

# 汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资 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	2
§ 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.....	14
§ 5 托管人报告 .....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 .....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§ 8 基金份额持有人信息 .....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	61
§ 9 开放式基金份额变动 .....	61
§ 10 重大事件揭示 .....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70

§ 12 备查文件目录 .....	70
12.1 备查文件目录 .....	70
12.2 存放地点 .....	71
12.3 查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金
基金简称	汇添富沪深 300 安中指数
基金主代码	000368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	184,043,347.82
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

## § 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	25,826,395.62
本期利润	38,335,021.57
加权平均基金份额本期利润	0.1923
本期加权平均净值利润率	11.54%
本期基金份额净值增长率	12.75%
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	112,130,965.66
期末可供分配基金份额利润	0.6093
期末基金资产净值	336,365,691.28
期末基金份额净值	1.8276
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	82.76%

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

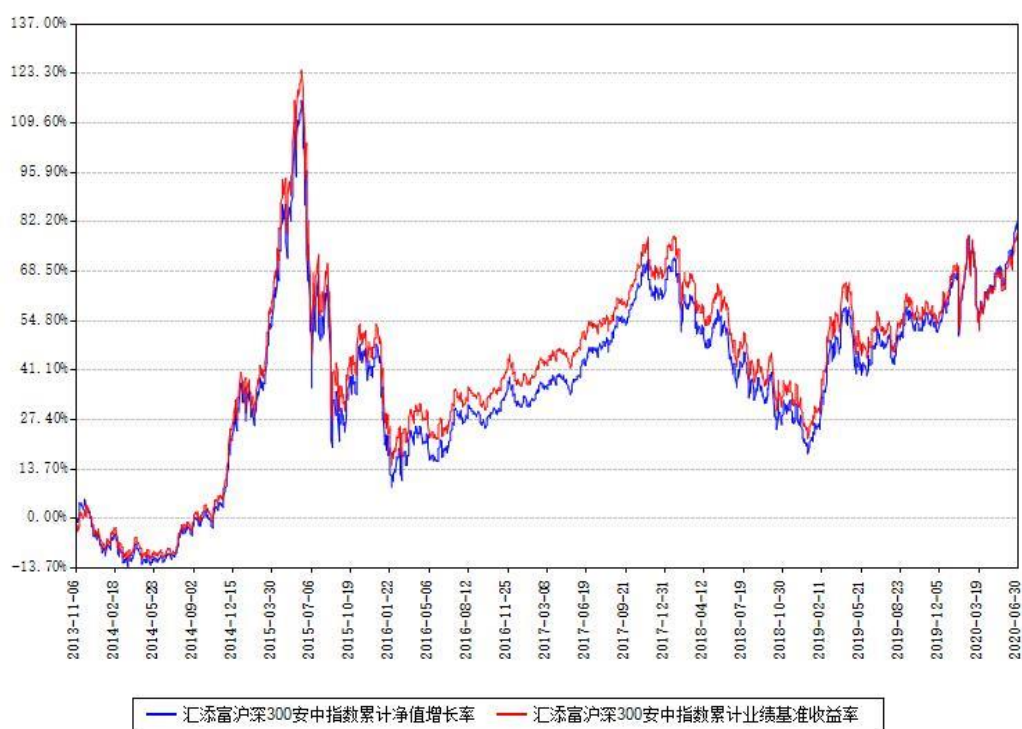
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.14%	0.88%	8.97%	0.91%	1.17%	-0.03%

过去三个月	15.41%	0.88%	13.55%	0.89%	1.86%	-0.01%
过去六个月	12.75%	1.51%	9.29%	1.53%	3.46%	-0.02%
过去一年	23.27%	1.21%	17.29%	1.23%	5.98%	-0.02%
过去三年	24.00%	1.21%	16.01%	1.22%	7.99%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	82.76%	1.49%	79.30%	1.45%	3.46%	0.04%

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

汇添富沪深300安中指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2013年11月06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	2013 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、



					<p>数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金的基金经理，2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金的基金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理，2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015 年 3 月 24 日至今任汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理，2016 年 7 月 28 日至今</p>
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					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。
--	--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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合规守信情况的说明

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

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

今年一季度,疫情和国际油价的波动等突发事件对全球经济产生了重大影响,从国内的情况来看,因疫情期间经济活动减缓,对经济和人们生活的影响最为显著。二季度以来,国内疫情逐渐得到有效防控,之前受制于疫情的经济增长明显改善,各行业复产复工有序恢复,生产需求持续改善,就业和物价总体平稳,积极因素累积增多,主要经济指标环比明显改善。

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。当前货币政策加大对实体经济的支持，同时随着企业新增减负、政府性基金的落实，财政政策将更加积极，这些将为后续经济恢复提供有力支持。

市场上，流动性维持合理充裕，资金利率仍处于较低水平。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。以北上资金为代表的外资亦在持续稳定加大对 A 股的配置。这些将带动市场风险偏好的提升，而随着市场风险偏好的提升，叠加经济恢复，低估值板块与成长类板块后续都将有机会。

但需要注意的是，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，如果这些问题进一步激化，将给国内正在恢复的经济带来一定压力，但总体而言，中国经济相对于全球来说，是有较大优势的。

上半年 A 股行业分化明显，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。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对市场整体性投资逻辑。

