集 团	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	7.23	31100	224,853.00
2020062200002436	600737	中 粮 糖 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	7.78	14600	113,588.00
2020062200011686	600348	阳 泉 煤 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.22	126000	531,720.00
2020062900000862	600050	中 国 联 通	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	4.84	57800	279,752.00
2020062200011734	600153	建 发 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	8.10	10000	81,000.00
2020062900000322	000977	浪 潮 信 息	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	39.18	15000	587,700.00
2020062900001165	600008	首 创 股	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	3.01	90000	270,900.00

		份	日	日			
2020062900000187	000039	中 集 集 团	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	7.23	22200	160,506.00
2020062200011898	600782	新 钢 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.08	10000	40,800.00
2020062200012066	600970	中 材 国 际	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.28	10000	52,800.00
2020062200003377	600970	中 材 国 际	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.28	51000	269,280.00
2020062200011650	601111	中 国 国 航	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	6.61	58400	386,024.00
2020062200011778	600348	阳 泉 煤 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.22	10000	42,200.00
2020062900000917	600497	驰 宏 锌 锆	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	3.44	59400	204,336.00

2020062900000844	600502	安徽建工	2020年06月29日	2020年07月13日	3.86	93200	359,752.00
2020062200012590	600688	上海石化	2020年06月22日	2020年07月06日	3.48	370800	1,290,384.00
2020062200002272	600050	中国联通	2020年06月22日	2020年07月06日	4.84	75600	365,904.00
2020062200011798	600068	葛洲坝	2020年06月22日	2020年07月06日	5.95	63000	374,850.00
2020062900000278	000830	鲁西化工	2020年06月29日	2020年07月13日	7.46	82300	613,958.00
2020062900000308	000932	华菱钢铁	2020年06月29日	2020年07月13日	3.77	22600	85,202.00
2020062200001092	000932	华菱钢铁	2020年06月22日	2020年07月06日	3.77	349900	1,319,123.00
2020062900000361	002051	中	2020	2020	7.28	46100	335,608.00

		工 国 际	年 06 月 29 日	年 07 月 13 日			
2020062200012072	601866	中 远 海 发	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	1.84	64300	118,312.00
2020062200002511	600782	新 钢 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.08	83300	339,864.00
2020062200002801	600808	马 钢 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	2.58	670200	1,729,116.00
2020062200003641	601717	郑 煤 机	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.89	51000	300,390.00
2020062200003414	600335	国 机 汽 车	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.62	200000	924,000.00
2020062900001134	600348	阳 泉 煤 业	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	4.22	14800	62,456.00
2020062200011684	600362	江 西	2020 年 06	2020 年 07	13.46	33700	453,602.00

		铜业	月22日	月06日			
2020062900000952	600497	驰宏锌锗	2020年06月29日	2020年07月13日	3.44	98600	339,184.00
2020062900001021	600528	中铁工业	2020年06月29日	2020年07月13日	8.82	10000	88,200.00
2020062200002785	600704	物产中大	2020年06月22日	2020年07月06日	4.21	140800	592,768.00
2020062900000282	000825	太钢不锈	2020年06月29日	2020年07月13日	3.32	60400	200,528.00
2020062200000974	000830	鲁西化工	2020年06月22日	2020年07月06日	7.46	40300	300,638.00
2020062200000979	000830	鲁西化工	2020年06月22日	2020年07月06日	7.46	40000	298,400.00
2020062900000366	002051	中国	2020年06月29日	2020年07月13日	7.28	66500	484,120.00

		际	日	日			
2020062900000383	002110	三 钢 闽 光	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	6.66	32500	216,450.00
2020062200001550	002110	三 钢 闽 光	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	6.66	66700	444,222.00
2020062200011722	600008	首 创 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	3.01	10000	30,100.00
2020062900000182	000039	中 集 集 团	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	7.23	45800	331,134.00
2020062200000344	000060	中 金 岭 南	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	3.72	54200	201,624.00
2020062900000216	000488	晨 鸣 纸 业	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	4.94	16500	81,510.00
2020062200003547	600761	安 徽 合 力	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	9.64	39500	380,780.00

