

# 中证上海国企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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 08 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	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 .....	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 .....	13
§ 5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	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 .....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
§ 7 投资组合报告 .....	66
7.1 期末基金资产组合情况 .....	67
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	67
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 .....	69
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
7.12 投资组合报告附注.....	75
§ 8 基金份额持有人信息 .....	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	76
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
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.....	77
§ 9 开放式基金份额变动 .....	77
§ 10 重大事件揭示 .....	78
10.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
10.4 基金投资策略的改变.....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
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.....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
10.8 其他重大事件.....	84
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
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.....	86
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
§ 12 备查文件目录 .....	87
12.1 备查文件目录.....	87
12.2 存放地点 .....	87
12.3 查阅方式 .....	87

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证上海国企 ETF
场内简称	上海国企
基金主代码	510810
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2016 年 07 月 28 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（份）	12,011,093,710.00
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	2016 年 08 月 29 日

注：扩位证券简称为上海国企 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，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数，即中证上海国企指数。
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，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。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	《证券日报》
----------------	--------

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	-115,037,487.31
本期利润	-1,216,740,570.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0984
本期加权平均净值利润率	-11.81%
本期基金份额净值增长率	-10.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,968,764,960.09
期末可供分配基金份额利润	-0.1639
期末基金资产净值	10,042,328,749.91
期末基金份额净值	0.8361
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	-13.90%

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

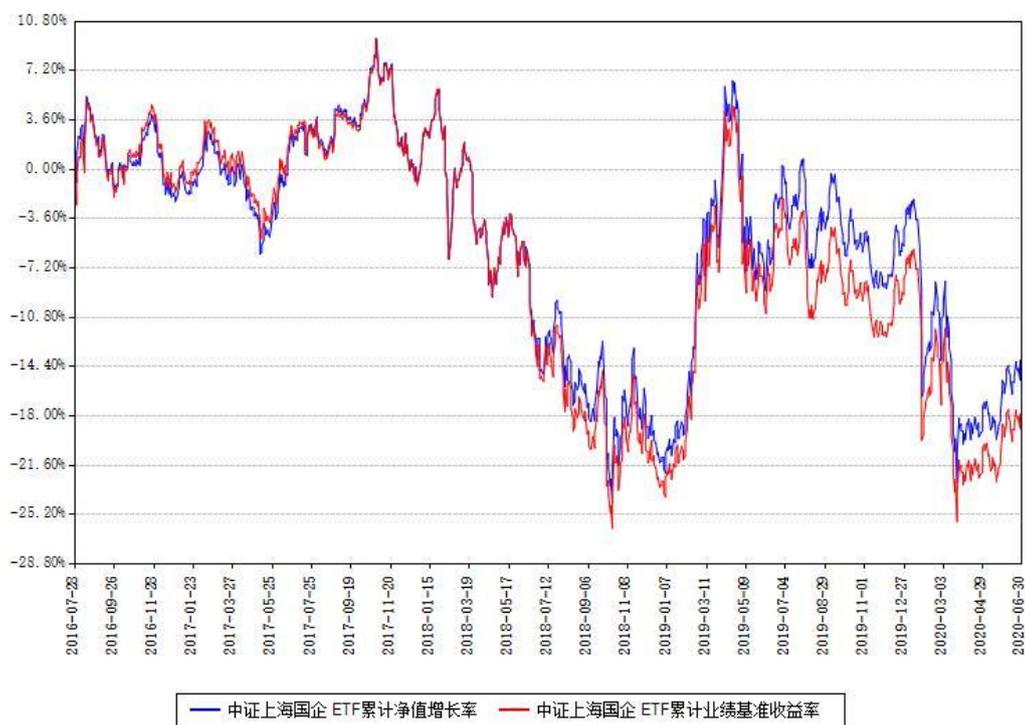
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.76%	0.95%	3.96%	0.95%	0.80%	0.00%

个月						
过去三个月	6.44%	0.90%	5.53%	0.90%	0.91%	0.00%
过去六个月	-10.33%	1.50%	-11.07%	1.51%	0.74%	-0.01%
过去一年	-12.05%	1.22%	-14.03%	1.23%	1.98%	-0.01%
过去三年	-15.83%	1.24%	-20.02%	1.25%	4.19%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	-13.90%	1.13%	-17.82%	1.14%	3.92%	-0.01%

### 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

中证上海国企 ETF 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016 年 07 月 28 日）起 6 个月，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	2016 年 07 月 28 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

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

					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。
--	--	--	--	--	---

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

政策方面,按照《政府工作报告》要求,在疫情防控常态化前提下,围绕做好“六稳”

工作、落实“六保”任务，狠抓各项政策举措落实落地，着力稳企业保就业，努力实现全年经济社会发展目标。今年为企业新增减负预计超过 2.5 万亿元，发行 1 万亿元抗疫特别国债，新增 1 万亿元财政赤字规模，货币信贷支持力度加大，这些政策预计将继续支持后期经济恢复。

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

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

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。组合上，持有标的指数成分股的仓位报告期内基本保持在 95%以上，基本实现了基金合同规定的投资目的。

#### 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-10.33%。同期业绩比较基准收益率为-11.07%。

#### 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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定: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

本报告期内,本基金托管人在对中证上海国企交易型开放式指数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,中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在中证上海国企交易型开放式指数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,中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

