

# 中证长三角一体化发展主题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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	6
§ 4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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 .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注 .....	18
§ 7 投资组合报告 .....	50
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68
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.....	68
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.....	68
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.....	68
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.....	68
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
7.12 投资组合报告附注.....	69
§ 8 基金份额持有人信息 .....	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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.....	72
§ 9 开放式基金份额变动 .....	72
§ 10 重大事件揭示 .....	73
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
10.8 其他重大事件.....	75
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
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.....	77

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§ 12 备查文件目录 .....	78
12.1 备查文件目录.....	79
12.2 存放地点 .....	79
12.3 查阅方式 .....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证长三角ETF
场内简称	长三角
基金主代码	512650
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年07月26日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	2,920,941,627.00
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	2019年10月25日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即中证长三角一体化发展主题指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
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	95528
传真	021-28932998	021-63602540
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	上海市中山东一路12号
办公地址	上海市富城路99号震旦国际大楼	上海市北京东路689号

	20楼	
邮政编码	200120	200001
法定代表人	李文	郑杨

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日 - 2020年06月30日)
本期已实现收益	51,447,970.34
本期利润	70,456,311.79
加权平均基金份额本期利润	0.0180
本期加权平均净值利润率	1.84%
本期基金份额净值增长率	3.37%
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	-25,461,416.58
期末可供分配基金份额利润	-0.0087
期末基金资产净值	3,078,611,325.95
期末基金份额净值	1.0540
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	5.40%

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。

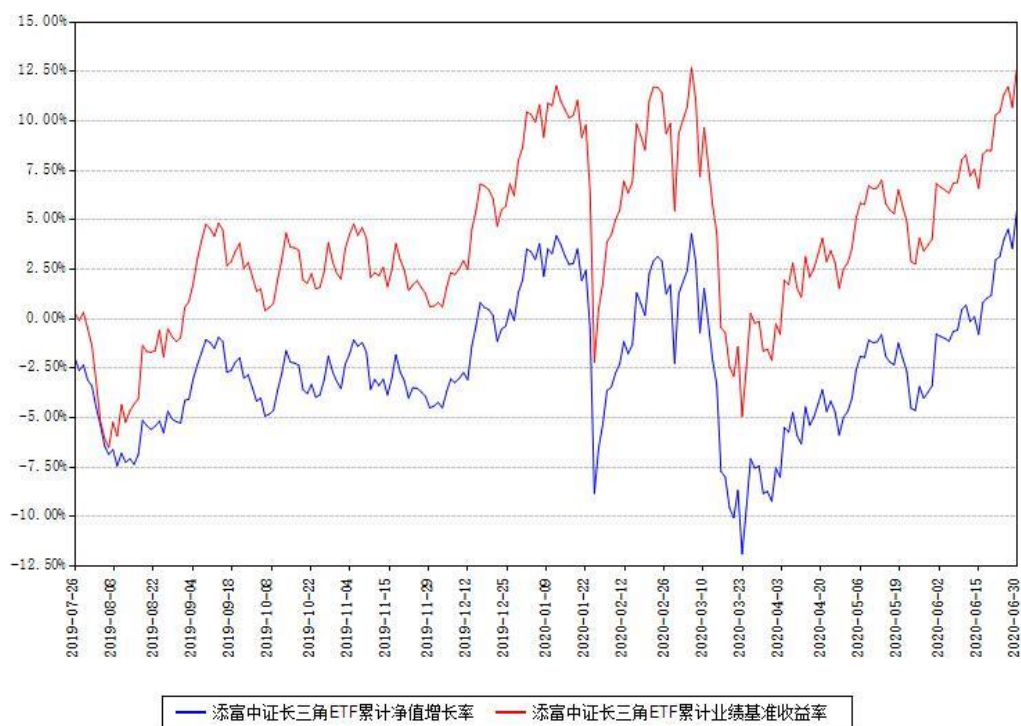
### 3.2 基金净值表现

### 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	9.09%	0.95%	8.27%	0.96%	0.82%	-0.01%
过去三个月	15.46%	0.98%	14.38%	0.99%	1.08%	-0.01%
过去六个月	3.37%	1.59%	3.66%	1.61%	-0.29%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	5.40%	1.26%	12.63%	1.32%	-7.23%	-0.06%

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

添富中证长三角ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：1、本《基金合同》生效之日为2019年07月26日，截至本报告期末，基金成立未满一年。

2、本基金建仓期为自《基金合同》生效之日起6个月，截止本报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理、指数与量化投资部副总监	2019年07月26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