安中动态指数基于沪深 300 成分股的行业动态配置策略指数，今年上半年较好的把握了市场投资逻辑，实现了较好的相对沪深 300 指数的投资收益，沪深 300 安中动态指数基金是投资者把握市场整体性投资机会的好工具。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，保持了指数基金的本质属性，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 12.75%。同期业绩比较基准收益率为 9.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在上半年疫情冲击的背景下，国内应对果断、防控措施有力，从数据来看的经济运行情况体现了强劲的韧性，未来复工复产稳步推进，应当无需过度悲观。然而从国际视角来看，当下的外部环境不确定性高于国内，国际关系及贸易摩擦等冲突点在疫情冲击下被放大，带来一定的外部压力。

尽管今年面临诸多压力，但 A 股的中长期投资价值仍具吸引力。首先，国内居民资产在权益资产的配置比例相比发达国家水平仍然较低，全球流动性宽松的环境下，未来权益资产配置比例逐步提升的长期趋势可期。其次，国内经济在面临外部压力的环境下，将更多地转向内需挖掘与构建完善的供应链体系，力争在各生产流通环节实现国内大循环。与此同时，

市场化进程也将持续不断地推进，意味着资本市场将需要发挥其资源配置的作用，引导长期资金进入、支持实体经济发展。

从结构的角度，上半年的 A 股市场体现出较强的结构性行情特征。截至年中的各行业估值分化也接近历史峰值水平，下一阶段或将出现估值差异收敛的过程。资金面的角度来看，海外资金上半年仍在不断流入，国内基金市场权益类基金发行持续火热，综合看 A 股未来资金仍较为充裕，有整体配置的价值。

安中动态指数基金是跟踪安中动态指数的基金产品，结构均衡，是权益资产的基础性配置工具。在投资运作上将严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

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

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

#### 5.3 托管人对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汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金 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：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

报告截止日：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	15,539,075.17	18,034,981.73
结算备付金		496,795.58	588,516.95
存出保证金		36,075.83	47,207.06
交易性金融资产	6.4.7.2	319,041,872.79	318,489,670.48

其中：股票投资		317,053,879.29	318,489,670.48
基金投资		-	-
债券投资		1,987,993.50	-
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		3,443,798.87	22,080,565.21
应收利息	6.4.7.5	22,762.09	3,945.46
应收股利		-	-
应收申购款		384,271.22	36,682.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		338,964,651.55	359,281,569.02
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		1,842,023.09	16,051,754.02
应付赎回款		210,713.53	265,147.98
应付管理人报酬		133,732.53	141,375.07
应付托管费		26,746.49	28,274.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	235,818.83	399,735.58
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	149,925.80	350,780.47
负债合计		2,598,960.27	17,237,068.11
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	184,043,347.82	211,022,093.66
未分配利润	6.4.7.1 0	152,322,343.46	131,022,407.25
所有者权益合计		336,365,691.28	342,044,500.91
负债和所有者权益总计		338,964,651.55	359,281,569.02

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.8276 元，基金份额总额 184,043,347.82 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：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>40,439,481.86</b>	<b>63,662,527.70</b>
1. 利息收入		62,209.80	69,962.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	60,036.88	69,886.77
债券利息收入		2,172.92	75.53
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,801,008.18	22,966,396.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	24,617,633.18	19,543,147.17
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-2,250.00	42,623.85
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	3,185,625.00	3,380,625.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	12,508,625.95	40,572,403.72
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	67,637.93	53,765.25
<b>减：二、费用</b>		<b>2,104,460.29</b>	<b>2,239,685.52</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	825,288.72	775,146.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	165,057.67	155,029.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	914,322.00	1,079,152.38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.23
7. 其他费用	6.4.7.21	199,791.90	230,357.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>38,335,021.57</b>	<b>61,422,842.18</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号</b>		<b>38,335,021.57</b>	<b>61,422,842.18</b>



填列)			
-----	--	--	--

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金

本报告期：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)	211,022,093.66	131,022,407.25	342,044,500.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,335,021.57	38,335,021.57
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)	-26,978,745.84	-17,035,085.36	-44,013,831.20
其中：1. 基金申购款	35,328,379.11	22,875,338.75	58,203,717.86
2. 基金赎回款	-62,307,124.95	-39,910,424.11	-102,217,549.06
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)	184,043,347.82	152,322,343.46	336,365,691.28
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)	221,135,626.32	45,851,448.45	266,987,074.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	61,422,842.18	61,422,842.18
三、本期基金份额交易产生的基	-2,736,434.81	-1,864,169.57	-4,600,604.38

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	30,321,643.61	13,211,579.89	43,533,223.50
2. 基金赎回款	-33,058,078.42	-15,075,749.46	-48,133,827.88
四、本期向基金 份额持有人分配 利润产生的基金 净值变动(净值 减少以“-”号填 列)	-	-	-
五、期末所有者 权益(基金净值)	218,399,191.51	105,410,121.06	323,809,312.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

张晖

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

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

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

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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	15,539,075.17
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	15,539,075.17

#### 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	284,353,637.07	317,053,879.29	32,700,242.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,988,852.70	1,987,993.50
	银行间市场	-	-
	其他	-	-
	合计	1,988,852.70	1,987,993.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	286,342,489.77	319,041,872.79	32,699,383.02

#### 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	1,356.23
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	201.15
应收债券利息	21,190.13
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	-
其他	14.58
合计	22,762.09

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	235,818.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	235,818.83

## 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	471.90
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	50,000.00
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
其他	-
合计	149,925.80