## 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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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：中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	104,223,283.25	65,097,766.02
结算备付金		104,562.54	473,567.14
存出保证金		16,440.22	940,213.15
交易性金融资产	6.4.7.2	9,955,873,506.85	12,006,679,713.02
其中：股票投资		9,955,873,506.85	12,006,679,713.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		85,087.69	765,340.09
应收利息	6.4.7.5	65,588.42	13,780.99
应收股利		272,768.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,060,641,236.97	12,073,970,380.41
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
<b>负 债:</b>			
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		11,892,164.72	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,657,749.32	4,613,479.27
应付托管费		812,833.17	1,025,217.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,122,084.36	872,378.18
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	827,655.49	1,522,721.14
负债合计		18,312,487.06	8,033,796.19
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	12,011,093,710.00	12,940,093,710.00
未分配利润	6.4.7.1 0	-1,968,764,960.09	-874,157,125.78
所有者权益合计		10,042,328,749.91	12,065,936,584.22
负债和所有者权益总计		10,060,641,236.97	12,073,970,380.41

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8361 元，基金份额总额 12,011,093,710.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中证上海国企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	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年06月30日
<b>一、收入</b>		<b>-1,183,838,429.86</b>	<b>2,037,138,131.47</b>
1. 利息收入		1,134,605.83	201,037.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	176,722.45	200,680.25
债券利息收入		-	356.89

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		957,883.38	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-82,976,028.76	24,089,514.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-185,497,044.15	-50,339,690.34
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	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	102,521,015.39	74,429,205.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-1,101,703,083.02	2,012,598,561.56
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	-293,923.91	249,017.85
<b>减：二、费用</b>		<b>32,902,140.47</b>	<b>31,290,721.62</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,111,264.24	20,358,618.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,135,836.50	4,524,137.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	3,014,837.98	4,890,063.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	1.18
7. 其他费用	6.4.7.21	1,640,201.75	1,517,901.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,216,740,570.33</b>	<b>2,005,847,409.85</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,216,740,570.33</b>	<b>2,005,847,409.85</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证上海国企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）	12,940,093,710.00	-874,157,125.78	12,065,936,584.22

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,216,740,570.33	-1,216,740,570.33
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）	-929,000,000.00	122,132,736.02	-806,867,263.98
其中：1. 基金申购款	397,000,000.00	-62,366,633.74	334,633,366.26
2. 基金赎回款	-1,326,000,000.00	184,499,369.76	-1,141,500,630.24
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）	12,011,093,710.00	-1,968,764,960.09	10,042,328,749.91
项目	上年度可比期间		
	2019年01月01日至2019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）	10,505,091,004.00	-2,446,270,850.29	8,058,820,153.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,005,847,409.85	2,005,847,409.85
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）	-925,000,000.00	-31,639,042.70	-956,639,042.70
其中：1. 基金申购款	613,000,000.00	-35,880,764.40	577,119,235.60
2. 基金赎回款	-1,538,000,000.00	4,241,721.70	-1,533,758,278.30
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）	9,580,091,004.00	-472,062,483.14	9,108,028,520.86

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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
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

中证上海国企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[2016]1265 号文《关于准予中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，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募集，基金合同于 2016 年 7 月 28 日正式生效，首次设立募集规模为 15,220,091,004.00 份基金份额。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

2019 年 7 月 8 日，中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，会议审议通过了《关于中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并有关事项的议案》，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2019 年 8 月 28 日起，《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》失效，在份额转换基准日登记在册的上海改革发展 ETF 的基金份额持有人成为上海国企 ETF 的基金份额持有人，并成为《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的当事人。

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、中小企业私募债券、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、权证、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金业绩比较基准为：中证上海国企指数。

### 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 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 2020年06月30日
活期存款	104,223,283.25
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	104,223,283.25

#### 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	11,448,491,197.09	9,955,873,506.85	-1,492,617,690.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	11,448,491,197.09	9,955,873,506.85	-1,492,617,690.24

#### 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	5,341.75
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	42.39
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	-
应收出借证券利息	60,197.62
其他	6.66
合计	65,588.42

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	1,122,084.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,122,084.36

#### 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	728,201.59
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
其他	-
合计	827,655.49

#### 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	12,940,093,710.00	12,940,093,710.00
本期申购	397,000,000.00	397,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,326,000,000.00	-1,326,000,000.00
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	12,011,093,710.00	12,011,093,710.00
-----	-------------------	-------------------

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	8,124,036.71	-882,281,162.49	-874,157,125.78
本期利润	-115,037,487.31	-1,101,703,083.02	-1,216,740,570.33
本期基金份额交易产生的变动数	5,209,881.19	116,922,854.83	122,132,736.02
其中：基金申购款	-1,797,382.35	-60,569,251.39	-62,366,633.74
基金赎回款	7,007,263.54	177,492,106.22	184,499,369.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-101,703,569.41	-1,867,061,390.68	-1,968,764,960.09

#### 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	163,641.17
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	10,318.96
其他	2,762.32
合计	176,722.45

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	-56,557,747.71
股票投资收益——赎回差价收入	-128,939,296.44
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	-185,497,044.15

##### 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	960,791,589.85
减：卖出股票成本总额	1,017,349,337.56
买卖股票差价收入	-56,557,747.71

#### 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	1,141,500,630.24
减：现金支付赎回款总额	-7,447,540.76
减：赎回股票成本总额	1,277,887,467.44
赎回差价收入	-128,939,296.44

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
出借证券现金清偿总额	-
减：出借证券成本总额	-
减：应收证券出借利息	-
证券出借差价收入	-

#### 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	102,521,015.39
其中：证券出借权益补偿收入	1,947,251.37
基金投资产生的股利收益	-
合计	102,521,015.39

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	-1,101,703,083.02
——股票投资	-1,101,703,083.02
——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	-
——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	-1,101,703,083.02

#### 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	-293,923.91
其他	-
合计	-293,923.91

#### 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	3,014,837.98
银行间市场交易费用	-
合计	3,014,837.98

### 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	59,398.82
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	270.50
指数使用费	1,540,750.87
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	1,640,201.75

