

汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证 券投资基金（LOF）2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 03 月 30 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。本年度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 2021 年 3 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。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
4.9 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	23
§ 5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	23
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	23
§ 6 审计报告	23
6.1 审计报告的基本信息	23
6.2 审计报告的基本内容	23
§ 7 年度财务报表	25
7.1 资产负债表	25
7.2 利润表	27
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	28
7.4 报表附注	29
§ 8 投资组合报告	72
8.1 期末基金资产组合情况	72
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	73
8.3 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	74

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	78
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
8.6 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.....	81
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	81
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	81
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	81
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
8.12 投资组合报告附注.....	82
§ 9 基金份额持有人信息	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	84
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
9.4 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.....	85
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	85
§ 10 开放式基金份额变动	85
§ 11 重大事件揭示	86
11.1 基金份额持有人大会决议.....	86
11.2 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.....	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	94
11.4 基金投资策略的改变.....	94
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	94
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	94
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	94
11.8 其他重大事件.....	98
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	100
12.1 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.....	100
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	101
§ 13 备查文件目录	101
13.1 备查文件目录.....	101
13.2 存放地点	102
13.3 查阅方式	102

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）	
基金主代码	501057	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 05 月 23 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）	2,760,879,098.08	
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	2018 年 06 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C
下属分级基金场内简称	新能源车	新能车 C
下属分级基金的交易代码	501057	501058
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	1,628,676,006.47	1,132,203,091.61

注：汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 的扩位证券简称为新能源车 LOF；汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 的扩位证券简称为新能源车 LOFC。

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	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融

	资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证新能源汽车产业指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
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，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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020年	2019年	2018年05月23日（基金合同生效日）-2018年12月31日
------------	-------	-------	----------------------------------

间 数 据 和 指 标						
	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) A	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) C	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) A	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) C	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) A	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) C
本期已实现收益	230,368,265 .49	156,869,574 .71	-11,611,25 5.45	-10,229,04 0.49	-6,999,866 .10	-5,185,499 .03
本期利润	1,080,946,3 59.16	728,737,414 .60	43,931,050 .05	19,011,345 .15	-53,242,25 7.96	-41,140,87 1.03
加权平均基金份额本期利润	1.2060	1.1687	0.2773	0.1094	-0.2297	-0.1990
本期加权平均净值利润率	87.04%	84.49%	32.04%	12.77%	-25.78%	-21.87%

本期基金份额净值增长率	107.25%	106.74%	34.24%	33.92%	-23.19%	-23.40%
3.1 .2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	175,198,854 .62	111,642,917 .47	-15,948,63 6.51	-10,501,62 1.11	-44,604,84 1.31	-33,064,44 1.97
期末可供分配基金份额利润	0.1076	0.0986	-0.1121	-0.1163	-0.2319	-0.2340
期末基金	3,480,525,5 03.92	2,401,100,2 90.62	146,680,48 7.96	92,659,828 .78	147,698,88 1.82	108,251,26 2.15

资产净值						
期末基金份额净值	2.1370	2.1207	1.0311	1.0258	0.7681	0.7660
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	113.70%	112.07%	3.11%	2.58%	-23.19%	-23.40%

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

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A						
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
过去三个月	48.22%	2.22%	48.91%	2.25%	-0.69%	-0.03%
过去六个月	73.58%	2.14%	69.73%	2.19%	3.85%	-0.05%
过去一年	107.25%	2.22%	102.30%	2.28%	4.95%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	113.70%	1.78%	65.83%	1.88%	47.87%	-0.10%
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C						
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
过去三个月	48.12%	2.21%	48.91%	2.25%	-0.79%	-0.04%
过去六个月	73.37%	2.14%	69.73%	2.19%	3.64%	-0.05%
过去一年	106.74%	2.22%	102.30%	2.28%	4.44%	-0.06%
自基金合同生效日起至今	112.07%	1.78%	65.83%	1.88%	46.24%	-0.10%

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

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

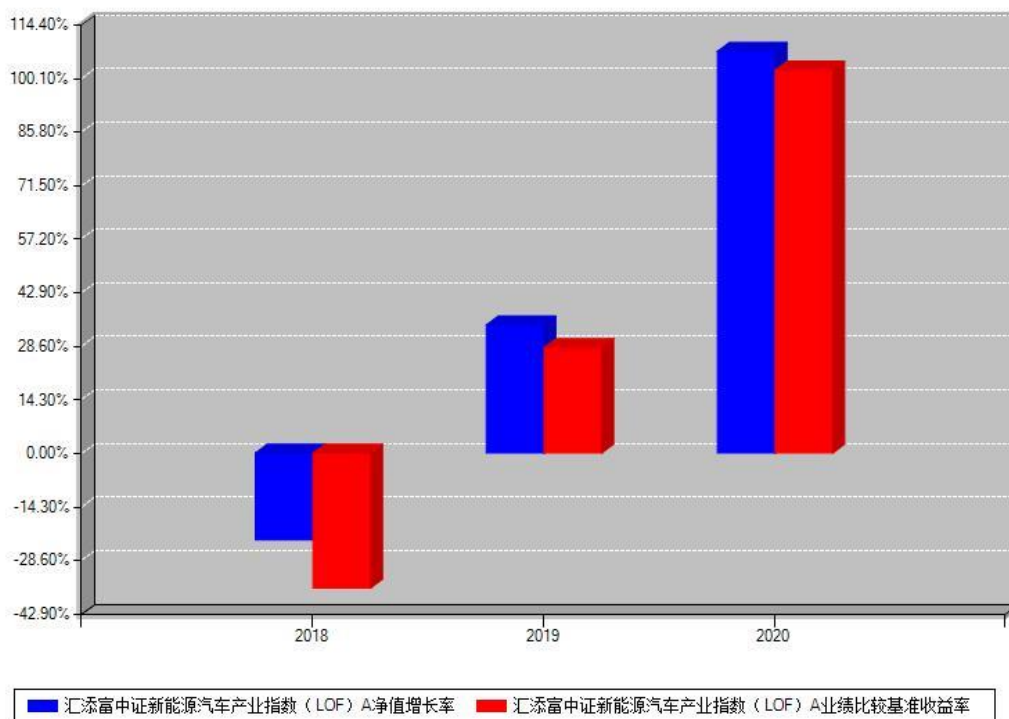


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018 年 05 月 23 日）起 6 个月，建仓期结束各项资产配置比例符合合同约定。