## 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	211,022,093.66	211,022,093.66
本期申购	35,328,379.11	35,328,379.11
本期赎回（以“-”号填列）	-62,307,124.95	-62,307,124.95
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	184,043,347.82	184,043,347.82

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	101,224,054.83	29,798,352.42	131,022,407.25
本期利润	25,826,395.62	12,508,625.95	38,335,021.57
本期基金份额交易产生的变动数	-14,919,484.79	-2,115,600.57	-17,035,085.36
其中：基金申购款	18,405,943.64	4,469,395.11	22,875,338.75
基金赎回款	-33,325,428.43	-6,584,995.68	-39,910,424.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	112,130,965.66	40,191,377.80	152,322,343.46

#### 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	55,977.92
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	3,731.86
其他	327.10
合计	60,036.88

注：“其他”为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	310,445,058.67
减：卖出股票成本总额	285,827,425.49
买卖股票差价收入	24,617,633.18

#### 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

单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,023,803.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,010,650.00
减：应收利息总额	15,403.97
买卖债券差价收入	-2,250.00

#### 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

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	3,185,625.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,185,625.00

#### 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	12,508,625.95
——股票投资	12,509,485.15
——债券投资	-859.20
——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	12,508,625.95

#### 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	67,637.93
替代损益	-
其他	-
合计	67,637.93

## 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	914,322.00
银行间市场交易费用	-
合计	914,322.00

## 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	338.00
指数使用费	100,000.00
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	199,791.90

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	149,321,770.92	25.86	224,143,323.42	31.52

##### 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	138,123.80	25.89	10,059.20	4.27
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	207,490.96	31.60	207,490.96	54.76

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	825,288.72	775,146.37
其中：支付销售机构的客户维护费	51,296.33	53,761.81

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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	165,057.67	155,029.25

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 6.4.10.4 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

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固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 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及上年度可比期间均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及上年度末均未投资本基金。

#### 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		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	15,539,075.17	55,977.92	17,878,309.03	63,421.79

#### 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

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
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
688520	神州细胞	2020年06月11日	2020年12月22日	新股流通受限	25.64	58.82	5,077	130,174.28	298,629.14
688027	国盾量子	2020年06月30日	2021年01月11日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40
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

		日	日	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	7,711	87,365.63	87,365.63	
688558	国盛智科	2020年06月19日	2020年12月30日	新股流通受限	17.37	35.26	8,488	147,436.56	299,286.88	
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	
688026	洁特生物	2020年01月15日	2020年07月22日	新股流通受限	16.49	83.32	4,433	73,100.17	369,357.56	
688377	迪威尔	2020年06月	2020年07月	新股流通	16.42	16.42	6,822	112,017.24	112,017.24	



		29 日	08 日	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	
300845	捷 安 高 科	2020 年 06 月 24 日	2020 年 07 月 03 日	新 股 流 通 受 限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	
688228	开 普 云	2020 年 03 月 19 日	2020 年 09 月 28 日	新 股 流 通 受 限	59.26	73.20	2,718	161,068.68	198,957.60	

#### 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

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

## 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	1 个月以内	1-	3 个月-1 年	1-	5	不计息	合计
-----	--------	----	----------	----	---	-----	----

2020 年 06 月 30 日		3 个 月		5 年	年 以 上		
资产							
银行存款	15,539,075.17	-	-	-	-	-	15,539,075.17
结算备付金	496,795.58	-	-	-	-	-	496,795.58
存出保证金	36,075.83	-	-	-	-	-	36,075.83
交易性金融资产	-	-	1,987,993.50	-	-	317,053,879.29	319,041,872.79
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	22,762.09	22,762.09
应收申购款	-	-	-	-	-	384,271.22	384,271.22
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,443,798.87	3,443,798.87
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	16,071,946.58	-	1,987,993.50	-	-	320,904,711.47	338,964,651.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	210,713.53	210,713.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	133,732.53	133,732.53
应付托管费	-	-	-	-	-	26,746.49	26,746.49
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,842,023.09	1,842,023.09
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	235,818.83	235,818.83
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	149,925.80	149,925.80

负债总计	-	-	-	-	-	2,598,960.27	2,598,960.27
利率敏感度缺口	16,071,946.58	-	1,987,993.50	-	-	318,305,751.20	336,365,691.28
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	18,034,981.73	-	-	-	-	-	18,034,981.73
结算备付金	588,516.95	-	-	-	-	-	588,516.95
存出保证金	47,207.06	-	-	-	-	-	47,207.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	318,489,670.48	318,489,670.48
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	3,945.46	3,945.46
应收申购款	-	-	-	-	-	36,682.13	36,682.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算	-	-	-	-	-	22,080,565.21	22,080,565.21

款							
买入返 售金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资 产	-	-	-	-	-	-	-
资产总 计	18,670,70 5.74	-	-	-	-	340,610,863.2 8	359,281,569.0 2
负债							
应付赎 回款	-	-	-	-	-	265,147.98	265,147.98
应付管 理人报 酬	-	-	-	-	-	141,375.07	141,375.07
应付托 管费	-	-	-	-	-	28,274.99	28,274.99
应付证 券清算 款	-	-	-	-	-	16,051,754.02	16,051,754.02
卖出回 购金融 资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销 售服务 费	-	-	-	-	-	-	-
应付交 易费用	-	-	-	-	-	399,735.58	399,735.58
应交税 费	-	-	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	350,780.47	350,780.47
负债总计	-	-	-	-	-	17,237,068.11	17,237,068.11
利率敏感度缺口	18,670,705.74	-	-	-	-	323,373,795.17	342,044,500.91