2020062200003352	600970	中 材 国 际	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.28	67800	357,984.00
2020062200004381	601117	中 国 化 学	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.48	80800	442,784.00
合计	-	-	-	-	-	10,188,700	55,942,285.00

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注6.4.12中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本报告期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资、买入返售金融资产及部分应收申购款等。本基金的生息负债主要为卖出回购金融资产款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 0年 06 月 30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	49,455,284.69	-	-	-	-	-	49,455,284.69
结 算 备 付 金	8,347,779.23	-	-	-	-	-	8,347,779.23
存 出 保 证 金	658,483.97	-	-	-	-	-	658,483.97
交 易 性	-	-	1,409,381.80	-	-	1,721,912,866.51	1,723,322,248.31

金融资产							
应收股利	-	-	-	-	-	50,996.26	50,996.26
应收利息	-	-	-	-	-	24,792.59	24,792.59
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算	-	-	-	-	-	3,065,878.68	3,065,878.68

款							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	58,461,547.89	-	1,409,381.80	-	-	1,725,054,534.04	1,784,925,463.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人	-	-	-	-	-	225,733.46	225,733.46

报 酬							
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	75,244.47	75,244.47
应 付 证 券 清 算 款	-	-	-	-	-	3,522,424.77	3,522,424.77
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付 销 售 服 务	-	-	-	-	-	-	-

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,401,372.45	1,401,372.45
应交税费	-	-	-	-	-	11.09	11.09
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	278,464.16	278,464.16
负债总计	-	-	-	-	-	5,503,250.40	5,503,250.40
利率	58,461,547.89	-	1,409,381.80	-	-	1,719,551,283.64	1,779,422,213.33

敏 感 度 缺 口							
上 年 度 末 201 9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	661,149,895. 07	-	-	-	-	-	661,149,895.07
结 算 备 付 金	32,662,191.0 3	-	-	-	-	-	32,662,191.03
存 出 保	156,665.12	-	-	-	-	-	156,665.12

证 金							
交 易 性 金 融 资 产	-	-	-	-	-	3,018,022,567. 43	3,018,022,567. 43
应 收 股 利	-	-	-	-	-	-	-
应 收 利 息	-	-	-	-	-	152,575.89	152,575.89
应 收 申 购 款	-	-	-	-	-	-	-
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
应	-	-	-	-	-	16,925,341.52	16,925,341.52

收 证 券 清 算 款							
买 入 返 售 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
其 他 资 产	-	-	-	-	-	-	-
资 产 总 计	693,968,751. 22	-	-	-	-	3,035,100,484. 84	3,729,069,236. 06
负 债							
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	457,259.86	457,259.86
应付托管费	-	-	-	-	-	152,419.95	152,419.95
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,824,043.62	10,824,043.62
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应	-	-	-	-	-	-	-

付 销 售 服 务 费							
应 付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	2,957,074.94	2,957,074.94
应 交 税 费	-	-	-	-	-	-	-
应 付 利 息	-	-	-	-	-	-	-
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	231,167.79	231,167.79
负	-	-	-	-	-	14,621,966.16	14,621,966.16

债 总 计							
利 率 敏 感 度 缺 口	693,968,751. 22	-	-	-	-	3,020,478,518. 68	3,714,447,269. 90

注:上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

注:本基金所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
----	----------------------	-----------------------

	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,721,912,866.51	96.77	3,018,022,567.43	81.25
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,409,381.80	0.08	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,723,322,248.31	96.85	3,018,022,567.43	81.25

注：基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
		—	—

注：于2020年06月30日，本基金成立未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,721,912,866.51	96.47
	其中：股票	1,721,912,866.51	96.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,409,381.80	0.08
	其中：债券	1,409,381.80	0.08
	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	57,803,063.92	3.24
8	其他资产	3,800,151.50	0.21
9	合计	1,784,925,463.73	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 55,942,285.00 元，占期末基金资产净值比例 3.14%。