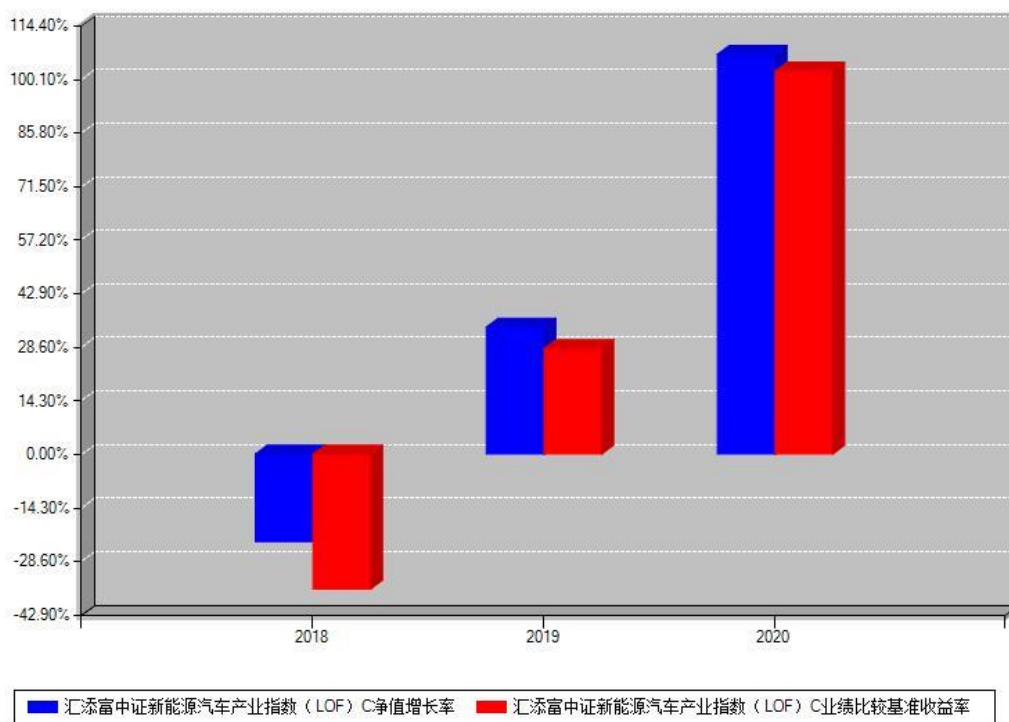
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益

率的比较

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2018 年 05 月 23 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本《基金合同》生效之日为 2018 年 05 月 23 日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

§ 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京等地设有分公司，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。

目前，汇添富基金已经发展成为长期业绩亮眼、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模居前的大型基金公司。2020 年，汇添富基金多位基金经理荣获“中国基金业英华奖·最佳基金经理”等奖项，旗下多只产品荣获“金牛奖”、“金基金奖”、“明星基金奖”等奖项。

2020 年，汇添富基金新成立 25 只公募基金，包括 18 只混合型基金，2 只股票型基金，5 只债券型基金。2020 年底，公司公募基金产品总数达 168 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2020 年，汇添富基金继续坚持重度垂直兼顾开放的互联网金融平台战略，在不断夯实自有平台基础建设、全方位提升平台架构及安全系统的基础上，持续提升自有平台创新能力。从投资的生命周期各阶段出发，通过“渐进式”的创新和打磨，创造差异化的竞争优势。开创性地研发上线了组合发车、实盘等互联网产品形态，实现了跨 TA 转换等业内首创的功能，推出了 APP 简化版，满足了部分客户的极简需求，极大的提升了用户体验。与此同时，积极拥抱互联网变革，快速布局直播、短视频等赛道，初步搭建起数字化运营体系。其中，直播、短视频业务以自有平台及支付宝为主要阵地，以核心 IP 为亮点，以理财投教为内容抓手，

通过持续运营，获得了广大投资人的喜爱；在数字化运营方面，围绕为客户提供更优质的投资服务目标，自有平台精准营销体系初见成效，实现了客户数、活跃度、保有量的齐头并进，力争形成长期增长的良性循环。对外合作上，进一步加深与多家互联网巨头的深度战略合作，继续大力开拓新型互联网销售及服务模式，实现与平台的合作共赢。

2020 年，汇添富基金持续推进大机构战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司深受专业机构投资者信任，获得所有大型银行及保险委外专户组合，且保险委托管理规模同业领先。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务规模快速增长，受托管理组合账户数量及规模持续增加。

2020 年，公司积极开展渠道服务和投资者教育工作，以“前瞻性”、“多层次”、“体系化”、“全方位”的投顾服务不断提升汇添富品牌在渠道的影响力和认可度。同时公司在各渠道端开展“价值投资添富行”等线上、线下系列活动，全年合计开展超 3000 余场，持续大力开展目标收益定投、走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列客户活动，营销培训活动覆盖至银行和券商的网点、营业部。