### 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
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东

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		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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	1,929,599,287.29	97.60	-	-

##### 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 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	1,797,031.49	97.60	1,115,935.53	99.45
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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	-	-	-	-
------	---	---	---	---

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	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年06月30日	2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,111,264.24	20,358,618.64
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.45%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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，经基金托管人复核后于次月首日起2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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年06月30日	2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,135,836.50	4,524,137.48

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 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 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	1,568,204,659.00	957,883.38	226,618,415.00	60,197.62
上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 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
-	-	-	-	-

##### 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至2020年 06月30日	2019年01月01日至2019年 06月30日
基金合同生效日2016年07月28日 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,297,348.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,297,348.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总 份额比例(%)	0.08	-

注：基金管理人持有的上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金份额因基金合并而转换为本基金的份额，转换份额数量为9,297,348.00。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
上海上报资产管理 有限公司	18,594,696.00	0.15	18,594,696.00	0.14

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	104,223,283.25	163,641.17	110,485,001.70	180,328.37

#### 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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（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
688181	八亿时空	2019 年 12 月 27 日	2020 年 07 月 06 日	新股流通受限	43.98	61.09	4,306	189,377.88	263,053.54	
688568	中	2020	2021	新	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	

	科 星 图	年 06 月 30 日	年 01 月 08 日	股 流 通 受 限						
688528	秦 川 物 联	2020 年 06 月 19 日	2020 年 07 月 01 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	
688178	万 德 斯	2020 年 01 月 06 日	2020 年 07 月 14 日	新 股 流 通 受 限	25.20	39.90	3,704	93,340.80	147,789.60	
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	

688377	迪 威 尔	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 08 日	新 股 流 通 受 限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	
688365	光 云 科 技	2020 年 04 月 22 日	2020 年 10 月 29 日	新 股 流 通 受 限	10.80	43.22	8,249	89,089.20	356,521.78	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代 码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	可 流 通 日	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 (单 位:张)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
					-	-	-	-	-	

#### 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	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额
2020062900001222	600692	亚通股份	2020年06月29日	2020年07月13日	7.07	49600	350,672.00
2020062200003259	600820	隧道股份	2020年06月22日	2020年07月06日	5.65	10000	56,500.00
2020062200003271	600820	隧道股份	2020年06月22日	2020年07月06日	5.65	62100	350,865.00
2020063000008816	600820	隧道股份	2020年06月30日	2020年07月14日	5.65	196800	1,111,920.00
2020062200011612	600825	新华传媒	2020年06月22日	2020年07月06日	6.21	173000	1,074,330.00
2020062900000913	600826	兰生	2020年06月	2020年07月	10.46	33100	346,226.00

		股 份	月 29 日	月 13 日			
2020062900002978	600073	上 海 梅 林	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	9.49	27000	256,230.00
2020062200011858	600597	光 明 乳 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.86	10000	148,600.00
2020062200012042	600597	光 明 乳 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.86	10000	148,600.00
2020062200011970	600602	云 赛 智 联	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	7.26	419900	3,048,474.00
2020062200012584	600604	市 北 高 新	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	9.41	48900	460,149.00
2020062200002998	600621	华 鑫 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	19.30	152700	2,947,110.00
2020062200002074	600649	城 投 控	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.94	67900	403,326.00

		股	日	日			
2020062200012048	600649	城 投 控 股	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	5.94	17300	102,762.00
2020062900001276	600675	中 华 企 业	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	4.07	22500	91,575.00
2020062900003160	600648	外 高 桥	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	14.14	15400	217,756.00
2020062200003216	600000	浦 发 银 行	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	10.58	35100	371,358.00
2020063000003360	600604	市 北 高 新	2020 年06 月30 日	2020 年07 月14 日	9.41	156500	1,472,665.00
2020061700012345	600612	老 凤 祥	2020 年06 月17 日	2020 年07 月01 日	48.19	79000	3,807,010.00
2020062200012586	600621	华 鑫 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	19.30	153600	2,964,480.00

2020062200012512	600621	华鑫股份	2020年06月22日	2020年07月06日	19.30	100000	1,930,000.00
2020062200004659	600623	华谊集团	2020年06月22日	2020年07月06日	5.16	219400	1,132,104.00
2020062900001197	600835	上海机电	2020年06月29日	2020年07月13日	16.93	20200	341,986.00
2020062200012002	600895	张江高科	2020年06月22日	2020年07月06日	20.37	240400	4,896,948.00
2020062200011998	600895	张江高科	2020年06月22日	2020年07月06日	20.37	308500	6,284,145.00
2020063000008194	600895	张江高科	2020年06月30日	2020年07月14日	20.37	74600	1,519,602.00
2020062200001909	601727	上海电气	2020年06月22日	2020年07月06日	5.04	71700	361,368.00
2020062200011974	600637	东	2020	2020	9.65	250000	2,412,500.00

		方 明 珠	年 06 月 22 日	年 07 月 06 日			
2020062900001204	600642	申 能 股 份	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.91	60400	356,964.00
2020062200012052	600648	外 高 桥	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.14	10000	141,400.00
2020062200011868	600648	外 高 桥	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.14	27000	381,780.00
2020062900000918	600649	城 投 控 股	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.94	60700	360,558.00
2020062200011554	600675	中 华 企 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.07	10000	40,700.00
2020062900001314	600675	中 华 企 业	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	4.07	83300	339,031.00
2020062200012050	600692	亚 通	2020 年 06	2020 年 07	7.07	39800	281,386.00