					<p>究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 5 日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金的基金经理，2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300ETF 基金联接基金的基金经理，2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费 ETF 基金、中证医药卫生 ETF 基金、中证能源 ETF 基金、中证金融地产 ETF 基金的基金经理，2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中指数基金的基金经理，2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015 年 3 月 24 日至今任</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>汇添富主要消费 ETF 联接基金的基金经理，2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理，2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企 ETF 的基金经理，2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗指数 (LOF) 的基金经理，2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数 (LOF) 的基金经理，2018 年 3 月 23 日至今任添富价值多因子股票的基金经理，2019 年 7 月 26 日至今任添富中证长三角 ETF 的基金经理，2019 年 9 月 24 日至今任汇添富中证长三角 ETF 联接的基金经理，2019 年 11 月 6 日任添富中证国企一带一路 ETF 的基金经理，2020 年 3 月 5 日任添富中证国企一带一路 ETF 联接基金的基金经理。</p>
乐无穹	本基金的基金经理	2019 年 07 月 26 日		6	<p>国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：</p>

					2014年7月加入汇添富基金管理有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分分析师。2019年4月15日至今任添富中证银行ETF联接的基金经理，2019年7月26日至今任添富中证长三角ETF的基金经理，2019年10月8日至今任添富中证800ETF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

年初新冠病毒爆发的影响在全球仍在持续,各国在防控和复工之间进行不同的政策权衡,疫情反复也对经济复苏形成一定扰动。疫情影响下,美国、日本、欧洲等都已启动多项政策工具为市场注入流动性,各地央行均显著扩表,全球进入全面的流动性宽松态势,多地资本市场表现出疫情恐慌后的反弹行情。

国内来看,疫情防控启动早、控制效果较好,为复工复产奠定了坚实的基础。目前复工复产进度显著快于其他受影响国家,二季度以来国内经济数据显示出持续改善,5月PMI录得50.6,PMI在2月见底后快速回升并持续3个月在荣枯线上方,工业增加值同比增长4.4%,社会消费品零售总额同比下降2.8%,固定资产投资1-5月累计同比下降6.3%,总体符合预期,降幅自3月以来均持续收窄。基建投资增速恢复,房地产销售改善支撑投资端的韧性,汽车生产和销售都有明显改善。5-6月尽管疫情在国内少数区域有所反复,引起一定担忧,但并未影响经济整体复苏趋势。

政策面来看,基调以稳为主。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,风险偏好有望提升。以北上资金为代表的外资亦在持续加大对A股的配置。

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。

“长江三角洲区域一体化发展”是国家级区域发展战略,是区域间融合互补的重要举措之一。6月5日,2020年度长三角地区主要领导座谈会在浙江湖州举行,会议总结了过去一年的工作成效,审定了未来的重点工作计划和合作事项,将确保长三角区域一体化战略稳步实施推进,激发区域经济活力。长三角ETF是投资于长三角区域龙头上市企业的指数产品,能够帮助投资者把握区域发展带来的主题投资机遇。

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。股票投资仓位报告期内基本保持在95%~100%之间,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3.37%。同期业绩比较基准收益率为3.66%。

#### 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。

从结构的视角,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。

长三角区域是中国最重要的经济区域，长三角一体化发展主题指数优选区域内上市公司，并结合基本面加权的方式优化了指数结构，长三角ETF跟踪长三角一体化发展主题指数，旨在为投资者提供分享长三角企业发展红利的二级市场交易工具。长三角ETF遵循被动投资的运作方法，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：本基金收益分配采用现金分红；《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本报告期内，由汇添富基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：中证长三角一体化发展主题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	129,878,024.00	111,806,072.63
结算备付金		31,023,469.58	29,844,701.24
存出保证金		16,476,454.05	14,063,992.42
交易性金融资产	6.4.7.2	2,911,243,064.75	4,637,742,323.52
其中：股票投资		2,911,243,064.75	4,637,411,323.52
基金投资		-	-

债券投资		-	331,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,263,353.11	9,215,186.46
应收利息	6.4.7.5	169,898.39	74,804.67
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,095,054,263.88	4,802,747,080.94
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		14,243,959.59	22,317,176.45
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		414,095.89	633,278.35
应付托管费		138,031.96	211,092.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,247,451.50	2,233,532.15
应交税费		34,573.42	136,262.43
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	364,825.57	585,217.23
负债合计		16,442,937.93	26,116,559.41
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,920,941,627.00	4,684,941,627.00
未分配利润	6.4.7.1 0	157,669,698.95	91,688,894.53
所有者权益合计		3,078,611,325.95	4,776,630,521.53
负债和所有者权益总计		3,095,054,263.88	4,802,747,080.94

注：1、报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0540 元，基金份额总额 2,920,941,627.00 份。

2、本基金合同生效日为 2019 年 07 月 26 日，上年度实际可比期间为 2019 年 07 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日，特此说明。