2020 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设，搭建全新客服体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2020 年，香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理继续发挥显著成效，国际业务总资产管理规模取得长足进步，QDII 及港股通项下公募基金业绩优秀，“港股通”类委外专户管理规模继续保持领先，海外主动管理权益资产规模保持行业前列。2020 年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星三年与五年的五星评级，根据彭博统计，中港策略基金在最近一年、三年、五年同类港股基金中业绩分别列第二、第二及第一位；汇添富精选美元债券基金获得晨星三年五星评级；汇添富港币债券基金获得晨星 5 年的 4 星评级。

2020 年初以来，汇添富一方面通过各种举措积极参与抗疫工作，另一方面继续为推动中西部贫困地区教育发展和产业脱贫而不懈努力。

疫情爆发初期，公司在做好自身复工复产、保护投资者利益、维护资本市场稳定的基础上，第一时间组织开展各项社会抗疫工作，倡导联合上海公募基金业充分发挥基金的力量，组织各种抗疫物资驰援武汉，共渡难关。抗疫项目包括“上海基金业致敬白衣天使”专项基金捐赠、湖北地区医疗防疫物资捐赠、“河流·孩子”项目学校“校园守护包”捐赠、“生

命之光”慰问上海交通大学医学院附属医院一线的青年医护人员等抗疫项目。其中，汇添富建议并协助上海市基金同业公会紧急发起的“上海基金业致敬白衣天使”专项基金有 34 家会员单位与公会共同出资参与捐赠，募集资金 4748 万元，先后采取线上线下两种形式，兼顾中医西医两个系统，覆盖了上海援鄂医护人员、坚守上海抗疫一线医护人员、武汉抗疫一线医护人员、中国国际援助医疗队成员及其他为抗击疫情做出重要贡献的人员共计 4330 名。

在教育扶贫方面，汇添富连续第十三年开展“河流·孩子”公益助学计划，项目组在做好疫情防护的同时积极邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的“添富小学”提供公益服务。公司党委下属的八个党支部通过实际行动支持和关怀各添富小学的发展，在第十三届“河流·孩子”2020 乡村优秀青年教师培训中，八个党支部的志愿讲师通过远程授课的形式为线上参训的 96 名乡村青年教师讲授了不同领域的知识和热门议题。截止目前，“河流·孩子”项目先后援建 10 所“添富小学”，连续十三年培训乡村教师 1100 人次，受益学生逾万人，累计扶贫投入资金近 3000 万元，累计提供志愿服务 3 万多小时。

2020 年 11 月，汇添富在人民日报·国际金融报举办的第三届 CSR 先锋论坛奖项评选中获评“2020 年度社会责任先锋案例”。

2021 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

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		
过蓓蓓	本基金的基金经理	2018 年 05 月 23 日		9	国籍:中国。学历:中国科学技术大学金融工程博士。从业资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金

				<p>管理股份有限公司。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的</p>
--	--	--	--	---

					<p>基金经理。2016年12月29日至今任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018年5月23日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018年10月23日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年3月26日至今任汇添富中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年4月15日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年10月8日至今任中证800交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”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：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老保险组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。（2）在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。另外，公司还建立机制要求公募投资组合经理与资产管理计划投资组合经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。（3）在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。（4）在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的

各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 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。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、风险管理、营运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。

4.3.3 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 39 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

2020 年风云变幻、跌宕起伏，疫情对全球经济予以剧烈打击、海外政治形势变换，伴随而来的是全球流动性的宽松，以及流动性带来的分化牛市。2020 年全年虽然宽基指数普涨，但代表大盘价值风格的上证 50 上涨 18.8%，而代表中小盘成长风格的创业板指上涨 64.9%。

新能源、医药板块成为市场资金焦点，年度涨幅排名一、二。主要消费板块全年表现稳健，尤其在 3 月回调中表现出明显的抗突发风险的特征。与之相对的，房地产、传统能源、银行等板块的低估值特征并没有转化成投资收益的来源。资金不断推高成长板块的整体估值水平，引发市场强烈分化。

在各国大量释放流动性的同时，国内货币政策凸显稳健，利率环境在 2020 年内起伏较大。上半年国债利率快速下行，下半年又快速回升到 2019 年 3 季度水平，使得下半年市场资金活化，板块轮动加快，对“抱团”、“高估值”的讨论也增多。全球比较来看，国内疫情防控启动早、效果好，复工复产稳步推进，经济运行在受到短期冲击后能够迅速回归常态，这就为稳健的货币政策提供了支持。同时，国内安全高效的供应链、产业链，吸引乐海外工程的溢出，来自于海外需求的 CX0、电动车、出口订单增长，人民币资产表现出很强的国际吸引力。

在资本市场行情的带动之下，居民财富配置的结构转型也在加速。全年基金发行规模超 3 万亿，创历史记录，其中股票型基金占比超 10%，混合型占比超 50%。年末全市场基金规模超过 20 万亿，较 2019 年不足 15 万亿的水平增长超 1/3。股票及混合型基金占比也从 2019 年末的 1/5 左右提升至 2020 年末的 1/3。

新能源汽车指数全年上涨 109.16%，成为贯彻全年的投资主线。新能源汽车产业在二~四季度一直保持很高的景气度，欧洲、中国新能源车销售均获得环比、同比大幅增长，欧洲新能源车渗透率超过 10%。产业链中游扩产、上游提价，相互印证产业链高景气。国内自主车企新能源车销量提升明显，三分天下有其一，体现出国内车企多价格、多层次、全面覆盖的竞争优势。国内产业链在全球的竞争力进一步体现。

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 90%~95%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 A 类基金份额净值增长率为 107.25%;C 类基金份额净值增长率为 106.74%。同期业绩比较基准收益率为 102.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，海外流动性边际变化是市场最大的风险点。2020 年，全球主要经济体实施零利率甚至负利率，美联储、欧洲央行资产负债表规模扩张了 77%、50%，宏观杠杆率也较 2019 年大幅上升 20 多个百分点。这样的流动性大幅宽松，边际是比较脆弱的，尤其是 2020 年末开始的全球疫苗接种开始，使得最坏的阶段已经成为过去时，全球很可能会超过