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	-	-
B	采矿业	207,582,051.12	11.67
C	制造业	822,094,395.26	46.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	155,001,770.00	8.71
E	建筑业	228,195,775.64	12.82
F	批发和零售业	60,791,077.00	3.42
G	交通运输、仓储和邮政业	165,847,998.00	9.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,306,041.50	3.33
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,793,277.20	1.17
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	1,719,612,385.72	96.64

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	1,862,670.70	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00

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	425,043.77	0.02
J	金融业	-	-
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	2,300,480.79	0.13

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600309	万华化	982,800	49,130,172.00	2.76

		学			
2	600019	宝钢股份	9,919,100	45,231,096.00	2.54
3	600887	伊利股份	1,294,376	40,293,924.88	2.26
4	600028	中国石化	10,085,000	39,432,350.00	2.22
5	002415	海康威视	1,290,500	39,166,675.00	2.20
6	600104	上汽集团	2,291,300	38,929,187.00	2.19
7	600188	兖州煤业	4,283,200	37,520,832.00	2.11
8	601088	中国神华	2,520,467	36,193,906.12	2.03
9	601668	中国建筑	7,540,900	35,970,093.00	2.02
10	000338	潍柴动力	2,438,300	33,453,476.00	1.88
11	600900	长江电力	1,757,900	33,294,626.00	1.87
12	600585	海螺水泥	623,700	32,999,967.00	1.85
13	000157	中联重科	4,883,900	31,403,477.00	1.76
14	600050	中国联通	6,039,000	29,228,760.00	1.64
15	601857	中国石油	6,919,300	28,991,867.00	1.63

16	002110	三钢闽光	4,343,900	28,930,374.00	1.63
17	601003	柳钢股份	6,267,200	27,763,696.00	1.56
18	600808	马钢股份	10,549,500	27,217,710.00	1.53
19	600298	安琪酵母	530,502	26,249,238.96	1.48
20	601186	中国铁建	2,962,600	24,826,588.00	1.40
21	601298	青岛港	4,305,400	24,454,672.00	1.37
22	600406	国电南瑞	1,200,934	24,318,913.50	1.37
23	601390	中国中铁	4,515,800	22,669,316.00	1.27
24	600782	新钢股份	5,526,386	22,547,654.88	1.27
25	601766	中国中车	4,008,800	22,329,016.00	1.25
26	000898	鞍钢股份	9,093,600	22,279,320.00	1.25
27	601800	中国交建	3,023,800	22,194,692.00	1.25
28	601111	中国国航	3,354,000	22,169,940.00	1.25
29	600153	建发股份	2,693,200	21,814,920.00	1.23
30	601899	紫金矿业	4,918,500	21,641,400.00	1.22

31	600018	上港集团	5,121,400	21,509,880.00	1.21
32	600886	国投电力	2,735,500	21,501,030.00	1.21
33	600377	宁沪高速	2,122,000	20,816,820.00	1.17
34	601238	广汽集团	2,305,400	20,748,600.00	1.17
35	601985	中国核电	4,964,400	20,304,396.00	1.14
36	600176	中国巨石	2,190,200	20,040,330.00	1.13
37	601669	中国电建	5,600,100	19,376,346.00	1.09
38	600023	浙能电力	5,288,900	18,564,039.00	1.04
39	600970	中材国际	3,497,300	18,465,744.00	1.04
40	600688	上海石化	5,204,500	18,111,660.00	1.02
41	000425	徐工机械	2,987,900	17,658,489.00	0.99
42	000778	新兴铸管	5,095,700	17,478,251.00	0.98
43	600011	华能国际	3,965,700	16,735,254.00	0.94
44	600170	上海建工	5,438,500	16,696,195.00	0.94
45	002202	金风科	1,664,968	16,599,730.96	0.93