## 6.2 利润表

会计主体：中证长三角一体化发展主题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
<b>一、收入</b>		<b>80,000,039.03</b>
1. 利息收入		932,528.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	928,414.09
债券利息收入		1,052.33
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借收入		3,062.41
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		58,909,625.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	24,818,472.02
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	1,601,553.77
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	1,028,970.87
股利收益	6.4.7.17	31,460,629.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	19,008,341.45
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	1,149,542.82
<b>减：二、费用</b>		<b>9,543,727.24</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,862,065.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	954,021.70
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	5,048,338.90
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3,707.53
7. 其他费用	6.4.7.21	675,593.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>70,456,311.79</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>70,456,311.79</b>

注：本基金合同于2019年07月26日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中证长三角一体化发展主题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）	4,684,941,627.00	91,688,894.53	4,776,630,521.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,456,311.79	70,456,311.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,764,000,000.00	-4,475,507.37	-1,768,475,507.37
其中：1. 基金申购款	22,000,000.00	-272,988.29	21,727,011.71
2. 基金赎回款	-1,786,000,000.00	-4,202,519.08	-1,790,202,519.08
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）	2,920,941,627.00	157,669,698.95	3,078,611,325.95

注：本基金合同于2019年07月26日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

财务报表由下列负责人签署：

张晖

李骁

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]779号《关于准

予中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予募集注册，由汇添富基金管理股份有限公司于2019年5月20日至2019年7月19日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第60466941\_A01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年7月26日正式生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币6,428,667,127.00元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币274,500.00元，以上实收基金（本息）合计为人民币6,428,941,627.00元，折合6,428,941,627.00份基金份额。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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，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长三角一体化发展主题指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2020年06月30

日的财务状况以及2020年01月01日至2020年06月30日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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	129,878,024.00
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	129,878,024.00

##### 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	2,638,136,301.36	2,911,243,064.75	273,106,763.39
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	2,638,136,301.36	2,911,243,064.75	273,106,763.39

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	152,883,240.00	-	-	-
（股指期货投资）	152,883,240.00			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	152,883,240.00	-	-	-

注：本报告期末2020年6月30日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量（买/卖）	合约名义金额	合约市值	公允价值变动
IF2007	129	152,883,240.00	159,366,600.00	6,483,360.00
总额合计：		6,483,360.00		
减：可抵销期货暂收款		6,483,360.00		
股指期货投资净额：			0.00	

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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	26,722.33
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	142,933.16
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	-
其他	242.90
合计	169,898.39

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	1,247,451.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,247,451.50

#### 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	265,371.67
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
其他	-
合计	364,825.57

#### 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	4,684,941,627.00	4,684,941,627.00
本期申购	22,000,000.00	22,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,786,000,000.00	-1,786,000,000.00
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	2,920,941,627.00	2,920,941,627.00

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	-122,121,847.80	213,810,742.33	91,688,894.53
本期利润	51,447,970.34	19,008,341.45	70,456,311.79
本期基金份额交易产生的变动数	45,212,460.88	-49,687,968.25	-4,475,507.37
其中：基金申购款	-654,416.10	381,427.81	-272,988.29
基金赎回款	45,866,876.98	-50,069,396.06	-4,202,519.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-25,461,416.58	183,131,115.53	157,669,698.95

#### 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	612,277.88
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	308,929.48
其他	7,206.73
合计	928,414.09

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	-11,803,282.26
股票投资收益——赎回差价收入	36,621,754.28
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	24,818,472.02

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	1,930,883,126.89
减：卖出股票成本总额	1,942,686,409.15
买卖股票差价收入	-11,803,282.26

#### 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	1,790,202,519.08
减：现金支付赎回款总额	640,034,322.08
减：赎回股票成本总额	1,113,546,442.72
赎回差价收入	36,621,754.28

#### 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

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	6,268,046.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,665,400.00
减：应收利息总额	1,092.42
买卖债券差价收入	1,601,553.77

##### 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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入应缴纳增值税	-
买卖权证差价收入	-
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	1,028,970.87
外汇期货投资收益	-
外汇远期投资收益	-

## 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	31,460,629.27
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	31,460,629.27

## 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	15,696,701.45
——股票投资	15,696,701.45
——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	3,311,640.00
——权证投资	-
——期货投资	3,311,640.00
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	19,008,341.45

## 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	1,149,542.82
其他	-
合计	1,149,542.82

#### 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	5,048,338.90
银行间市场交易费用	-
合计	5,048,338.90

#### 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	3,727.11
指数使用费	572,412.97
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	675,593.98

#### 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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	2,590,819,978.55	80.42

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	6,268,046.19	100.00

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	2,397,104.83	86.14	1,008,542.84	80.85

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

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,862,065.13
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基

金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	954,021.70

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	4,632,200.00	3,062.41	-	-

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

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

出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金除管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行	129,878,024.00	612,277.88

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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



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
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
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
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
688222	成都先导	2020年04月03日	2020年10月16日	新股流通受限	20.52	43.70	9,201	188,804.52	402,083.70