		股 份	月 22 日	月 06 日			
2020062900003214	600820	隧 道 股 份	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.65	135800	767,270.00
2020062900000968	600000	浦 发 银 行	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	10.58	27400	289,892.00
2020062200011536	600597	光 明 乳 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.86	10000	148,600.00
2020062200011966	600597	光 明 乳 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.86	285000	4,235,100.00
2020062200011566	600827	百 联 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.45	112000	1,618,400.00
2020062900001070	600838	上 海 九 百	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	7.99	131800	1,053,082.00
2020062900000863	600848	上 海 临	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	21.47	70800	1,520,076.00

		港	日	日			
2020063000002703	600895	张江高科	2020年06月30日	2020年07月14日	20.37	83900	1,709,043.00
2020062900001243	600639	浦东金桥	2020年06月29日	2020年07月13日	15.98	12000	191,760.00
2020062200011602	600642	申能股份	2020年06月22日	2020年07月06日	5.91	10000	59,100.00
2020062200004379	600642	申能股份	2020年06月22日	2020年07月06日	5.91	68900	407,199.00
2020062200011862	600642	申能股份	2020年06月22日	2020年07月06日	5.91	10000	59,100.00
2020062200011550	600648	外高桥	2020年06月22日	2020年07月06日	14.14	10000	141,400.00
2020062200011604	600649	城投控股	2020年06月22日	2020年07月06日	5.94	10000	59,400.00

2020063000002544	600662	强 生 控 股	2020 年06 月30 日	2020 年07 月14 日	7.98	800000	6,384,000.00
2020062200011664	600675	中 华 企 业	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	4.07	89400	363,858.00
2020063000002571	600676	交 运 股 份	2020 年06 月30 日	2020 年07 月14 日	5.56	508600	2,827,816.00
2020062200011606	600692	亚 通 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	7.07	10000	70,700.00
2020062900003188	600754	锦 江 酒 店	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	27.75	13200	366,300.00
2020062200011564	600822	上 海 物 贸	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	9.92	10000	99,200.00
2020062900002600	600822	上 海 物 贸	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	9.92	35300	350,176.00
2020062200011614	600826	兰	2020	2020	10.46	10000	104,600.00

		生 股 份	年 06 月 22 日	年 07 月 06 日			
2020062200011810	600170	上 海 建 工	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	3.07	122900	377,303.00
2020062900001088	600170	上 海 建 工	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	3.07	93100	285,817.00
2020062200005160	600278	东 方 创 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	9.27	108000	1,001,160.00
2020061700012349	600597	光 明 乳 业	2020 年 06 月 17 日	2020 年 07 月 01 日	14.86	278000	4,131,080.00
2020062200011538	600604	市 北 高 新	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	9.41	125500	1,180,955.00
2020062200011972	600612	老 凤 祥	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	48.19	16900	814,411.00
2020062200011908	600827	百 联	2020 年 06 月 06 日	2020 年 07 月 06 日	14.45	48900	706,605.00

		股 份	月 22 日	月 06 日			
2020062200011618	600895	张 江 高 科	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	20.37	332800	6,779,136.00
2020062200012554	600895	张 江 高 科	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	20.37	63000	1,283,310.00
2020062200012558	600895	张 江 高 科	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	20.37	16200	329,994.00
2020062900000847	601727	上 海 电 气	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.04	70000	352,800.00
2020062200004464	600639	浦 东 金 桥	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	15.98	17600	281,248.00
2020062200011978	600649	城 投 控 股	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.94	383100	2,275,614.00
2020062900003194	600748	上 实 发	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.11	38000	194,180.00

		展	日	日			
2020062200012046	600278	东 方 创 业	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	9.27	29900	277,173.00
2020062200011600	600604	市 北 高 新	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	9.41	48900	460,149.00
2020062200003012	600621	华 鑫 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	19.30	30000	579,000.00
2020062200002973	600621	华 鑫 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	19.30	258000	4,979,400.00
2020062200012588	600623	华 谊 集 团	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	5.16	350000	1,806,000.00
2020062200011994	600827	百 联 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	14.45	459200	6,635,440.00
2020063000008636	600827	百 联 股 份	2020 年06 月30 日	2020 年07 月14 日	14.45	79200	1,144,440.00

2020063000002399	600827	百 联 股 份	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 14 日	14.45	380000	5,491,000.00
2020062200011620	600895	张 江 高 科	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	20.37	16200	329,994.00
2020062200001953	600827	百 联 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.45	71200	1,028,840.00
2020063000002416	600827	百 联 股 份	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 14 日	14.45	1000000	14,450,000.00
2020062200004676	600835	上 海 机 电	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	16.93	78900	1,335,777.00
2020062200011658	600835	上 海 机 电	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	16.93	29800	504,514.00
2020062200011568	600835	上 海 机 电	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	16.93	10000	169,300.00
2020062900003204	600835	上	2020	2020	16.93	13300	225,169.00

		海 机 电	年 06 月 29 日	年 07 月 13 日			
2020062200011570	600838	上 海 九 百	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	7.99	28400	226,916.00
2020062900000962	603881	数 据 港	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	108.07	27300	2,950,311.00
2020062200004327	600642	申 能 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.91	27200	160,752.00
2020062200002660	600648	外 高 桥	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.14	19200	271,488.00
2020062900002592	600648	外 高 桥	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	14.14	115700	1,635,998.00
2020062200012724	600692	亚 通 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	7.07	30000	212,100.00
2020062200011988	600754	锦 江	2020 年 06	2020 年 07	27.75	176300	4,892,325.00

		酒 店	月 22 日	月 06 日			
2020062900001033	600820	隧 道 股 份	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.65	309100	1,746,415.00
2020062900001006	600820	隧 道 股 份	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.65	133500	754,275.00
2020062900001333	600825	新 华 传 媒	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	6.21	51400	319,194.00
2020062200011964	600009	上 海 机 场	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	72.07	51000	3,675,570.00
2020063000008336	600073	上 海 梅 林	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 14 日	9.49	320000	3,036,800.00
2020062900002588	600597	光 明 乳 业	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	14.86	122300	1,817,378.00
2020062200003238	600820	隧 道 股	2020 年 06 月 22	2020 年 07 月 06	5.65	76400	431,660.00