市场预期实现疫情可控和经济常态的恢复。

2021 年国内经济基本面好转是大概率事件，内生增长动力强，上市公司基本面环境较好。但是在全球还存在不确定性的背景下，国内经济环境也会面临不确定性。这种大概率 and 不确定并存的状态决定了，国内货币政策会边走边试，并且是走在市场曲线前面，灵活调整。

因此，2021 年不应再期待流动性推动的市场环境，而要将更多的关注放在业绩兑现度、盈利稳健性、投资长逻辑上。

2021 年新能源汽车是百花齐放落地销售的一年，下游的竞争性投放将带来中游和上游需求的高增长，并且催化消费端的热情。但是，我们也要留意，新能源汽车产业这样的成长空间型投资主题仍然需要业绩的逐步兑现，而不是空炒预期。新能源汽车产业指数也将根据产业发展状况调整成分股，使之更具备产业链投资价值。

作为被动投资的指数型基金，汇添富中证新能源汽车产业指数基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的指数化投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、进一步提升合规法务管理工作

强化合规审核和风险把控，为公司各项业务开展提供全面的合规法务咨询、审核与支持；开展多项合规检查，切实履行合规报告职责；贯彻资管新规及细则要求，持续落实相关业务整改；开展反洗钱培训与宣传，完善反洗钱可疑交易系统监测，持续加强洗钱风险管控；开展形式多样的合规培训与教育，促进人员合规执业，加强合规文化建设。

2、进一步完善投资风险控制工作

强化投资授权管理，优化内幕交易管控机制，避免利益输送及操纵市场等违法违规行为；根据今年新推出的投资业务特点，优化投资、交易合规监控逻辑和管控流程；完善公司关联交易、公平交易和异常交易管控逻辑，并通过制度和系统方式落实相关管控措施；建立跨部门沟通机制，全面提升投资团队合规管理意识和效率；完善公司对外行使投票表决权管理机制，防止利益冲突和防范利益输送行为；定期梳理合规风险案例，对投研人员进行合规培训；强化估值合规性管理，防范账户透支、估值异常等风险，维护持有人利益。

3、进一步加强稽核内审工作

通过对母子公司业务开展日常风险排查，对重点业务开展专项稽核检查，尽早发现业务中存在的合规问题和风险隐患，并采取防范措施，督促责任部门落实整改；对风险事件和差

错事件开展稽核审查，加强问责力度，促进业务合法合规开展；实施关键岗位离任审查、人员行为监控和人员投资报备审查，督促人员勤勉尽责、合规展业；配合监管检查与会计师事务所审计工作，通过问题反馈、实施整改，进一步完善公司内部控制管理机制。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强合规管理和风险控制，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结

算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 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，本基金托管人在汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）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，汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）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。

5.3 托管人对本年度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中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）2020 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 60466941_B114 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）

	全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大</p>

	<p>的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊 韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
审计报告日期	2021年03月26日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资产：			

银行存款	7.4.7.1	496,318,407.29	12,700,339.30
结算备付金		8,549,802.51	7,280.92
存出保证金		577,732.81	29,558.25
交易性金融资产	7.4.7.2	5,567,898,020.93	227,435,362.69
其中：股票投资		5,567,898,020.93	226,768,862.69
基金投资		-	-
债券投资		-	666,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	45,703.12	5,434.34
应收股利		-	-
应收申购款		86,085,162.39	5,023,704.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		6,159,474,829.05	245,201,679.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		172,656,135.70	1,554.07
应付赎回款		96,526,739.01	5,206,433.56
应付管理人报酬		3,508,747.16	195,077.60
应付托管费		350,874.74	19,507.77
应付销售服务费		363,460.14	19,836.10
应付交易费用	7.4.7.7	4,032,252.64	135,399.05
应交税费		-	2.95
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	410,825.12	283,551.86
负债合计		277,849,034.51	5,861,362.96
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,760,879,098.08	232,583,446.45
未分配利润	7.4.7.10	3,120,746,696.46	6,756,870.29
所有者权益合计		5,881,625,794.54	239,340,316.74
负债和所有者权益总计		6,159,474,829.05	245,201,679.70

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,760,879,098.08 份。本基金下属 A 类

基金份额净值 2.1370 元，基金份额总额 1,628,676,006.47 份；本基金下属 C 类基金份额净值 2.1207 元，基金份额总额 1,132,203,091.61 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 01 月 01 日 至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日 至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		1,845,969,942.89	67,320,656.07
1. 利息收入		2,503,852.41	169,807.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	580,560.32	139,030.95
债券利息收入		19,593.74	1,090.82
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		1,903,698.35	29,685.40
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		400,743,466.58	-17,908,332.01
其中：股票投资收益	7.4.7.12	389,463,319.41	-21,826,064.90
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	1,554,221.25	386.70
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	9,725,925.92	3,917,346.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,422,445,933.56	84,782,691.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	20,276,690.34	276,489.77
减：二、费用		36,286,169.13	4,378,260.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	20,539,325.20	2,863,158.34
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,053,932.53	286,315.86
3. 销售服务费		2,102,965.53	373,178.23
4. 交易费用	7.4.7.20	10,978,192.00	597,993.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		6.36	0.35
7. 其他费用	7.4.7.21	611,747.51	257,615.07

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,809,683,773.76	62,942,395.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,809,683,773.76	62,942,395.20