		日	日	限						
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	
688169	石头科技	2020年02月13日	2020年08月21日	新股流通受限	271.12	365.14	5,382	1,459,167.84	1,965,183.48	
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	
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	
300846	首都在线	2020年06月	2020年07月	新股流通	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	

		22 日	01 日	受 限						
688106	金宏气体	2020年06月09日	2020年12月16日	新股流通受限	15.48	41.36	26,075	403,641.00	1,078,462.00	
688568	中科星图	2020年06月30日	2020年07月08日	新股流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	
300845	捷安高科	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	

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

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 202 0年 06 月 30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	129,878,024.00	-	-	-	-	-	129,878,024.00
结 算 备 付 金	31,023,469.58	-	-	-	-	-	31,023,469.58
存 出 保 证 金	539,794.05	-	-	-	-	15,936,660.00	16,476,454.05
交 易 性 金	-	-	-	-	-	2,911,243,064.75	2,911,243,064.75

融 资 产							
应 收 股 利	-	-	-	-	-	-	-
应 收 利 息	-	-	-	-	-	169,898.39	169,898.39
应 收 申 购 款	-	-	-	-	-	-	-
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
应 收 证 券 清 算 款	-	-	-	-	-	6,263,353.11	6,263,353.11

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	161,441,287.63	-	-	-	-	2,933,612,976.25	3,095,054,263.88
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报	-	-	-	-	-	414,095.89	414,095.89



酬							
应付 托管 管 费	-	-	-	-	-	138,031.96	138,031.96
应付 证 券 清 算 款	-	-	-	-	-	14,243,959.59	14,243,959.59
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	-	-	1,247,451.50	1,247,451.50
应交税费	-	-	-	-	-	34,573.42	34,573.42
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	364,825.57	364,825.57
负债总计	-	-	-	-	-	16,442,937.93	16,442,937.93
利率敏感	161,441,287.63	-	-	-	-	2,917,170,038.32	3,078,611,325.95

感 度 缺 口							
上 年 度 末 201 9年 12 月 31 日	1个月以内	1- 3 个 月	3个月-1年	1- 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资 产	-	-	-	-	-	-	-
银 行 存 款	111,806,072.63	-	-	-	-	-	111,806,072.63
结 算 备 付 金	29,844,701.24	-	-	-	-	-	29,844,701.24
存 出 保 证	14,063,992.42	-	-	-	-	-	14,063,992.42

金							
交易性金融资产	-	-	331,000.00	-	-	4,637,411,323.52	4,637,742,323.52
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	74,804.67	74,804.67
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收	-	-	-	-	-	9,215,186.46	9,215,186.46

证 券 清 算 款							
买 入 返 售 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
其 他 资 产	-	-	-	-	-	-	-
资 产 总 计	155,714,766.2 9	-	331,000.0 0	-	-	4,646,701,314.6 5	4,802,747,080.9 4
负 债							
应 付 赎 回 款	-	-	-	-	-	-	-
应	-	-	-	-	-	633,278.35	633,278.35

付 管 理 人 报 酬							
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	211,092.80	211,092.80
应 付 证 券 清 算 款	-	-	-	-	-	22,317,176.45	22,317,176.45
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	-	-	-	-	-	-	-
应 付	-	-	-	-	-	-	-

销 售 服 务 费							
应 付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	2,233,532.15	2,233,532.15
应 交 税 费	-	-	-	-	-	136,262.43	136,262.43
应 付 利 息	-	-	-	-	-	-	-
应 付 利 润	-	-	-	-	-	-	-
其 他 负 债	-	-	-	-	-	585,217.23	585,217.23
负 债	-	-	-	-	-	26,116,559.41	26,116,559.41

总 计							
利 率 敏 感 度 缺 口	155,714,766.2 9	-	331,000.0 0	-	-	4,620,584,755.2 4	4,776,630,521.5 3

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

注:本基金所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位:人民币元

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



	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,911,243,0	94.56	4,637,411,3	97.09
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	331,000.00	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,911,243,0	94.56	4,637,742,3	97.09

注：基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。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
		—	—

注:于2020年6月30日,本基金成立未满一年,无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,911,243.06	94.06
		4.75	
	其中:股票	2,911,243.06	94.06
		4.75	
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	160,901,493.	5.20
		58	
8	其他资产	22,909,705.5	0.74
		5	
9	合计	3,095,054,26	100.00
		3.88	

### 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	1,992,518.00	0.06
B	采矿业	1,707,568.00	0.06
C	制造业	1,255,389,512.90	40.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,044,483.00	0.52
E	建筑业	9,429,349.00	0.31
F	批发和零售业	71,642,790.00	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	101,831,076.46	3.31
H	住宿和餐饮业	3,712,950.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	337,321,747.84	10.96
J	金融业	825,734,108.84	26.82
K	房地产业	74,046,269.80	2.41
L	租赁和商务服务业	32,256,064.82	1.05
M	科学研究和技术服务业	55,492,063.20	1.80
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	12,776,100.00	0.41
Q	卫生和社会工作	91,729,468.72	2.98
R	文化、体育和娱乐业	15,973,740.50	0.52
S	综合	-	-
	合计	2,907,079,811.08	94.43