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

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况;	
	2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点,且除利率之外的其他市场变量保持不变;	
	3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动;	
	4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款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该类资产的未来收益,而对其本身的公允价值无重大影响;定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定,不受利率变化影响;	
	5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。	
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
	基准利率增加 25 个基点	-2,588.96	-
	基准利率减少 25 个基点	2,595.72	-

注：本基金上年度末计息资产仅包括银行活期存款、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，定期存款利息收入与买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响；计息负债仅包括卖出回购金融资产款，卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；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	317,053,879.29	94.26	318,489,670.48	93.11
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,987,993.5	0.59	—	—

	0			
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	319,041,872		318,489,670	
	.79	94.85	.48	93.11

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	沪深 300 安中动态策略指数 上涨 5%	15,779,448.19	16,043,682.81
	沪深 300 安中动态策略指数 下降 5%	-15,779,448.19	-16,043,682.81

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	317,053,879.29	93.54
	其中：股票	317,053,879.29	93.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,987,993.50	0.59
	其中：债券	1,987,993.50	0.59
	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	16,035,870.75	4.73
8	其他资产	3,886,908.01	1.15
9	合计	338,964,651.55	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,913,492.00	1.46
B	采矿业	24,729,628.54	7.35

C	制造业	194,347,485.41	57.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,863,210.65	6.50
E	建筑业	4,003,396.89	1.19
F	批发和零售业	4,605,330.19	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	5,468,100.94	1.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,303,701.34	4.55
J	金融业	18,550,097.43	5.51
K	房地产业	2,327,610.50	0.69
L	租赁和商务服务业	6,245,739.98	1.86
M	科学研究和技术服务业	3,139,886.40	0.93
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	635,475.00	0.19
Q	卫生和社会工作	5,903,107.17	1.75
R	文化、体育和娱乐业	3,158,556.00	0.94
S	综合	-	-
	合计	315,194,818.44	93.71

### 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	1,456,605.16	0.43
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	389,689.37	0.12
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	1,859,060.85	0.55

### 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	600519	贵州茅台	10,832	15,845,916.16	4.71
2	600900	长江电力	634,535	12,018,092.90	3.57
3	600276	恒瑞医药	121,805	11,242,601.50	3.34
4	000333	美的集团	157,610	9,423,501.90	2.80
5	000651	格力电器	153,915	8,706,971.55	2.59

6	000858	五 粮 液	42,969	7,352,855.28	2.19
7	000063	中兴通讯	159,928	6,417,910.64	1.91
8	002475	立讯精密	119,425	6,132,473.75	1.82
9	600028	中国石化	1,355,833	5,301,307.03	1.58
10	601088	中国神华	333,311	4,786,345.96	1.42
11	601888	中国中免	28,038	4,318,693.14	1.28
12	601857	中国石油	985,070	4,127,443.30	1.23
13	600887	伊利股份	132,532	4,125,721.16	1.23
14	000661	长春高新	9,300	4,048,290.00	1.20
15	000725	京东方 A	783,938	3,660,990.46	1.09
16	601318	中国平安	48,988	3,497,743.20	1.04
17	600745	闻泰科技	26,500	3,337,675.00	0.99
18	600585	海螺水泥	61,925	3,276,451.75	0.97
19	002415	海康威视	105,649	3,206,447.15	0.95
20	603259	药明康德	32,504	3,139,886.40	0.93
21	300015	爱尔眼科	67,861	2,948,560.45	0.88
22	601225	陕西煤业	398,266	2,871,497.86	0.85
23	002714	牧原股份	33,968	2,785,376.00	0.83
24	000100	TCL 科技	441,265	2,735,843.00	0.81
25	300142	沃森生物	51,201	2,680,884.36	0.80
26	600050	中国联通	553,268	2,677,817.12	0.80
27	603288	海天味业	21,340	2,654,696.00	0.79
28	300136	信维通信	45,100	2,391,202.00	0.71
29	603986	兆易创新	9,180	2,165,653.80	0.64
30	300122	智飞生物	21,300	2,133,195.00	0.63
31	300498	温氏股份	97,620	2,128,116.00	0.63
32	600690	海尔智家	118,728	2,101,485.60	0.62
33	002594	比亚迪	29,247	2,099,934.60	0.62
34	600588	用友网络	45,193	1,993,011.30	0.59

35	600309	万华化学	39,476	1,973,405.24	0.59
36	002241	歌尔股份	65,382	1,919,615.52	0.57
37	600104	上汽集团	112,882	1,917,865.18	0.57
38	002027	分众传媒	335,512	1,868,801.84	0.56
39	601985	中国核电	453,500	1,854,815.00	0.55
40	002007	华兰生物	35,923	1,800,101.53	0.54
41	300601	康泰生物	11,100	1,799,976.00	0.54
42	002410	广联达	25,800	1,798,260.00	0.53
43	600703	三安光电	69,826	1,745,650.00	0.52
44	002555	三七互娱	36,200	1,694,160.00	0.50
45	600436	片仔癀	9,850	1,676,962.50	0.50
46	600522	中天科技	145,200	1,662,540.00	0.49
47	300347	泰格医药	16,300	1,660,644.00	0.49
48	601138	工业富联	106,900	1,619,535.00	0.48
49	002230	科大讯飞	42,332	1,584,486.76	0.47
50	600795	国电电力	853,248	1,578,508.80	0.47
51	600036	招商银行	46,189	1,557,493.08	0.46
52	600886	国投电力	197,683	1,553,788.38	0.46
53	000538	云南白药	16,435	1,541,767.35	0.46
54	300413	芒果超媒	23,560	1,536,112.00	0.46
55	601899	紫金矿业	348,475	1,533,290.00	0.46
56	000568	泸州老窖	16,658	1,517,876.96	0.45
57	600031	三一重工	80,385	1,508,022.60	0.45
58	300003	乐普医疗	40,800	1,490,016.00	0.44
59	002304	洋河股份	13,778	1,448,618.92	0.43
60	000876	新希望	47,736	1,422,532.80	0.42
61	601012	隆基股份	34,285	1,396,428.05	0.42
62	600011	华能国际	323,900	1,366,858.00	0.41
63	601668	中国建筑	285,574	1,362,187.98	0.40