		份	日	日			
2020062200011610	600820	隧 道 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	5.65	10000	56,500.00
2020063000008470	600009	上 海 机 场	2020 年06 月30 日	2020 年07 月14 日	72.07	53800	3,877,366.00
2020063000008238	600104	上 汽 集 团	2020 年06 月30 日	2020 年07 月14 日	16.99	165000	2,803,350.00
2020062200011968	600602	云 赛 智 联	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	7.26	223300	1,621,158.00
2020062200002764	600616	金 枫 酒 业	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	5.54	185000	1,024,900.00
2020062200012044	600623	华 谊 集 团	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	5.16	10000	51,600.00
2020062200012730	600827	百 联 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	14.45	60000	867,000.00

2020062200012156	600835	上海机电	2020年06月22日	2020年07月06日	16.93	36000	609,480.00
2020062900002594	600835	上海机电	2020年06月29日	2020年07月13日	16.93	58900	997,177.00
2020062200012000	600848	上海临港	2020年06月22日	2020年07月06日	21.47	77800	1,670,366.00
2020062200012408	600895	张江高科	2020年06月22日	2020年07月06日	20.37	100000	2,037,000.00
2020063000007956	600895	张江高科	2020年06月30日	2020年07月14日	20.37	74600	1,519,602.00
2020062200001922	601727	上海电气	2020年06月22日	2020年07月06日	5.04	250000	1,260,000.00
2020062900003140	600639	浦东金桥	2020年06月29日	2020年07月13日	15.98	13900	222,122.00
2020061700012347	600639	浦	2020	2020	15.98	257700	4,118,046.00

		东 金 桥	年 06 月 17 日	年 07 月 01 日			
2020062900003148	600642	申 能 股 份	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.91	101100	597,501.00
2020062200011980	600648	外 高 桥	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.14	349300	4,939,102.00
2020062900000898	600648	外 高 桥	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	14.14	24100	340,774.00
2020062900003170	600675	中 华 企 业	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	4.07	75100	305,657.00
2020062200011986	600676	交 运 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.56	269500	1,498,420.00
2020062200003202	600754	锦 江 酒 店	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	27.75	10000	277,500.00
2020062200011992	600754	锦 江	2020 年 06	2020 年 07	27.75	115700	3,210,675.00

		酒 店	月 22 日	月 06 日			
2020062200012612	600820	隧 道 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.65	223800	1,264,470.00
2020062200012074	600820	隧 道 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.65	46200	261,030.00
2020062200012152	600820	隧 道 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.65	74000	418,100.00
2020062200012728	600822	上 海 物 贸	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	9.92	30000	297,600.00
2020062200001818	600822	上 海 物 贸	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	9.92	20000	198,400.00
2020062200002948	600621	华 鑫 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	19.30	52500	1,013,250.00
2020063000002887	600621	华 鑫 股	2020 年 06 月 30	2020 年 07 月 14	19.30	92200	1,779,460.00

		份	日	日			
2020062200012614	600827	百 联 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	14.45	136000	1,965,200.00
2020062200001932	600827	百 联 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	14.45	81600	1,179,120.00
2020062200011996	600848	上 海 临 港	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	21.47	67600	1,451,372.00
2020062200012004	601727	上 海 电 气	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	5.04	420200	2,117,808.00
2020062900001038	603881	数 据 港	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	108.07	10000	1,080,700.00
2020062900001163	600642	申 能 股 份	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	5.91	30300	179,073.00
2020062200012514	600648	外 高 桥	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	14.14	40800	576,912.00

2020062200011866	600649	城 投 控 股	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.94	10000	59,400.00
2020062200002063	600649	城 投 控 股	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.94	26600	158,004.00
2020062900000882	600649	城 投 控 股	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.94	65000	386,100.00
2020062900003152	600649	城 投 控 股	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.94	52100	309,474.00
2020062200011874	600675	中 华 企 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.07	10000	40,700.00
2020062200011982	600675	中 华 企 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.07	191600	779,812.00
2020062200011984	600675	中 华 企 业	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	4.07	1000000	4,070,000.00
2020062200011886	600754	锦	2020	2020	27.75	10000	277,500.00

		江 酒 店	年 06 月 22 日	年 07 月 06 日			
2020062200012548	600820	隧 道 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.65	160600	907,390.00
2020062200011668	600820	隧 道 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.65	84600	477,990.00
2020062900000810	600822	上 海 物 贸	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	9.92	14400	142,848.00
2020062900001342	600825	新 华 传 媒	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	6.21	100000	621,000.00
2020062200012028	600170	上 海 建 工	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	3.07	88100	270,467.00
2020063000008568	600597	光 明 乳 业	2020 年 06 月 30 日	2020 年 07 月 14 日	14.86	24000	356,640.00
2020062200012510	600604	市 北	2020 年 06	2020 年 07	9.41	230800	2,171,828.00

		高 新	月 22 日	月 06 日			
2020062200012506	600604	市 北 高 新	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	9.41	125400	1,180,014.00
2020062900003132	600623	华 谊 集 团	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.16	23100	119,196.00
2020062200011990	600827	百 联 股 份	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	14.45	388100	5,608,045.00
2020062900002590	600827	百 联 股 份	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	14.45	109100	1,576,495.00
2020062200001893	601727	上 海 电 气	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.04	210000	1,058,400.00
2020062200001883	601727	上 海 电 气	2020 年 06 月 22 日	2020 年 07 月 06 日	5.04	91300	460,152.00
2020062900000811	601727	上 海 电	2020 年 06 月 29 日	2020 年 07 月 13 日	5.04	391700	1,974,168.00