## 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	3,557,671.88	0.12
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	190,731.77	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	402,083.70	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,163,253.67	0.14

### 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	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产
----	------	-----	-------	---------	-------

		称			净值比例 (%)
1	600276	恒瑞医药	1,728,646	159,554,025.80	5.18
2	601601	中国太保	3,615,646	98,526,353.50	3.20
3	300059	东方财富	4,751,366	95,977,593.20	3.12
4	600585	海螺水泥	1,790,300	94,724,773.00	3.08
5	600000	浦发银行	8,505,856	89,991,956.48	2.92
6	002142	宁波银行	3,067,749	80,589,766.23	2.62
7	601328	交通银行	15,021,400	77,059,782.00	2.50
8	002415	海康威视	2,461,068	74,693,413.80	2.43
9	601229	上海银行	7,457,300	61,895,590.00	2.01
10	600570	恒生电子	548,847	59,110,821.90	1.92
11	002463	沪电股份	2,233,900	55,802,822.00	1.81
12	002555	三七互娱	1,186,400	55,523,520.00	1.80
13	603259	药明康德	574,452	55,492,063.20	1.80
14	601688	华泰证	2,803,000	52,696,400.00	1.71

		券			
15	601009	南京银行	7,167,100	52,534,843.00	1.71
16	600919	江苏银行	8,415,459	47,715,652.53	1.55
17	300347	泰格医药	455,184	46,374,145.92	1.51
18	002304	洋河股份	378,728	39,819,461.92	1.29
19	600406	国电南瑞	1,845,700	37,375,425.00	1.21
20	300033	同花顺	267,900	35,652,132.00	1.16
21	600009	上海机场	476,478	34,339,769.46	1.12
22	600837	海通证券	2,381,000	29,952,980.00	0.97
23	002602	世纪华通	1,952,394	29,891,152.14	0.97
24	000963	华东医药	1,168,500	29,563,050.00	0.96
25	002001	新和成	1,005,300	29,254,230.00	0.95
26	002019	亿帆医药	1,260,300	28,949,091.00	0.94
27	600763	通策医疗	169,400	28,250,838.00	0.92
28	002127	南极电商	1,317,046	27,881,863.82	0.91
29	300088	长信科	2,429,800	27,213,760.00	0.88

		技			
30	002624	完美世 界	445,000	25,649,800.00	0.83
31	002050	三花智 控	1,152,450	25,238,655.00	0.82
32	002230	科大讯 飞	665,400	24,905,922.00	0.81
33	601211	国泰君 安	1,340,500	23,137,030.00	0.75
34	600196	复星医 药	680,500	23,034,925.00	0.75
35	600486	扬农化 工	273,400	22,555,500.00	0.73
36	601100	恒立液 压	276,501	22,175,380.20	0.72
37	300558	贝达药 业	152,916	21,405,181.68	0.70
38	600352	浙江龙 盛	1,653,500	21,148,265.00	0.69
39	002236	大华股 份	1,083,700	20,817,877.00	0.68
40	601155	新城控 股	664,300	20,752,732.00	0.67
41	002493	荣盛石 化	1,612,900	19,838,670.00	0.64
42	002384	东山精 密	631,000	18,898,450.00	0.61
43	600104	上汽集 团	1,106,801	18,804,548.99	0.61

44	601877	正泰电 器	686,500	18,089,275.00	0.59
45	002223	鱼跃医 疗	484,300	17,628,520.00	0.57
46	002273	水晶光 电	1,017,500	17,439,950.00	0.57
47	600521	华海药 业	513,630	17,427,465.90	0.57
48	603501	韦尔股 份	85,900	17,347,505.00	0.56
49	300253	卫宁健 康	755,770	17,337,363.80	0.56
50	600177	雅戈尔	2,891,700	17,234,532.00	0.56
51	002120	韵达股 份	690,700	16,887,615.00	0.55
52	603899	晨光文 具	292,700	15,981,420.00	0.52
53	600584	长电科 技	507,000	15,853,890.00	0.51
54	600926	杭州银 行	1,731,100	15,441,412.00	0.50
55	601128	常熟银 行	2,054,700	15,430,797.00	0.50
56	300595	欧普康 视	215,450	14,939,303.00	0.49
57	300782	卓胜微	36,542	14,827,647.34	0.48
58	600845	宝信软 件	244,800	14,462,784.00	0.47
59	600019	宝钢股	3,081,700	14,052,552.00	0.46