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 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）	232,583,446.45	6,756,870.29	239,340,316.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,809,683,773.76	1,809,683,773.76
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）	2,528,295,651.63	1,304,306,052.41	3,832,601,704.04
其中：1. 基金申购款	7,212,257,609.19	3,370,934,391.77	10,583,192,000.96
2. 基金赎回款	-4,683,961,957.56	-2,066,628,339.36	-6,750,590,296.92
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）	2,760,879,098.08	3,120,746,696.46	5,881,625,794.54
项目	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 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）	333,619,427.25	-77,669,283.28	255,950,143.97
二、本期经营活动产生的基金净	-	62,942,395.20	62,942,395.20

值变动数（本期利润）			
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）	-101,035,980.80	21,483,758.37	-79,552,222.43
其中：1. 基金申购款	221,649,119.12	-12,853,731.01	208,795,388.11
2. 基金赎回款	-322,685,099.92	34,337,489.38	-288,347,610.54
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）	232,583,446.45	6,756,870.29	239,340,316.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖

基金管理人负责人

李骁

主管会计工作负责人

雷青松

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）（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[2017]2076 号文《关于准予汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2018 年 5 月 23 日生效。首次设立募集规模为 742,196,052.24 份基金份额。本基金为上市契约型开放式（LOF），存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标基金还可投资于其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期

融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（分离交易可转债）、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款等）、货币市场工具、金融衍生工具（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金进行被动式指数化投资，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：中证新能源汽车产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）

或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

费用入账；

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 股指/国债期货投资

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

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

(5) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交

易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

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

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

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

账；

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费及销售服务等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	496,318,407.29	12,700,339.30
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	496,318,407.29	12,700,339.30

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,142,867,160.09	5,567,898,020.93	1,425,030,860.84
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		4,142,867,160.09	5,567,898,020.93	1,425,030,860.84
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		224,183,935.41	226,768,862.69	2,584,927.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	666,500.00	666,500.00	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	666,500.00	666,500.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		224,850,435.41	227,435,362.69	2,584,927.28

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	24,314.23	2,575.86
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,847.40	3.30
应收债券利息	-	89.05
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	17,281.49	2,752.83
其他	260.00	13.30
合计	45,703.12	5,434.34

注：“其他”为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,032,252.64	135,399.05
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,032,252.64	135,399.05

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	49,272.66	162.91
应付证券出借违约金	-	-
应付审计费	80,000.00	80,000.00
应付信息披露费	120,000.00	190,000.00
应付指数使用费	161,552.46	13,388.95
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
其他	-	-
合计	410,825.12	283,551.86

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A		
项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	142,253,840.90	142,253,840.90
本期申购	3,698,773,247.71	3,698,773,247.71
本期赎回（以“-”号填列）	-2,212,351,082.14	-2,212,351,082.14
基金拆分/份额折算	-	-

前		
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,628,676,006.47	1,628,676,006.47
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C		
项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	90,329,605.55	90,329,605.55
本期申购	3,513,484,361.48	3,513,484,361.48
本期赎回（以“-”号填列）	-2,471,610,875.42	-2,471,610,875.42
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,132,203,091.61	1,132,203,091.61

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,948,636.51	20,375,283.57	4,426,647.06
本期利润	230,368,265.49	850,578,093.67	1,080,946,359.16
本期基金份额交易产生的变动数	-39,220,774.36	805,697,265.59	766,476,491.23
其中：基金申购款	-141,365,762.64	1,883,189,486.51	1,741,823,723.87
基金赎回款	102,144,988.28	-1,077,492,220.92	-975,347,232.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	175,198,854.62	1,676,650,642.83	1,851,849,497.45

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,501,621.11	12,831,844.34	2,330,223.23
本期利润	156,869,574.71	571,867,839.89	728,737,414.60
本期基金份额交易产生的变动数	-34,725,036.13	572,554,597.31	537,829,561.18
其中：基金申购款	-150,807,768.11	1,779,918,436.01	1,629,110,667.90
基金赎回款	116,082,731.98	-1,207,363,838.70	-1,091,281,106.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	111,642,917.47	1,157,254,281.54	1,268,897,199.01

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	491,740.56	130,189.23
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	46,365.70	1,965.94
其他	42,454.06	6,875.78
合计	580,560.32	139,030.95

注：“其他”为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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12月31日	2019年01月01日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	2,423,297,319.60	216,205,228.46
减：卖出股票成本总额	2,033,834,000.19	238,031,293.36
买卖股票差价收入	389,463,319.41	-21,826,064.90

7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

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	2019年01月01日至2019年

	12 月 31 日	12 月 31 日
出借证券现金清偿总额	-	-
减：出借证券成本总额	-	-
减：应收证券出借利息	-	-
证券出借差价收入	-	-

7.4.7.13 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	57,518,207.61	2,508,361.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	54,997,203.93	2,459,070.00
减：应收利息总额	966,782.43	48,904.72
买卖债券差价收入	1,554,221.25	386.70

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.17 股利收益

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 12 月 31 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	9,725,925.92	3,917,346.19
其中：证券出借权益补偿收入	553,127.47	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	9,725,925.92	3,917,346.19

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,422,445,933.56	84,782,691.14
——股票投资	1,422,445,933.56	84,781,128.92
——债券投资	-	1,562.22
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	1,422,445,933.56	84,782,691.14

7.4.7.19 其他收入

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 12 月 31 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	20,276,690.34	276,489.77
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	20,276,690.34	276,489.77

7.4.7.20 交易费用

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 12 月 31 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	10,978,192.00	597,993.02
银行间市场交易费用	-	-
合计	10,978,192.00	597,993.02

7.4.7.21 其他费用

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 12 月 31 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00

证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	961.00	352.00
指数使用费	410,786.51	57,263.07
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	611,747.51	257,615.07

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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, 基金发起人
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
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至
------	--------------------------------	---------------------------

称	月 31 日		2019 年 12 月 31 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	748,012,848.99	8.98	348,565,707.15	100.00