64	600196	复星医药	39,393	1,333,453.05	0.40
65	600487	亨通光电	80,700	1,324,287.00	0.39
66	002044	美年健康	89,792	1,293,902.72	0.38
67	003816	中国广核	433,900	1,284,344.00	0.38
68	000938	紫光股份	29,436	1,265,159.28	0.38
69	600547	山东黄金	33,304	1,219,592.48	0.36
70	600498	烽火通信	41,500	1,199,765.00	0.36
71	002371	北方华创	7,000	1,196,370.00	0.36
72	002001	新和成	40,700	1,184,370.00	0.35
73	002271	东方雨虹	28,600	1,162,018.00	0.35
74	603019	中科曙光	29,700	1,140,480.00	0.34
75	000977	浪潮信息	28,900	1,132,302.00	0.34
76	601988	中国银行	320,934	1,116,850.32	0.33
77	002460	赣锋锂业	20,600	1,103,542.00	0.33
78	603160	汇顶科技	4,900	1,092,210.00	0.32
79	600741	华域汽车	52,101	1,083,179.79	0.32
80	300628	亿联网络	15,700	1,071,682.00	0.32
81	600019	宝钢股份	233,674	1,065,553.44	0.32
82	002602	世纪华通	68,900	1,054,859.00	0.31
83	002024	苏宁易购	119,459	1,047,655.43	0.31
84	002624	完美世界	18,100	1,043,284.00	0.31
85	600583	海油工程	222,437	1,012,088.35	0.30
86	300433	蓝思科技	35,999	1,009,411.96	0.30
87	000895	双汇发展	21,842	1,006,697.78	0.30
88	002352	顺丰控股	18,300	1,001,010.00	0.30
89	603501	韦尔股份	4,900	989,555.00	0.29
90	002236	大华股份	51,107	981,765.47	0.29
91	600438	通威股份	56,001	973,297.38	0.29
92	002456	欧菲光	52,487	965,235.93	0.29



93	600009	上海机场	13,166	948,873.62	0.28
94	600660	福耀玻璃	45,316	945,744.92	0.28
95	600183	生益科技	31,900	933,713.00	0.28
96	601766	中国中车	167,056	930,501.92	0.28
97	600030	中信证券	38,404	925,920.44	0.28
98	600674	川投能源	97,091	900,033.57	0.27
99	600809	山西汾酒	6,100	884,500.00	0.26
100	300144	宋城演艺	50,940	881,262.00	0.26
101	000338	潍柴动力	64,160	880,275.20	0.26
102	601166	兴业银行	55,763	879,940.14	0.26
103	002311	海大集团	18,098	861,283.82	0.26
104	600352	浙江龙盛	67,285	860,575.15	0.26
105	601933	永辉超市	89,192	836,620.96	0.25
106	300408	三环集团	30,000	831,000.00	0.25
107	002008	大族激光	23,071	829,402.45	0.25
108	002463	沪电股份	33,200	829,336.00	0.25
109	600027	华电国际	241,800	826,956.00	0.25
110	600867	通化东宝	46,100	803,523.00	0.24
111	601808	中海油服	60,101	789,727.14	0.23
112	600188	兖州煤业	89,338	782,600.88	0.23
113	000002	万科 A	29,923	782,187.22	0.23
114	000723	美锦能源	123,400	772,484.00	0.23
115	600346	恒力石化	53,960	755,440.00	0.22
116	002841	视源股份	7,500	746,400.00	0.22
117	000963	华东医药	28,583	723,149.90	0.21
118	603799	华友钴业	18,124	704,298.64	0.21
119	601898	中煤能源	184,900	702,620.00	0.21
120	000625	长安汽车	63,838	702,218.00	0.21
121	603658	安图生物	4,300	698,492.00	0.21