		份			
60	000961	中南建设	1,554,000	13,830,600.00	0.45
61	300144	宋城演艺	782,385	13,535,260.50	0.44
62	600522	中天科技	1,167,800	13,371,310.00	0.43
63	601799	星宇股份	105,126	13,351,002.00	0.43
64	600741	华域汽车	632,600	13,151,754.00	0.43
65	300357	我武生物	207,000	12,885,750.00	0.42
66	002607	中公教育	460,400	12,776,100.00	0.41
67	603799	华友钴业	306,400	11,906,704.00	0.39
68	000425	徐工机械	1,994,700	11,788,677.00	0.38
69	601607	上海医药	615,800	11,318,404.00	0.37
70	000739	普洛药业	481,200	11,207,148.00	0.36
71	002044	美年健康	773,960	11,152,763.60	0.36
72	600606	绿地控股	1,785,800	11,036,244.00	0.36
73	002075	沙钢股份	877,000	10,962,500.00	0.36

74	002024	苏宁易购	1,232,200	10,806,394.00	0.35
75	601990	南京证券	716,660	10,226,738.20	0.33
76	300009	安科生物	566,630	10,142,677.00	0.33
77	600958	东方证券	1,054,000	10,002,460.00	0.32
78	601788	光大证券	602,800	9,680,968.00	0.31
79	603816	顾家家居	214,100	9,636,641.00	0.31
80	600176	中国巨石	1,045,000	9,561,750.00	0.31
81	002508	老板电器	300,912	9,361,372.32	0.30
82	000596	古井贡酒	60,000	9,014,400.00	0.29
83	600667	太极实业	755,300	8,927,646.00	0.29
84	601108	财通证券	858,800	8,802,700.00	0.29
85	600487	亨通光电	524,700	8,610,327.00	0.28
86	600115	东方航空	1,998,900	8,435,358.00	0.27
87	002252	上海莱士	996,600	8,431,236.00	0.27
88	002080	中材科	542,700	8,411,850.00	0.27

		技			
89	601231	环旭电 子	368,700	8,052,408.00	0.26
90	300017	网宿科 技	945,500	8,027,295.00	0.26
91	600637	东方明 珠	828,300	7,993,095.00	0.26
92	002032	苏泊 尔	111,500	7,916,500.00	0.26
93	600895	张江高 科	387,500	7,893,375.00	0.26
94	603707	健友股 份	122,100	7,883,997.00	0.26
95	601872	招商轮 船	1,333,000	7,771,390.00	0.25
96	002156	通富微 电	298,800	7,484,940.00	0.24
97	002387	维信诺	510,300	7,287,084.00	0.24
98	601555	东吴证 券	891,490	7,274,558.40	0.24
99	603659	璞泰来	69,100	7,118,682.00	0.23
100	600315	上海家 化	148,400	7,108,360.00	0.23
101	600642	申能股 份	1,174,100	6,938,931.00	0.23
102	600018	上港集 团	1,637,500	6,877,500.00	0.22
103	600655	豫园股 份	749,600	6,641,456.00	0.22

104	600699	均胜电 子	273,500	6,512,035.00	0.21
105	600848	上海临 港	296,100	6,357,267.00	0.21
106	601878	浙商证 券	636,900	6,311,679.00	0.21
107	603605	珀莱雅	35,000	6,300,700.00	0.20
108	601018	宁波港	1,762,600	6,292,482.00	0.20
109	601727	上海电 气	1,242,500	6,262,200.00	0.20
110	600061	国投资 本	488,100	6,213,513.00	0.20
111	601689	拓普集 团	221,000	6,165,900.00	0.20
112	601233	桐昆股 份	472,443	6,028,372.68	0.20
113	300226	上海钢 联	76,480	6,011,328.00	0.20
114	300244	迪安诊 断	168,604	5,951,721.20	0.19
115	600023	浙能电 力	1,539,200	5,402,592.00	0.18
116	600901	江苏租 赁	1,011,400	5,269,394.00	0.17
117	603806	福斯特	105,251	5,253,077.41	0.17
118	300168	万达信 息	236,700	5,223,969.00	0.17
119	600170	上海建 工	1,684,300	5,170,801.00	0.17

120	600460	士兰微	351,100	5,154,148.00	0.17
121	002195	二三四五	1,832,900	5,150,449.00	0.17
122	000728	国元证券	610,300	5,126,520.00	0.17
123	002468	申通快递	310,400	5,093,664.00	0.17
124	601860	紫金银行	1,203,200	5,089,536.00	0.17
125	601916	浙商银行	1,255,095	4,945,074.30	0.16
126	000581	威孚高科	238,600	4,934,248.00	0.16
127	600150	中国船舶	282,000	4,918,080.00	0.16
128	600026	中远海能	739,400	4,776,524.00	0.16
129	601021	春秋航空	135,000	4,757,400.00	0.15
130	300618	寒锐钴业	74,780	4,637,855.60	0.15
131	600663	陆家嘴	409,980	4,595,875.80	0.15
132	000630	铜陵有色	2,265,500	4,372,415.00	0.14
133	002048	宁波华翔	276,514	4,269,376.16	0.14
134	002081	金螳螂	541,800	4,258,548.00	0.14
135	600909	华安证	594,200	4,058,386.00	0.13