		技			
46	601888	中国中 免	105,640	16,271,729.20	0.91
47	600704	物产中 大	3,769,500	15,869,595.00	0.89
48	600029	南方航 空	3,063,400	15,837,778.00	0.89
49	601618	中国中 冶	6,119,264	15,359,352.64	0.86
50	600021	上海电 力	2,043,800	15,124,120.00	0.85
51	000786	北新建 材	684,010	14,589,933.30	0.82
52	000039	中集集 团	2,009,600	14,529,408.00	0.82
53	600115	东方航 空	3,375,100	14,242,922.00	0.80
54	600068	葛洲坝	2,381,600	14,170,520.00	0.80
55	000830	鲁西化 工	1,845,600	13,768,176.00	0.77
56	600820	隧道股 份	2,411,900	13,627,235.00	0.77
57	600498	烽火通 信	457,000	13,211,870.00	0.74
58	601717	郑煤机	2,151,400	12,671,746.00	0.71
59	002092	中泰化 学	2,704,900	12,253,197.00	0.69
60	000877	天山股 份	792,200	11,962,220.00	0.67

61	600497	驰宏锌 锗	3,471,600	11,942,304.00	0.67
62	601117	中国化 学	2,118,400	11,608,832.00	0.65
63	600026	中远海 能	1,780,300	11,500,738.00	0.65
64	600027	华电国 际	3,318,500	11,349,270.00	0.64
65	000528	柳 工	1,797,700	11,343,487.00	0.64
66	601898	中煤能 源	2,963,300	11,260,540.00	0.63
67	600332	白云山	341,900	11,053,627.00	0.62
68	000060	中金岭 南	2,854,500	10,618,740.00	0.60
69	601727	上海电 气	2,090,600	10,536,624.00	0.59
70	601919	中远海 控	2,999,700	10,408,959.00	0.58
71	601018	宁波港	2,820,600	10,069,542.00	0.57
72	002051	中工国 际	1,347,900	9,812,712.00	0.55
73	601866	中远海 发	5,324,300	9,796,712.00	0.55
74	600795	国电电 力	5,201,500	9,622,775.00	0.54
75	600299	安迪苏	786,500	9,611,030.00	0.54
76	600348	阳泉煤 业	2,265,500	9,560,410.00	0.54

77	002091	江苏国泰	1,564,600	9,465,830.00	0.53
78	000932	华菱钢铁	2,404,000	9,063,080.00	0.51
79	600008	首创股份	2,826,000	8,506,260.00	0.48
80	600761	安徽合力	856,500	8,256,660.00	0.46
81	002080	中材科技	521,000	8,075,500.00	0.45
82	000825	太钢不锈	2,323,000	7,712,360.00	0.43
83	600710	苏美达	1,740,100	7,552,034.00	0.42
84	000488	晨鸣纸业	1,486,900	7,345,286.00	0.41
85	601808	中海油服	473,800	6,225,732.00	0.35
86	600271	航天信息	381,200	6,190,688.00	0.35
87	600335	国机汽车	1,317,900	6,088,698.00	0.34
88	002912	中新赛克	35,200	5,758,368.00	0.32
89	600010	包钢股份	5,260,600	5,681,448.00	0.32
90	601872	招商轮船	864,500	5,040,035.00	0.28
91	000977	浪潮信息	126,096	4,940,441.28	0.28

92	002449	国星光电	420,300	4,875,480.00	0.27
93	600528	中铁工业	546,100	4,816,602.00	0.27
94	002683	宏大爆破	137,900	4,812,710.00	0.27
95	600057	厦门象屿	825,100	4,521,548.00	0.25
96	601989	中国重工	1,017,500	4,070,000.00	0.23
97	600362	江西铜业	264,500	3,560,170.00	0.20
98	600737	中粮糖业	359,200	2,794,576.00	0.16
99	600502	安徽建工	466,300	1,799,918.00	0.10
100	002061	浙江交科	312,400	1,618,232.00	0.09

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	688520	神州细胞	12,351	932,747.52	0.05
2	688518	联赢激光	14,111	389,886.93	0.02
3	688555	泽达易盛	3,004	234,312.00	0.01
4	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01

5	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
6	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
7	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
8	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
9	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
10	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
11	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
12	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
13	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
14	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
15	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
16	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
17	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
18	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