122	603993	洛阳钼业	187,076	686,568.92	0.20
123	002422	科伦药业	32,500	682,500.00	0.20
124	601607	上海医药	36,760	675,648.80	0.20
125	000860	顺鑫农业	11,800	672,364.00	0.20
126	000066	中国长城	50,500	666,600.00	0.20
127	600010	包钢股份	601,988	650,147.04	0.19
128	002916	深南电路	3,880	649,977.60	0.19
129	600637	东方明珠	67,353	649,956.45	0.19
130	600406	国电南瑞	31,670	641,317.50	0.19
131	601328	交通银行	124,693	639,675.09	0.19
132	002607	中公教育	22,900	635,475.00	0.19
133	002179	中航光电	15,443	633,317.43	0.19
134	002129	中环股份	27,700	622,142.00	0.18
135	300014	亿纬锂能	12,700	607,695.00	0.18
136	300059	东方财富	29,978	605,555.60	0.18
137	002493	荣盛石化	48,700	599,010.00	0.18
138	600332	白云山	18,451	596,520.83	0.18
139	603369	今世缘	14,600	580,934.00	0.17
140	601006	大秦铁路	81,193	571,598.72	0.17
141	002252	上海莱士	66,170	559,798.20	0.17
142	601390	中国中铁	111,270	558,575.40	0.17
143	600000	浦发银行	52,745	558,042.10	0.17
144	000001	平安银行	43,461	556,300.80	0.17
145	600016	民生银行	96,376	546,451.92	0.16
146	002050	三花智控	24,827	543,711.30	0.16
147	600177	雅戈尔	90,948	542,050.08	0.16
148	600111	北方稀土	58,108	541,566.56	0.16
149	002466	天齐锂业	23,555	540,587.25	0.16
150	300124	汇川技术	13,869	526,883.31	0.16

151	601186	中国铁建	62,666	525,141.08	0.16
152	600066	宇通客车	42,930	523,746.00	0.16
153	601360	三六零	28,500	521,835.00	0.16
154	600271	航天信息	31,863	517,455.12	0.15
155	002157	正邦科技	29,100	508,668.00	0.15
156	601688	华泰证券	26,658	501,170.40	0.15
157	601989	中国重工	125,200	500,800.00	0.15
158	002601	龙鳞佰利	27,000	499,500.00	0.15
159	600176	中国巨石	54,100	495,015.00	0.15
160	600085	同仁堂	17,944	486,641.28	0.14
161	600968	海油发展	207,300	483,009.00	0.14
162	600025	华能水电	126,600	479,814.00	0.14
163	002508	老板电器	15,400	479,094.00	0.14
164	601600	中国铝业	171,238	472,616.88	0.14
165	600048	保利地产	31,893	471,378.54	0.14
166	603833	欧派家居	4,000	463,600.00	0.14
167	000786	北新建材	21,600	460,728.00	0.14
168	600837	海通证券	36,495	459,107.10	0.14
169	000157	中联重科	71,115	457,269.45	0.14
170	600998	九州通	24,300	452,466.00	0.13
171	600655	豫园股份	50,900	450,974.00	0.13
172	601288	农业银行	129,793	438,700.34	0.13
173	000703	恒逸石化	47,991	438,157.83	0.13
174	601698	中国卫通	24,300	437,643.00	0.13
175	600489	中金黄金	47,433	433,537.62	0.13
176	002773	康弘药业	8,500	421,600.00	0.13
177	000596	古井贡酒	2,800	420,672.00	0.13
178	600297	广汇汽车	131,290	418,815.10	0.12
179	002739	万达电影	27,300	416,871.00	0.12

180	601231	环旭电子	18,700	408,408.00	0.12
181	600570	恒生电子	3,781	407,213.70	0.12
182	002120	韵达股份	15,999	391,175.55	0.12
183	601877	正泰电器	14,500	382,075.00	0.11
184	600219	南山铝业	187,460	380,543.80	0.11
185	002202	金风科技	37,884	377,703.48	0.11
186	002938	鹏鼎控股	7,527	376,801.62	0.11
187	000425	徐工机械	63,683	376,366.53	0.11
188	002032	苏泊尔	5,300	376,300.00	0.11
189	600516	方大炭素	59,891	376,115.48	0.11
190	601229	上海银行	44,937	372,977.10	0.11
191	600362	江西铜业	27,401	368,817.46	0.11
192	601669	中国电建	104,843	362,756.78	0.11
193	002153	石基信息	9,237	360,520.11	0.11
194	601800	中国交建	48,475	355,806.50	0.11
195	601211	国泰君安	20,500	353,830.00	0.11
196	002142	宁波银行	13,423	352,622.21	0.10
197	600089	特变电工	50,957	344,978.89	0.10
198	000768	中航飞机	19,032	337,627.68	0.10
199	601601	中国太保	12,355	336,673.75	0.10
200	600977	中国电影	24,700	324,311.00	0.10
201	601169	北京银行	65,850	322,665.00	0.10
202	600029	南方航空	61,031	315,530.27	0.09
203	002558	巨人网络	17,601	306,257.40	0.09
204	601633	长城汽车	38,839	299,837.08	0.09
205	600893	航发动力	12,507	293,664.36	0.09
206	601100	恒立液压	3,600	288,720.00	0.09
207	603899	晨光文具	5,100	278,460.00	0.08
208	600999	招商证券	12,356	271,214.20	0.08