7.4.10.1.2 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	3,394,034.18	3.24	4,859,160.68	100.00

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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 12 月 31 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	685,900.76	8.98	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 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	320,429.61	100.00	135,399.05	100.00

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,539,325.20	2,863,158.34
其中：支付销售机构的客户维护费	5,334,888.78	267,612.42

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,053,932.53	286,315.86

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务 费的各关联方 名称	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证新能源汽 车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车 产业指数（LOF）C	合计

东方证券股份有限公司	-	6,088.64	6,088.64
汇添富基金管理股份有限公司	-	420,824.70	420,824.70
中国工商银行股份有限公司	-	55,616.25	55,616.25
合计	-	482,529.59	482,529.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C	合计
东方证券股份有限公司	-	12,608.54	12,608.54
汇添富基金管理股份有限公司	-	137,554.79	137,554.79
中国工商银行股份有限公司	-	4,318.72	4,318.72
合计	-	154,482.05	154,482.05

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.25%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。本基金

C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，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销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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 12 月 31 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	2,809,050,044.00	1,903,698.35	100,208,337.00	17,281.49
上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 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	39,152,844.54	29,685.40	6,565,100.00	2,752.83

7.4.10.4.2 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A		
项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2018 年 05 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,003,600.36	10,003,600.36
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份	10,003,600.36	10,003,600.36

额		
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	0.61	7.03
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C		
项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2018 年 05 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.5.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 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	496,318,407.29	491,740.56	12,700,339.30	130,189.23

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
300879	大叶股份	2020年08月25日	2021年03月01日	新股流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	
300864	南大环境	2020年08月13日	2021年02月25日	新股流通受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年01月04日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	
300896	爱美客	2020年09月21日	2021年03月29日	新股流通受限	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	
688155	先惠技术	2020年08月03日	2021年02月18日	新股流通受限	38.77	67.26	2,403	93,164.31	161,625.78	
300891	惠云	2020年	2021年	新股	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	

	钛业	09月10日	03月17日	流通受限						
300867	圣元环保	2020年08月12日	2021年03月03日	新股流通受限	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	
300888	稳健医疗	2020年09月09日	2021年03月17日	新股流通受限	74.30	156.39	10,265	762,689.50	1,605,343.35	
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年05月24日	新股流通受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年06月03日	新股流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	
300869	康泰医学	2020年08月12日	2021年02月24日	新股流通受限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	
300872	天阳科技	2020年08月14日	2021年02月25日	新股流通受限	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	
605277	新亚电子	2020年12月	2021年01月	新股流通	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	

		25 日	06 日	受 限						
30088 9	爱 克 股 份	202 0年 09 月 09 日	202 1年 03 月 16 日	新 股 流 通 受 限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	
30089 2	品 渥 食 品	202 0年 09 月 11 日	202 1年 03 月 24 日	新 股 流 通 受 限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	
30091 0	瑞 丰 新 材	202 0年 11 月 20 日	202 1年 05 月 27 日	新 股 流 通 受 限	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	
30088 7	谱 尼 测 试	202 0年 09 月 09 日	202 1年 03 月 16 日	新 股 流 通 受 限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	
30090 9	汇 创 达	202 0年 11 月 11 日	202 1年 05 月 18 日	新 股 流 通 受 限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	
30087 7	金 春 股 份	202 0年 08 月 17 日	202 1年 03 月 03 日	新 股 流 通 受 限	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	
30087 6	蒙 泰 高 新	202 0年 08 月 14 日	202 1年 02 月 25 日	新 股 流 通 受 限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	

300884	狄耐克	2020年11月05日	2021年05月12日	新股流通受限	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49
300870	欧陆通	2020年08月13日	2021年02月24日	新股流通受限	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26
300871	回盛生物	2020年08月13日	2021年02月24日	新股流通受限	33.61	38.70	618	20,770.98	23,916.60
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年01月06日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40
300878	维康药业	2020年08月17日	2021年03月03日	新股流通受限	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72
300898	熊猫乳品	2020年10月09日	2021年04月16日	新股流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88
300999	金龙鱼	2020年09月29日	2021年04月15日	新股流通受限	25.70	88.29	7,177	184,448.90	633,657.33
300861	美畅	2020年	2021年	新股	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50

股份	08 月 06 日	02 月 24 日	流 通 受 限							
7.4.12.1.2 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
					-	-	-	-	-	

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代 码	证 券 名 称	成 交 时 间	出 借 到 期 日	期 末 估 值 单 价	数 量（ 单 位： 张）	期 末 估 值 总 额
2020122400003207	002340	格 林 美	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	6.99	88400	617,916.00
2020122400002609	002050	三 花 智 控	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	24.65	41600	1,025,440.00
2020122800001508	600563	法 拉	2020 年 12	2021 年 01	107.55	11200	1,204,560.00

		电子	月 28 日	月 11 日			
2020122400002638	002056	横店东磁	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	15.19	19500	296,205.00
2020122800001107	002407	多氟多	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	20.03	43000	861,290.00
2020122400002409	000970	中科三环	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	9.45	19500	184,275.00
2020122800001269	600699	均胜电子	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	25.36	100000	2,536,000.00
2020122400003650	002594	比亚迪	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	194.30	10400	2,020,720.00
2020122800001870	600549	厦门钨业	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	16.85	120000	2,022,000.00
2020122800000323	300750	宁德时代	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	351.11	10000	3,511,100.00
2020122800001104	002407	多氟多	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	20.03	80000	1,602,400.00
2020123000002456	002407	多氟多	2020 年 12 月 30 日	2021 年 01 月 13 日	20.03	21000	420,630.00
2020122400003876	603659	璞泰来	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	112.39	10000	1,123,900.00
2020122400005217	600580	卧龙	2020 年 12	2021 年 01	15.60	18200	283,920.00