		气	日	日			
2020062900001001	603881	数 据 港	2020 年06 月29 日	2020 年07 月13 日	108.07	10000	1,080,700.00
2020063000008492	600649	城 投 控 股	2020 年06 月30 日	2020 年07 月14 日	5.94	65000	386,100.00
2020062200011976	600663	陆 家 嘴	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	11.21	768500	8,614,885.00
2020062200012056	600748	上 实 发 展	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	5.11	22500	114,975.00
2020062200003249	600820	隧 道 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	5.65	92200	520,930.00
2020062200012862	600820	隧 道 股 份	2020 年06 月22 日	2020 年07 月06 日	5.65	10000	56,500.00
合计	-	-	-	-	-	20,047,600	226,345,647.00

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期 末 2020 年06 月30 日	1个月以内	1-3 个月	3 个 月 -1 年	1-5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	104,223,283.25	-	-	-	-	-	104,223,283.25
结算 备付 金	104,562.54	-	-	-	-	-	104,562.54

存出 保证 金	16,440.22	-	-	-	-	-	16,440.22
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	9,955,873,506.85	9,955,873,506.85
应收 股利	-	-	-	-	-	272,768.00	272,768.00
应收 利息	-	-	-	-	-	65,588.42	65,588.42
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	85,087.69	85,087.69
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产 总计	104,344,286.01	-	-	-	-	9,956,296,950.96	10,060,641,236.97

负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	3,657,749.32	3,657,749.32
应付 托管 费	-	-	-	-	-	812,833.17	812,833.17
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	11,892,164.72	11,892,164.72
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	1,122,084.36	1,122,084.36
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	827,655.49	827,655.49
负债总计	-	-	-	-	-	18,312,487.06	18,312,487.06
利率敏感度缺口	104,344,286.01	-	-	-	-	9,937,984,463.90	10,042,328,749.91
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	65,097,766.02	-	-	-	-	-	65,097,766.02
结算备付金	473,567.14	-	-	-	-	-	473,567.14
存出保证金	940,213.15	-	-	-	-	-	940,213.15
交易性金	-	-	-	-	-	12,006,679,713.02	12,006,679,713.02

融资							
资产							
应收							
股利	-	-	-	-	-	-	-
应收							
利息	-	-	-	-	-	13,780.99	13,780.99
应收							
申购							
款	-	-	-	-	-	-	-
衍生							
金融							
资产	-	-	-	-	-	-	-
应收							
证券							
清算							
款	-	-	-	-	-	765,340.09	765,340.09
买入							
返售							
金融							
资产	-	-	-	-	-	-	-
其他							
资产	-	-	-	-	-	-	-
资产							
总计	66,511,546.31	-	-	-	-	12,007,458,834.10	12,073,970,380.41
负债							
应付							
赎回							
款	-	-	-	-	-	-	-
应付							
	-	-	-	-	-	4,613,479.27	4,613,479.27

管理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	1,025,217.60	1,025,217.60
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	872,378.18	872,378.18
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	1,522,721.14	1,522,721.14

负债							
负债 总计	-	-	-	-	-	8,033,796.19	8,033,796.19
利率 敏感 度缺 口	66,511,546.31	-	-	-	-	11,999,425,037.91	12,065,936,584.22

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。本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股，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	9,955,873,506.85	99.14	12,006,679,713.02	99.51

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	9,955,873,506.85	99.14	12,006,679,713.02	99.51

注：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不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。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表。

#### 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
	中证上海国企指数上涨 5%	499,035,375.03	598,118,706.96
	中证上海国企指数下跌 5%	-499,035,375.03	-598,118,706.96

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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	9,955,873,506.85	98.96
	其中：股票	9,955,873,506.85	98.96
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	104,327,845.79	1.04
8	其他资产	439,884.33	0.00
9	合计	10,060,641,236.97	100.00

注：1、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 226,345,647.00 元，占期末基金资产净值比例 2.25%。

2、此处股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

## 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	6,617,719.00	0.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,107,193,943.56	20.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	238,439,428.71	2.37
E	建筑业	351,066,842.80	3.50
F	批发和零售业	620,682,341.30	6.18

G	交通运输、仓储和邮政业	1,655,044,153.40	16.48
H	住宿和餐饮业	146,380,806.00	1.46
I	信息传输、软件和信息技术服务业	237,355,522.37	2.36
J	金融业	2,390,362,473.17	23.80
K	房地产业	2,062,746,766.56	20.54
L	租赁和商务服务业	15,351,600.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	21,802,691.32	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	30,417,648.00	0.30
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	68,548,470.03	0.68
S	综合	-	-
	合计	9,952,010,406.22	99.10

### 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	2,933,075.73	0.03
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	769,467.98	0.01
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	147,789.60	0.00
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	3,863,099.63	0.04

### 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	600018	上港集团	189,535,830	796,050,486.00	7.93
2	600009	上海机场	10,840,580	781,280,600.60	7.78
3	600104	上汽集团	43,361,788	736,716,778.12	7.34
4	601601	中国太保	23,957,295	652,836,288.75	6.50
5	600000	浦发银行	61,411,240	649,730,919.20	6.47
6	600741	华域汽车	30,089,067	625,551,702.93	6.23
7	600606	绿地控股	95,311,856	589,027,270.08	5.87
8	600848	上海临港	18,914,526	406,094,873.22	4.04
9	601727	上海电气	73,023,414	368,038,006.56	3.66