209	603156	养元饮品	12,560	270,040.00	0.08
210	601111	中国国航	40,665	268,795.65	0.08
211	601238	广汽集团	29,800	268,200.00	0.08
212	601992	金隅集团	86,100	263,466.00	0.08
213	600118	中国卫星	8,440	260,205.20	0.08
214	600115	东方航空	61,211	258,310.42	0.08
215	601818	光大银行	72,010	257,795.80	0.08
216	600233	圆通速递	17,700	257,712.00	0.08
217	601727	上海电气	50,991	256,994.64	0.08
218	600398	海澜之家	43,500	253,170.00	0.08
219	601816	京沪高铁	40,100	249,823.00	0.07
220	601618	中国中冶	97,621	245,028.71	0.07
221	600919	江苏银行	42,000	238,140.00	0.07
222	001979	招商蛇口	14,248	234,237.12	0.07
223	601919	中远海控	65,714	228,027.58	0.07
224	000709	河钢股份	111,345	227,143.80	0.07
225	601216	君正集团	89,034	226,146.36	0.07
226	600068	葛洲坝	37,650	224,017.50	0.07
227	600004	白云机场	14,100	214,884.00	0.06
228	000166	申万宏源	41,030	207,201.50	0.06
229	601628	中国人寿	7,611	207,095.31	0.06
230	600018	上港集团	46,930	197,106.00	0.06
231	600760	中航沈飞	6,000	196,920.00	0.06
232	601009	南京银行	26,736	195,974.88	0.06
233	601018	宁波港	53,689	191,669.73	0.06
234	601939	建设银行	30,274	191,028.94	0.06
235	600170	上海建工	61,042	187,398.94	0.06
236	601117	中国化学	33,300	182,484.00	0.05
237	601021	春秋航空	5,110	180,076.40	0.05

238	600989	宝丰能源	21,100	177,662.00	0.05
239	600038	中直股份	4,178	171,590.46	0.05
240	600015	华夏银行	27,810	170,197.20	0.05
241	601336	新华保险	3,724	164,898.72	0.05
242	000708	中信特钢	9,100	155,519.00	0.05
243	601377	兴业证券	21,326	146,083.10	0.04
244	601788	光大证券	8,808	141,456.48	0.04
245	600482	中国动力	9,000	141,300.00	0.04
246	600383	金地集团	10,230	140,151.00	0.04
247	002468	申通快递	8,400	137,844.00	0.04
248	300033	同花顺	1,000	133,080.00	0.04
249	601901	方正证券	18,300	129,564.00	0.04
250	002736	国信证券	11,000	124,300.00	0.04
251	600109	国金证券	10,802	123,250.82	0.04
252	600299	安迪苏	9,800	119,756.00	0.04
253	601555	东吴证券	14,481	118,164.96	0.04
254	600340	华夏幸福	5,161	117,980.46	0.04
255	601108	财通证券	11,400	116,850.00	0.03
256	000783	长江证券	17,242	116,211.08	0.03
257	000069	华侨城 A	18,887	114,455.22	0.03
258	600372	中航电子	7,676	102,244.32	0.03
259	603260	合盛硅业	3,640	99,517.60	0.03
260	601212	白银有色	38,700	98,685.00	0.03
261	600061	国投资本	7,600	96,748.00	0.03
262	600606	绿地控股	15,600	96,408.00	0.03
263	600926	杭州银行	10,700	95,444.00	0.03
264	601162	天风证券	15,650	94,839.00	0.03
265	600705	中航资本	23,438	92,814.48	0.03
266	601066	中信建投	2,300	90,574.00	0.03

267	000656	金科股份	9,700	79,152.00	0.02
268	601838	成都银行	9,700	77,212.00	0.02
269	000728	国元证券	8,988	75,499.20	0.02
270	601997	贵阳银行	10,200	73,032.00	0.02
271	600390	五矿资本	10,180	71,870.80	0.02
272	601998	中信银行	13,809	71,116.35	0.02
273	000961	中南建设	7,700	68,530.00	0.02
274	002673	西部证券	8,380	68,380.80	0.02
275	601198	东兴证券	6,200	67,580.00	0.02
276	601881	中国银河	5,700	65,379.00	0.02
277	601319	中国人保	9,600	61,824.00	0.02
278	600208	新湖中宝	20,333	60,592.34	0.02
279	601878	浙商证券	5,900	58,469.00	0.02
280	002146	荣盛发展	7,196	58,287.60	0.02
281	601828	美凯龙	5,500	58,245.00	0.02
282	600848	上海临港	2,700	57,969.00	0.02
283	600369	西南证券	12,558	57,641.22	0.02
284	601658	邮储银行	12,200	55,754.00	0.02
285	601298	青岛港	9,800	55,664.00	0.02
286	002958	青农商行	12,400	54,932.00	0.02
287	002939	长城证券	4,300	52,976.00	0.02
288	000671	阳光城	7,300	46,282.00	0.01
289	000627	天茂集团	8,800	45,848.00	0.01
290	601916	浙商银行	9,700	38,218.00	0.01
291	601577	长沙银行	4,500	35,730.00	0.01
292	601236	红塔证券	1,800	34,920.00	0.01
293	600928	西安银行	5,900	31,034.00	0.01
294	601077	渝农商行	5,200	24,544.00	0.01
295	002945	华林证券	1,200	16,572.00	0.00

### 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	688026	洁特生物	4,433	369,357.56	0.11
2	688558	国盛智科	8,488	299,286.88	0.09
3	688520	神州细胞	5,077	298,629.14	0.09
4	688228	开普云	2,718	198,957.60	0.06
5	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.05
6	688377	迪威尔	6,822	112,017.24	0.03
7	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.03
8	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
9	688528	秦川物联	7,711	87,365.63	0.03
10	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
11	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
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	600050	中国联通	9,415,292.94	2.75
2	600519	贵州茅台	9,390,618.00	2.75
3	000063	中兴通讯	8,704,292.00	2.54
4	600900	长江电力	7,154,333.75	2.09
5	600276	恒瑞医药	7,097,407.20	2.07
6	300136	信维通信	6,579,059.41	1.92
7	601138	工业富联	6,431,844.00	1.88
8	000333	美的集团	5,622,208.21	1.64
9	000651	格力电器	5,254,862.00	1.54
10	000858	五粮液	4,744,823.79	1.39
11	600487	亨通光电	4,395,817.20	1.29
12	600522	中天科技	4,179,387.02	1.22
13	600585	海螺水泥	4,142,975.62	1.21
14	600498	烽火通信	3,864,053.00	1.13
15	600886	国投电力	3,448,224.20	1.01
16	600887	伊利股份	3,364,377.00	0.98
17	600745	闻泰科技	3,325,651.00	0.97
18	600795	国电电力	3,188,504.00	0.93
19	601985	中国核电	3,150,566.00	0.92
20	600011	华能国际	2,953,178.00	0.86