		券			
136	600572	康恩贝	731,000	4,020,500.00	0.13
137	002085	万丰奥威	620,400	4,020,192.00	0.13
138	600827	百联股份	277,900	4,015,655.00	0.13
139	600208	新湖中宝	1,346,400	4,012,272.00	0.13
140	600850	华东电脑	159,700	3,914,247.00	0.13
141	600754	锦江酒店	133,800	3,712,950.00	0.12
142	600021	上海电力	500,400	3,702,960.00	0.12
143	600597	光明乳业	248,700	3,695,682.00	0.12
144	600704	物产中大	862,300	3,630,283.00	0.12
145	600612	老凤祥	72,700	3,503,413.00	0.11
146	600398	海澜之家	601,200	3,498,984.00	0.11
147	600160	巨化股份	503,700	3,470,493.00	0.11
148	002625	光启技术	439,300	3,184,925.00	0.10
149	002203	海亮股份	347,700	3,042,375.00	0.10
150	600776	东方通信	193,900	2,925,951.00	0.10

151	002010	传化智 联	507,600	2,761,344.00	0.09
152	600688	上海石 化	737,700	2,567,196.00	0.08
153	000559	万向钱 潮	518,500	2,509,540.00	0.08
154	600823	世茂股 份	559,000	2,498,730.00	0.08
155	601928	凤凰传 媒	358,600	2,438,480.00	0.08
156	601866	中远海 发	1,271,600	2,339,744.00	0.08
157	600377	宁沪高 速	237,000	2,324,970.00	0.08
158	002091	江苏国 泰	372,800	2,255,440.00	0.07
159	000887	中鼎股 份	268,300	2,106,155.00	0.07
160	002244	滨江集 团	491,200	2,097,424.00	0.07
161	603515	欧普照 明	75,600	2,069,172.00	0.07
162	002563	森马服 饰	290,500	2,048,025.00	0.07
163	600420	现代制 药	207,200	1,995,336.00	0.06
164	300761	立华股 份	51,700	1,992,518.00	0.06
165	603786	科博达	26,086	1,965,580.10	0.06

166	603885	吉祥航空	212,600	1,934,660.00	0.06
167	002966	苏州银行	212,700	1,782,426.00	0.06
168	600985	淮北矿业	219,200	1,707,568.00	0.06
169	601828	美凯龙	152,300	1,612,857.00	0.05
170	603260	合盛硅业	57,900	1,582,986.00	0.05
171	600648	外高桥	111,600	1,578,024.00	0.05
172	600261	阳光照明	369,900	1,313,145.00	0.04
173	300768	迪普科技	23,600	1,092,444.00	0.04
174	600623	华谊集团	195,300	1,007,748.00	0.03
175	601512	中新集团	84,500	971,750.00	0.03
176	600981	汇鸿集团	303,800	953,932.00	0.03
177	600710	苏美达	202,800	880,152.00	0.03
178	603379	三美股份	32,400	695,628.00	0.02
179	603013	亚普股份	42,600	686,712.00	0.02
180	603997	继峰股份	50,300	345,561.00	0.01

### 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	688169	石头科技	5,382	1,965,183.48	0.06
2	688106	金宏气体	26,075	1,078,462.00	0.04
3	688222	成都先导	9,201	402,083.70	0.01
4	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
5	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
6	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
7	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
8	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
9	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
10	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
11	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
12	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
13	300847	中船汉	1,421	9,861.74	0.00

		光			
14	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
15	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
16	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
17	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	300059	东方财富	47,528,329.06	1.00
2	002142	宁波银行	43,299,326.43	0.91
3	601229	上海银行	34,721,754.57	0.73
4	002415	海康威视	32,320,966.98	0.68
5	601328	交通银行	32,053,141.44	0.67
6	601009	南京银行	27,440,710.55	0.57
7	601688	华泰证券	26,810,469.66	0.56
8	601100	恒立液压	24,655,627.71	0.52
9	002555	三七互娱	24,085,889.89	0.50
10	300088	长信科技	22,586,554.83	0.47
11	600837	海通证券	22,336,510.22	0.47
12	300033	同花顺	21,805,925.27	0.46
13	600570	恒生电子	21,582,160.22	0.45
14	600406	国电南瑞	21,549,574.47	0.45
15	002463	沪电股份	21,429,853.36	0.45
16	600919	江苏银行	21,130,865.57	0.44
17	002019	亿帆医药	20,243,475.04	0.42
18	002304	洋河股份	19,528,632.26	0.41
19	002273	水晶光电	19,287,965.33	0.40
20	000963	华东医药	19,234,480.69	0.40