-

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	600188	兖州煤业	72,984,474.69	1.96
2	601857	中国石油	65,200,088.89	1.76
3	000898	鞍钢股份	63,451,966.83	1.71
4	000830	鲁西化工	57,588,442.32	1.55
5	002415	海康威视	52,506,294.33	1.41
6	601238	广汽集团	50,621,044.02	1.36
7	002092	中泰化学	42,608,462.55	1.15
8	600688	上海石化	39,008,357.93	1.05
9	002110	三钢闽光	38,279,635.60	1.03
10	600498	烽火通信	36,692,462.27	0.99
11	002091	江苏国泰	36,556,061.42	0.98
12	600309	万华化学	34,798,620.25	0.94

13	600011	华能国际	33,523,128.95	0.90
14	000338	潍柴动力	30,572,720.05	0.82
15	600028	中国石化	30,246,041.13	0.81
16	000825	太钢不锈	27,938,255.55	0.75
17	000488	晨鸣纸业	27,438,432.89	0.74
18	600497	驰宏锌锗	26,142,520.65	0.70
19	000157	中联重科	25,698,506.79	0.69
20	600704	物产中大	25,465,920.59	0.69

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	601618	中国中冶	121,942,128.90	3.28
2	000338	潍柴动力	115,829,017.10	3.12
3	601088	中国神华	112,338,396.21	3.02
4	601117	中国化学	79,265,851.35	2.13
5	002415	海康威视	77,253,186.39	2.08
6	000157	中联重科	70,850,954.10	1.91
7	600585	海螺水泥	70,343,836.21	1.89
8	601800	中国交建	68,779,721.45	1.85
9	002110	三钢闽光	50,942,549.76	1.37
10	601766	中国中车	45,897,994.99	1.24
11	000786	北新建材	45,373,826.22	1.22
12	002202	金风科技	34,388,966.85	0.93
13	600104	上汽集团	32,917,565.07	0.89
14	000830	鲁西化工	32,735,609.25	0.88
15	000977	浪潮信息	32,585,407.13	0.88
16	000898	鞍钢股份	31,634,162.27	0.85
17	600406	国电南瑞	26,175,668.36	0.70

18	000425	徐工机械	26,147,451.57	0.70
19	002051	中工国际	24,953,389.39	0.67
20	000778	新兴铸管	24,021,206.01	0.65

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	1,857,308,873.76
卖出股票收入（成交）总额	1,529,449,945.25

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,409,381.80	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,409,381.80	0.08

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128107	交科转	13,045	1,409,381.80	0.08

		债			
--	--	---	--	--	--

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、交易所立案调查,或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	658,483.97
2	应收证券清算款	3,065,878.68
3	应收股利	50,996.26
4	应收利息	24,792.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	3,800,151.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688568	中科星图	178,634.20	0.01	新股流通受限
2	688377	迪威尔	129,619.48	0.01	新股流通受限

§ 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		中国农业银行股份有限公司—汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总	持有份额	占总	持有份额	占总

			份额 比例 (%)		份额 比例 (%)		份额 比例 (%)
557	3,517,684. 31	1,957,357,795 .00	99.9 0	1,992,365. 00	0.10	1,093,000,000 .00	55.7 8

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“中国农业银行股份有限公司—汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例 (%)
1	中国国有企业结构调整基金股份有限公司	371,313,387.00	18.95
2	中国冶金科工集团有限公司	201,666,740.00	10.29
3	中国交通建设集团有限公司	126,000,036.00	6.43
4	中车金证投资有限公司	93,671,320.00	4.78
5	安邦人寿保险股份有限公司-保守型投资组合	70,740,000.00	3.61
6	中国国际金融股份有限公司	807,312.00	0.04
7	丁爱玉	130,800.00	0.01
8	西安天宇新材料有限责任公司	119,900.00	0.01

9	李翔业	65,200.00	0.00
10	耿菊芳	63,400.00	0.00
11	中国农业银行股份有限公司—汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,093,000,000.00	55.78