10	600663	陆家嘴	30,440,191	341,234,541.11	3.40
11	601211	国泰君安	18,155,968	313,372,007.68	3.12
12	601229	上海银行	32,150,892	266,852,403.60	2.66
13	600837	海通证券	19,719,723	248,074,115.34	2.47
14	600675	中华企业	59,428,430	241,873,710.10	2.41
15	600642	申能股份	40,345,081	238,439,428.71	2.37
16	600827	百联股份	14,850,554	214,590,505.30	2.14
17	600170	上海建工	64,182,240	197,039,476.80	1.96
18	601607	上海医药	10,002,540	183,846,685.20	1.83
19	600637	东方明珠	17,847,313	172,226,570.45	1.72
20	600958	东方证券	17,575,440	166,790,925.60	1.66
21	600754	锦江酒店	5,274,984	146,380,806.00	1.46
22	600895	张江高科	6,688,016	136,234,885.92	1.36
23	600820	隧道股份	23,515,999	132,865,394.35	1.32
24	600649	城投控股	20,263,668	120,366,187.92	1.20
25	600648	外高桥	6,615,104	93,537,570.56	0.93
26	600621	华鑫股份	4,803,410	92,705,813.00	0.92
27	600623	华谊集团	16,537,513	85,333,567.08	0.85
28	600835	上海机电	4,340,245	73,480,347.85	0.73
29	600597	光明乳业	4,707,512	69,953,628.32	0.70
30	600639	浦东金桥	4,191,452	66,979,402.96	0.67
31	600612	老凤祥	978,678	47,162,492.82	0.47
32	600708	光明地产	16,182,945	45,474,075.45	0.45
33	600748	上实发展	8,501,624	43,443,298.64	0.43
34	600604	市北高新	4,486,722	42,220,054.02	0.42
35	601595	上海电影	2,618,262	39,483,390.96	0.39
36	603881	数据港	363,306	39,262,479.42	0.39
37	600826	兰生股份	2,924,291	30,588,083.86	0.30
38	601200	上海环境	2,534,804	30,417,648.00	0.30

39	600073	上海梅林	3,124,500	29,651,505.00	0.30
40	600825	新华传媒	4,680,367	29,065,079.07	0.29
41	600602	云赛智联	3,562,875	25,866,472.50	0.26
42	600278	东方创业	2,692,156	24,956,286.12	0.25
43	600662	强生控股	3,046,627	24,312,083.46	0.24
44	600773	西藏城投	3,844,171	22,834,375.74	0.23
45	600629	华建集团	2,538,148	21,802,691.32	0.22
46	600284	浦东建设	3,440,971	21,161,971.65	0.21
47	600626	申达股份	3,890,800	19,492,908.00	0.19
48	600834	申通地铁	1,477,966	18,474,575.00	0.18
49	600676	交运股份	3,169,144	17,620,440.64	0.18
50	600650	锦江投资	1,868,895	17,305,967.70	0.17
51	600618	氯碱化工	2,313,729	16,427,475.90	0.16
52	603648	畅联股份	1,744,500	15,351,600.00	0.15
53	600822	上海物贸	1,348,482	13,376,941.44	0.13
54	600824	益民集团	3,246,340	13,082,750.20	0.13
55	600841	上柴股份	1,715,617	11,957,850.49	0.12
56	600628	新世界	964,142	11,309,385.66	0.11
57	600616	金枫酒业	1,905,108	10,554,298.32	0.11
58	600619	海立股份	1,272,872	10,144,789.84	0.10
59	600819	耀皮玻璃	1,661,830	7,461,616.70	0.07
60	600692	亚通股份	985,020	6,964,091.40	0.07
61	600833	第一医药	644,355	6,894,598.50	0.07
62	600097	开创国际	720,100	6,617,719.00	0.07
63	600838	上海九百	800,554	6,396,426.46	0.06
64	600630	龙头股份	902,514	6,073,919.22	0.06
65	600679	上海凤凰	377,500	4,620,600.00	0.05
66	600843	上工申贝	616,899	4,065,364.41	0.04
67	600272	开开实业	336,800	2,610,200.00	0.03

### 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	0.01
2	688123	聚辰股份	6,660	512,820.00	0.01
3	688518	联赢激光	14,111	389,886.93	0.00
4	688558	国盛智科	8,488	376,018.40	0.00
5	688365	光云科技	8,249	356,521.78	0.00
6	688181	八亿时空	4,306	263,053.54	0.00
7	688555	泽达易盛	3,004	234,312.00	0.00
8	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
9	688178	万德斯	3,704	147,789.60	0.00
10	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
11	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
12	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
13	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
14	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
15	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	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	600018	上港集团	170,416,061.90	1.41
2	600104	上汽集团	124,726,270.19	1.03
3	600741	华域汽车	119,219,075.75	0.99
4	600848	上海临港	77,168,137.73	0.64

5	601601	中国太保	76,468,837.15	0.63
6	600009	上海机场	58,549,529.08	0.49
7	600000	浦发银行	46,774,014.77	0.39
8	600837	海通证券	43,167,497.83	0.36
9	600606	绿地控股	40,235,689.56	0.33
10	601211	国泰君安	33,830,035.86	0.28
11	600663	陆家嘴	29,492,020.86	0.24
12	600675	中华企业	24,415,369.25	0.20
13	600642	申能股份	23,956,888.56	0.20
14	601229	上海银行	22,883,375.43	0.19
15	600827	百联股份	20,923,234.81	0.17
16	600170	上海建工	15,749,888.05	0.13
17	601607	上海医药	14,729,881.98	0.12
18	600662	强生控股	9,481,812.42	0.08
19	600284	浦东建设	8,757,635.42	0.07
20	600958	东方证券	7,971,985.00	0.07