		电驱	月 24 日	月 07 日			
2020122800001196	002594	比亚迪	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	194.30	10000	1,943,000.00
2020122400004312	600066	宇通客车	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	16.92	31200	527,904.00
2020122800001241	002812	恩捷股份	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	141.78	10000	1,417,800.00
2020123000000515	300618	寒锐钴业	2020 年 12 月 30 日	2021 年 01 月 13 日	94.91	14400	1,366,704.00
2020122800001113	002407	多氟多	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	20.03	114500	2,293,435.00
2020122800000887	000970	中科三环	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	9.45	68800	650,160.00
2020122800001133	002460	赣锋锂业	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	101.20	39900	4,037,880.00
2020122800001174	002518	科士达	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	11.73	70000	821,100.00
2020122800000327	300750	宁德时代	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	351.11	20200	7,092,422.00
2020122400004950	603026	石大胜华	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	50.41	10000	504,100.00
2020122800001071	002340	格林	2020 年 12	2021 年 01	6.99	510000	3,564,900.00

		美	月 28 日	月 11 日			
2020122400006775	600884	杉杉股份	2020年12月24日	2021年01月07日	18.03	26000	468,780.00
2020122800000325	300073	当升科技	2020年12月28日	2021年01月11日	64.85	14000	907,900.00
2020122800002031	600884	杉杉股份	2020年12月28日	2021年01月11日	18.03	44000	793,320.00
2020122800001073	002340	格林美	2020年12月28日	2021年01月11日	6.99	510000	3,564,900.00
2020122800001223	002709	天赐材料	2020年12月28日	2021年01月11日	103.80	10000	1,038,000.00
2020122800001222	002709	天赐材料	2020年12月28日	2021年01月11日	103.80	26500	2,750,700.00
2020122400006245	600549	厦门钨业	2020年12月24日	2021年01月07日	16.85	19500	328,575.00
2020122800001072	002340	格林美	2020年12月28日	2021年01月11日	6.99	93000	650,070.00
2020122400003825	002812	恩捷股份	2020年12月24日	2021年01月07日	141.78	10400	1,474,512.00
2020122400004463	600885	宏发股份	2020年12月24日	2021年01月07日	54.22	11700	634,374.00
2020122800000973	002091	江苏	2020年12	2021年01	7.23	210000	1,518,300.00

		国 泰	月 28 日	月 11 日			
2020122800000961	002074	国 轩 高 科	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	39.12	77200	3,020,064.00
2020122400004587	600563	法 拉 电 子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	107.55	10000	1,075,500.00
2020122800000333	300001	特 锐 德	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	29.36	48800	1,432,768.00
2020123000002355	002340	格 林 美	2020 年 12 月 30 日	2021 年 01 月 13 日	6.99	102000	712,980.00
2020122400003866	600699	均 胜 电 子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	25.36	19500	494,520.00
2020123000003200	603799	华 友 钻 业	2020 年 12 月 30 日	2021 年 01 月 13 日	79.30	144000	11,419,200.00
2020122800001109	002407	多 氟 多	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	20.03	90000	1,802,700.00
2020122400003329	002407	多 氟 多	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	20.03	15600	312,468.00
2020122800000957	002056	横 店 东 磁	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	15.19	55000	835,450.00
2020122400003552	002518	科 士 达	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	11.73	10000	117,300.00
2020122800002018	600884	杉 杉	2020 年 12	2021 年 01	18.03	55500	1,000,665.00

		股 份	月 28 日	月 11 日			
2020122800001997	600884	杉 杉 股 份	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	18.03	91900	1,656,957.00
2020122800001132	002460	赣 锋 锂 业	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	101.20	20200	2,044,240.00
2020122400005184	603799	华 友 钻 业	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	79.30	15600	1,237,080.00
2020122400002729	002091	江 苏 国 泰	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	7.23	22100	159,783.00
2020122400003444	002460	赣 锋 锂 业	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	101.20	18200	1,841,840.00
2020122800001615	603799	华 友 钻 业	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	79.30	11600	919,880.00
2020122400003781	002709	天 赐 材 料	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	103.80	10000	1,038,000.00
2020123000002537	002460	赣 锋 锂 业	2020 年 12 月 30 日	2021 年 01 月 13 日	101.20	15400	1,558,480.00
2020122800001491	600885	宏 发 股 份	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	54.22	44200	2,396,524.00
2020122800000958	002056	横 店 东 磁	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	15.19	67300	1,022,287.00
2020123000003404	600549	厦 门	2020 年 12	2021 年 01	16.85	46000	775,100.00

		钨业	月 30 日	月 13 日			
2020122800001069	002340	格林美	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	6.99	438100	3,062,319.00
2020122400002667	002074	国轩高科	2020 年 12 月 24 日	2021 年 01 月 07 日	39.12	23400	915,408.00
2020122800001102	002407	多氟多	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	20.03	114400	2,291,432.00
2020122800001638	600580	卧龙电驱	2020 年 12 月 28 日	2021 年 01 月 11 日	15.60	64500	1,006,200.00
合计	-	-	-	-	-	4,097,400	100,208,337.00

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金、债券投资及部分应收申购款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 0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	496,318,407.29	-	-	-	-	-	496,318,407.29
结算备付金	8,549,802.51	-	-	-	-	-	8,549,802.51
存出保证金	577,732.81	-	-	-	-	-	577,732.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,567,898,020.93	5,567,898,020.93
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	45,703.12	45,703.12

应收申购款	7,622,147.49	-	-	-	-	78,463,014.90	86,085,162.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	513,068,090.10	-	-	-	-	5,646,406,738.95	6,159,474,829.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	96,526,739.01	96,526,739.01
应付管	-	-	-	-	-	3,508,747.16	3,508,747.16