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年11月06日）基金份额总额	3,624,350,160.00
本报告期期初基金份额总额	3,624,350,160.00
本报告期基金总申购份额	1,201,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,866,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,959,350,160.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2019年11月06日）起至本报告期末，为本基金进行审计。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内托管人及其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 (%)	

国泰君安	2	863,127,940.33	25.55	786,570.66	25.47	
东方证券	3	818,452,778.18	24.23	759,055.25	24.57	
中金公司	2	249,514,021.39	7.39	231,536.73	7.50	
中信证券	1	228,258,696.81	6.76	212,579.27	6.88	
长江证券	2	207,049,828.56	6.13	192,399.39	6.23	
民生证券	2	206,696,061.91	6.12	191,391.73	6.20	
华创证券	1	200,085,205.49	5.92	182,337.00	5.90	
东方财富	2	144,317,311.92	4.27	105,538.22	3.42	
方正证券	2	143,682,856.25	4.25	133,811.15	4.33	
华泰证券	2	121,191,634.74	3.59	112,864.56	3.65	
兴业证券	2	86,524,269.58	2.56	78,952.04	2.56	
招商证券	2	81,891,663.39	2.42	76,263.88	2.47	
海通证券	2	25,262,443.51	0.75	23,526.48	0.76	
中泰证券	1	1,881,422.16	0.06	1,752.16	0.06	
中信	2	166,250.93	0.00	154.52	0.01	

建投 证券						
渤海 证券	2	-	-	-	-	
财通 证券	1	-	-	-	-	
长城 证券	1	-	-	-	-	
东海 证券	2	-	-	-	-	
国金 证券	1	-	-	-	-	
国联 证券	1	-	-	-	-	
恒泰 证券	2	-	-	-	-	

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商 名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交 金额	占当期债 券成交总 额的比例 (%)	成交 金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例 (%)	成交 金额	占当期权 证成交总 额的比例 (%)	成交 金额	占当期基 金成交总 额的比例 (%)
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-

东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

渤海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

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

助及时催缴。

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中证报, 上交所, 公司网站	2020年01月10日
2	汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购赎回业务的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2020年01月10日
3	关于汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中证报, 上交所, 公司网站	2020年01月10日
4	关于汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中证报, 上交所, 公司网站	2020年01月15日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富上海证券交易所跨市场ETF修改申购赎回业务规则并更新招募说明书的公	中证报, 上交所, 公司网站	2020年01月18日

	告		
6	汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020年1月20日更新）	中证报, 上交所, 公司网站	2020年01月20日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金暂停申购、赎回等业务的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020年01月31日
8	汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020年2月17日更新）	中证报, 上交所, 公司网站	2020年02月17日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分沪市上市基金增加扩位证券简称的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2020年03月14日
10	汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2020年3月19日更新）	中证报, 上交所, 公司网站	2020年03月19日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所	2020年04月01日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于根据《公开	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公	2020年04月14日

	募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议并更新招募说明书	司网站, 深交所, 证券日报	
13	汇添富基金旗下 145 只基金 2020 年 1 季度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 04 月 21 日
14	汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2020 年 5 月 7 日更新)	中证报, 上交所, 公司网站	2020 年 05 月 07 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		达 到 或 者 超 过 20% 的 时 间 区 间					
机 构	1	202 0年 1月 1日 至 202 0年 5月 20 日	2,686,582,465 .00	-	2,686,582,465 .00	-	-
	2	202 0年 5月 22 日 至 202	371,313,387.0 0	-	-	371,313,387.0 0	18.9 5

		0年 6月 1日					
中国 农业 银行 股份 有限 公司 一 汇 添 富 中 证 国 企 一 带 一 路 交 易	1	202 0年 5月 15 日 至 202 0年 6月 30 日	-	1,570,000,000 .00	477,000,000.0 0	1,093,000,000 .00	55.7 8

型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 联 接 基 金							
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险</p> <p>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。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险</p> <p>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。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险</p> <p>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。</p>							

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中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2020年08月28日