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	600623	华谊集团	248,144,356.91	5.19
2	600126	杭钢股份	241,007,117.07	5.05
3	600023	浙能电力	221,722,426.32	4.64
4	600585	海螺水泥	72,463,305.51	1.52
5	002415	海康威视	58,039,999.81	1.22
6	002142	宁波银行	44,219,719.52	0.93
7	300059	东方财富	34,942,536.70	0.73
8	002463	沪电股份	34,588,916.99	0.72
9	002044	美年健康	33,851,891.40	0.71
10	002024	苏宁易购	31,944,369.29	0.67
11	600486	扬农化工	31,427,682.12	0.66
12	600837	海通证券	31,150,118.97	0.65
13	000425	徐工机械	28,932,240.82	0.61
14	600276	恒瑞医药	26,929,787.64	0.56
15	600009	上海机场	23,164,473.16	0.48
16	002555	三七互娱	22,353,992.44	0.47
17	300144	宋城演艺	22,029,802.71	0.46
18	002230	科大讯飞	21,937,172.04	0.46
19	002304	洋河股份	21,850,365.38	0.46
20	300347	泰格医药	21,343,493.85	0.45

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	1,301,228,652.45
卖出股票收入（成交）总额	1,930,883,126.89

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

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2007	IF2007	129	159,366,600.00	6,483,360.00	
公允价值变动总额合计					6,483,360.00
股指期货投资本期收益					1,028,970.87
股指期货投资本期公允价值变动					3,311,640.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

### 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	16,476,454.05
2	应收证券清算款	6,263,353.11
3	应收股利	-
4	应收利息	169,898.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,909,705.55

### 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	688169	石头科技	1,965,183.48	0.06	新股流通受限
2	688106	金宏气体	1,078,462.00	0.04	新股流通受限
3	688222	成都先导	402,083.70	0.01	新股流通受限
4	688568	中科星图	178,634.20	0.01	新股流通受限
5	688377	迪威尔	129,619.48	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		上海浦东发展银行股份有限公司—中证长三角一体化发展主题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 (%)

716	4,079,527. 41	2,733,060,127 .00	93.5 7	187,881,500 .00	6.43	252,000,000 .00	8.63
-----	------------------	----------------------	-----------	--------------------	------	--------------------	------

注:机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“上海浦东发展银行股份有限公司-中证长三角一体化发展主题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	浙江省能源集团有限公司	859,999,500.00	29.44
2	申能(集团)有限公司	497,366,939.00	17.03
3	宁波开发投资集团有限公司	352,354,426.00	12.06
4	汇添富基金-上海浦东发展银行股份有限公司广州分行-汇添富浦发银行5号单一资产	265,044,500.00	9.07
5	江苏高科技投资集团有限公司	262,859,500.00	9.00
6	汤奇青	184,686,000.00	6.32
7	上海国盛(集团)有限公司	86,803,000.00	2.97
8	南京钢铁股份有限公司-2015年度员工持股计划	86,180,400.00	2.95
9	富国基金-上海国盛	53,290,000.00	1.82

	(集团)有限公司-富 国基金光扬单一资 产管理计划		
10	紫金信托有限责任 公司-紫金信托·智 慧10号单一资金信 托	7,192,300.00	0.25
11	上海浦东发展银行 股份有限公司一中 证长三角一体化发 展主题交易型开放 式指数证券投资联 接基金	252,000,000.00	8.63

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年07月26日） 基金份额总额	6,428,941,627.00
本报告期期初基金份额总额	4,684,941,627.00



本报告期基金总申购份额	22,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,786,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,920,941,627.00

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	2,590,819,978.55	80.42	2,397,104.83	86.14	
中信证券	1	630,811,290.25	19.58	385,617.21	13.86	

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	6,268,046.19	100.00	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配。

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汇添富上海证券交易所跨市场ETF修改申购赎回业务规则并更新招募说明书的公告	中证报,上交所,公司网站	2020年01月18日
2	中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2020年1月20	中证报,上交所,公司网站	2020年01月20日

	日更新)		
3	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
4	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
5	中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2020 年 2 月 17 日更新)	中证报, 上交所, 公司网站	2020 年 02 月 17 日
6	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
7	中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2020 年 3 月 19 日更新)	中证报, 上交所, 公司网站	2020 年 03 月 19 日
8	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
9	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

10	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
11	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
12	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
13	中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2020年5月7日更新)	中证报, 上交所, 公司网站	2020年05月07日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况

投资者类	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	期初份额	申购	赎回	持有份额	份额占

别		金份额 比例达 到或者 超过 20%的 时间区 间	份额	份额		比 (%)	
机构	1	2020年 1月10 日至 2020年 6月30 日	859,999,500.00	-	-	859,999,500.00	29.44
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险</p> <p>当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证长三角一体化发展主题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、报告期内中证长三角一体化发展主题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