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	601601	中国太保	83,661,057.12	0.69
2	600895	张江高科	80,167,313.36	0.66
3	600009	上海机场	74,735,294.46	0.62
4	601727	上海电气	70,726,688.57	0.59
5	600637	东方明珠	41,273,158.55	0.34
6	600827	百联股份	38,640,930.32	0.32
7	600754	锦江酒店	36,021,941.32	0.30
8	601211	国泰君安	34,309,429.11	0.28
9	600741	华域汽车	31,206,444.59	0.26
10	601607	上海医药	28,919,079.13	0.24
11	600597	光明乳业	28,007,544.11	0.23
12	600820	隧道股份	26,820,737.88	0.22

13	600834	申通地铁	26,163,376.14	0.22
14	600104	上汽集团	24,904,784.14	0.21
15	600621	华鑫股份	24,398,359.99	0.20
16	603881	数据港	19,875,593.65	0.16
17	600662	强生控股	19,875,231.00	0.16
18	600649	城投控股	17,972,844.62	0.15
19	600639	浦东金桥	17,942,961.10	0.15
20	600675	中华企业	17,188,436.28	0.14

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	1,031,534,706.65
卖出股票收入（成交）总额	960,791,589.85

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、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	16,440.22
2	应收证券清算款	85,087.69
3	应收股利	272,768.00
4	应收利息	65,588.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	439,884.33

#### 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	688365	光云科技	356,521.78	0.00	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		中国工商银行股份有限公司—中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
2,580	4,655,462.68	11,932,338,895.00	99.34	78,754,815.00	0.66	352,681,550.00	2.94

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“中国工商银行股份有限公司—中证上海国企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	上海国盛集团资产有限公司	1,809,620,825.00	15.07
2	申能(集团)有限公司	1,627,624,800.00	13.55
3	上海华谊(集团)公司	1,579,005,316.00	13.15
4	上海城投(集团)有限公司	1,572,000,000.00	13.09
5	上海国盛(集团)有限公司	1,064,773,255.00	8.86

6	光明食品(集团)有限公司	839,022,608.00	6.99
7	上海兰生股份有限公司	633,926,542.00	5.28
8	上海久事(集团)有限公司	556,906,861.00	4.64
9	申能股份有限公司	548,445,550.00	4.57
10	上海电气(集团)总公司	319,365,667.00	2.66
11	中国工商银行股份有限公司—中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金	352,681,550.00	2.94

### 8.3 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	1,000.00	0.00

### 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(2016年07月28日)基金份额总额	15,220,091,004.00
本报告期期初基金份额总额	12,940,093,710.00
本报告期基金总申购份额	397,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,326,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,011,093,710.00

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

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（%）	

			(%)			
东方 证券	3	1,929,599,287.29	97.60	1,797,031.49	97.60	
招商 证券	2	47,426,844.65	2.40	44,169.46	2.40	
安信 证券	2	-	-	-	-	
北京 高华	1	-	-	-	-	
财富 证券	1	-	-	-	-	
长城 证券	1	-	-	-	-	
长江 证券	1	-	-	-	-	
东吴 证券	2	-	-	-	-	
东兴 证券	1	-	-	-	-	
方正 证券	1	-	-	-	-	
光大 证券	1	-	-	-	-	
广发 证券	1	-	-	-	-	
广州 证券	1	-	-	-	-	
国都 证券	1	-	-	-	-	

国金 证券	2	-	-	-	-	
国泰 君安	2	-	-	-	-	
国信 证券	2	-	-	-	-	
海通 证券	2	-	-	-	-	
华融 证券	2	-	-	-	-	
华泰 证券	2	-	-	-	-	
华鑫 证券	1	-	-	-	-	
上海 证券	1	-	-	-	-	
申万 宏源 证券	1	-	-	-	-	
西南 证券	1	-	-	-	-	
兴业 证券	2	-	-	-	-	
银河 证券	3	-	-	-	-	
中金 财富	1	-	-	-	-	
中金 公司	2	-	-	-	-	

中泰 证券	2	-	-	-	-
中信 建投 证券	1	-	-	-	-
中信 证券	1	-	-	-	-
中银 国际	1	-	-	-	-

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 (%)
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
北京 高华	-	-	-	-	-	-	-	-
财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于调整基金经理的公告(上海国企ETF)	上交所,公司网站,证券日报	2020年01月02日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的费率优惠活动的公告	上证报,公司网站	2020年01月02日
3	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2020	上交所,公司网站,证券日报	2020年01月04日

	年 1 月 4 日更新)		
4	汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年第 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 01 月 21 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金暂停申购、赎回 等业务的公告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 01 月 31 日
6	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2020 年 2 月 17 日更新)	上交所, 公司网站, 证券日报	2020 年 02 月 17 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分沪市上市基金增加扩位证券简称的公告	中证报, 上交所, 公司网站	2020 年 03 月 14 日
8	中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2020 年 3 月 19 日更新)	上交所, 公司网站, 证券日报	2020 年 03 月 19 日
9	汇添富基金旗下 139 只基金 2019 年年度报告	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 03 月 30 日
10	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
11	汇添富基金管理股份有限公司关于根据《公开募	中证报, 上交所, 证券时报, 上证报, 公	2020 年 04 月 14 日

	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	
12	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
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分 ETF 修改标的指数使用许可费并修改基金合同、托管协议、招募说明书的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所	2020 年 04 月 29 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金中基金 (FOF) 资产管理计划通过直销渠道申赎本公司旗下公募基金免除相关费用的公告	中证报, 公司网站	2020 年 04 月 29 日
15	中证上海国企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)	上交所, 公司网站, 证券日报	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

注：无。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证上海国企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、报告期内中证上海国企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](http://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