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	000063	中兴通讯	12,196,705.53	3.57
2	600050	中国联通	11,014,524.27	3.22
3	600585	海螺水泥	8,326,935.00	2.43
4	300136	信维通信	7,936,914.80	2.32
5	002475	立讯精密	7,770,586.54	2.27
6	600900	长江电力	6,501,618.54	1.90
7	002415	海康威视	6,452,971.74	1.89
8	600309	万华化学	6,417,191.69	1.88

9	601138	工业富联	6,235,108.00	1.82
10	600498	烽火通信	5,772,385.00	1.69
11	600522	中天科技	5,735,784.00	1.68
12	600519	贵州茅台	5,683,647.00	1.66
13	600487	亨通光电	5,513,526.90	1.61
14	600570	恒生电子	5,404,090.73	1.58
15	600276	恒瑞医药	5,102,737.40	1.49
16	000725	京东方A	5,092,377.00	1.49
17	601899	紫金矿业	4,609,790.00	1.35
18	688111	金山办公	3,926,131.80	1.15
19	600019	宝钢股份	3,878,206.97	1.13
20	600886	国投电力	3,580,405.00	1.05

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	271,882,149.15
卖出股票收入（成交）总额	310,445,058.67

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	1,987,993.50	0.59
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,987,993.50	0.59

## 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	019627	20 国债 01	19,870	1,987,993.50	0.59

## 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	36,075.83
2	应收证券清算款	3,443,798.87
3	应收股利	-
4	应收利息	22,762.09
5	应收申购款	384,271.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,886,908.01

#### 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	688026	洁特生物	369,357.56	0.11	新股流通受限
2	688558	国盛智科	299,286.88	0.09	新股流通受限
3	688520	神州细胞	298,629.14	0.09	新股流通受限
4	688228	开普云	198,957.60	0.06	新股流通受限
5	688568	中科星图	178,634.20	0.05	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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
4,534	40,591.83	129,119,993.95	70.16	54,923,353.87	29.84

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研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 (2013 年 11 月 06 日) 基金份额总额	274,994,745.19
本报告期期初基金份额总额	211,022,093.66
本报告期基金总申购份额	35,328,379.11
减：本报告期基金总赎回份额	62,307,124.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	184,043,347.82

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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例 (%)		比例 (%)	
东方 证券	3	149,321,770.92	25.86	138,123.80	25.89	
中金 公司	2	75,987,825.38	13.16	70,670.83	13.24	
信达 证券	1	73,707,214.64	12.76	67,170.48	12.59	
国信 证券	2	61,347,900.34	10.62	57,133.32	10.71	
长江 证券	1	54,238,271.60	9.39	50,509.56	9.47	
中信 证券	2	50,023,353.63	8.66	45,586.53	8.54	
东吴 证券	1	21,464,814.21	3.72	19,990.13	3.75	
东兴 证券	1	20,394,745.03	3.53	18,585.97	3.48	
瑞银 证券	2	17,622,933.95	3.05	16,412.11	3.08	
中泰 证券	1	16,703,558.65	2.89	15,221.98	2.85	
华泰 证券	2	14,466,173.64	2.50	13,472.10	2.52	
海通 证券	1	9,861,055.94	1.71	9,183.71	1.72	
申万 宏源 证券	1	5,068,099.85	0.88	4,720.11	0.88	

兴业 证券	1	4,797,399.24	0.83	4,467.64	0.84	
中信 建投 证券	1	2,312,544.58	0.40	2,153.73	0.40	
国海 证券	2	149,196.79	0.03	138.94	0.03	
国泰 君安	1	31,765.00	0.01	28.95	0.01	
长城 证券	2	-	-	-	-	
东北 证券	2	-	-	-	-	
广发 证券	1	-	-	-	-	
恒泰 证券	2	-	-	-	-	
华西 证券	1	-	-	-	-	
平安 证券	1	-	-	-	-	
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	
银河 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	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	504,400.00	12.59	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,008,400.00	25.16	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	1,170,382.80	29.20	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	1,324,719.90	33.05	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
太平洋 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 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
2	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
3	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
4	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
5	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
6	汇添富基金管理股份有限公司关于根据《公开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	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 14 日
7	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
8	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
9	汇添富基金管理股份有限公司关于	上证报, 公司网站	2020 年 05 月 16 日

	调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告		
10	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告	证券时报, 公司网站	2020 年 06 月 04 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	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	152,645,529.99	-	24,281,718.00	128,363,811.99	69.75

**产品特有风险****1、持有人大会投票权集中的风险**

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

**2、巨额赎回的风险**

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

**3、基金规模较小导致的风险**

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

**4、基金净值大幅波动的风险**

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

**5、提前终止基金合同的风险**

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

**11.2 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

**§ 12 备查文件目录****12.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼 汇添富基金管理股份有限公司

## 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](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