理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	350,874.74	350,874.74
应付证券清算款	-	-	-	-	-	172,656,135.70	172,656,135.70
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	363,460.14	363,460.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,032,252.64	4,032,252.64
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付	-	-	-	-	-	-	-

利息							
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	410,825.12	410,825.12
负债总计	-	-	-	-	-	277,849,034.51	277,849,034.51
利率敏感度缺口	513,068,090.10	-	-	-	-	5,368,557,704.44	5,881,625,794.54
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	12,700,339.30	-	-	-	-	-	12,700,339.30
结算备付金	7,280.92	-	-	-	-	-	7,280.92
存出	29,558.25	-	-	-	-	-	29,558.25

保证金							
交易性金融资产	-	-	666,500.00	-	-	226,768,862.69	227,435,362.69
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	5,434.34	5,434.34
应收申购款	976,892.27	-	-	-	-	4,046,811.93	5,023,704.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,714,070.74	-	666,500.00	-	-	230,821,108.96	245,201,679.70
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,206,433.56	5,206,433.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	195,077.60	195,077.60
应付托管费	-	-	-	-	-	19,507.77	19,507.77
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,554.07	1,554.07
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应	-	-	-	-	-	19,836.10	19,836.10

付销售服务费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	135,399.05	135,399.05
应交税费	-	-	-	-	-	2.95	2.95
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	283,551.86	283,551.86
负债总计	-	-	-	-	-	5,861,362.96	5,861,362.96
利率敏感度缺口	13,714,070.74	-	666,500.00	-	-	224,959,746.00	239,340,316.74

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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金持有的可转换债券的市场风险在附注 7.4.13.4.3.1 中进行披露；除此之外，本基金本报告期末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。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	5,567,898,020.93	94.67	226,768,862.69	94.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	666,500.00	0.28
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	5,567,898,020.93	94.67	227,435,362.69	95.03

注：本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。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。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	中证新能源汽车产业指数上涨 5%	272,038,170.81	11,118,340.34
	中证新能源汽车产业指数下跌 5%	-272,038,170.81	-11,118,340.34

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 5,564,659,660.73 元，属于第二层次的余额为人民币 21,789.54 元，属于第三层次的余额为人民币 3,216,570.66 元（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 213,762,879.57 元，属于第二层次的余额为人民币 10,267,143.50 元，属于第三层次的余额为人民币 3,405,339.62 元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属

于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期末余额为人民币 3,216,570.66 元，期初余额为人民币 3,405,339.62 元，本期减少人民币 188,768.96 元。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	5,567,898,020.93	90.40
	其中：股票	5,567,898,020.93	90.40
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	504,868,209.80	8.20
8	其他资产	86,708,598.32	1.41
9	合计	6,159,474,829.05	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 100,208,337.00 元，占期末基金资产净值比例 1.70%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,526,948,947.76	93.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	35,886,105.00	0.61
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	-	-
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	5,562,835,052.76	94.58

8.2.2 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	4,834,180.51	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
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	133,843.58	0.00
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	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	62,972.16	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,062,968.17	0.09

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	300750	宁德时代	1,421,326	499,041,771.86	8.48
2	300014	亿纬锂能	5,420,404	441,762,926.00	7.51
3	002594	比亚迪	2,123,721	412,638,990.30	7.02
4	300124	汇川技术	4,396,196	410,165,086.80	6.97
5	002460	赣锋锂业	3,663,346	370,730,615.20	6.30
6	002812	恩捷股份	2,106,337	298,636,459.86	5.08
7	603799	华友钴业	3,297,331	261,478,348.30	4.45
8	300450	先导智能	3,023,598	253,951,996.02	4.32
9	002050	三花智控	8,668,122	213,669,207.30	3.63
10	002074	国轩高科	4,956,888	193,913,458.56	3.30

11	002709	天赐材料	1,590,289	165,071,998.20	2.81
12	600885	宏发股份	2,540,526	137,747,319.72	2.34
13	300037	新宙邦	1,206,000	122,288,400.00	2.08
14	300073	当升科技	1,715,241	111,233,378.85	1.89
15	600066	宇通客车	6,518,236	110,288,553.12	1.88
16	600699	均胜电子	4,038,360	102,412,809.60	1.74
17	002340	格林美	14,515,700	101,464,743.00	1.73
18	600884	杉杉股份	5,617,604	101,285,400.12	1.72
19	300001	特锐德	2,963,614	87,011,707.04	1.48
20	603659	璞泰来	724,587	81,436,332.93	1.38
21	600563	法拉电子	674,367	72,528,170.85	1.23
22	300618	寒锐钴业	760,403	72,169,848.73	1.23
23	600549	厦门钨业	4,221,190	71,127,051.50	1.21
24	002407	多氟多	3,484,000	69,784,520.00	1.19
25	002056	横店东磁	4,135,300	62,815,207.00	1.07
26	600580	卧龙电驱	3,958,795	61,757,202.00	1.05
27	300457	赢合科技	1,971,405	59,240,720.25	1.01
28	688005	容百科技	1,123,000	57,879,420.00	0.98
29	002850	科达利	591,469	55,592,171.31	0.95
30	002126	银轮股份	4,032,000	55,520,640.00	0.94
31	300568	星源材质	1,822,862	55,178,032.74	0.94
32	688388	嘉元科技	590,020	52,004,362.80	0.88
33	688006	杭可科技	616,700	51,204,601.00	0.87
34	688116	天奈科技	718,356	44,538,072.00	0.76
35	603026	石大胜	840,290	42,359,018.90	0.72

		华			
36	000970	中科三环	4,437,800	41,937,210.00	0.71
37	300769	德方纳米	235,660	39,402,352.00	0.67
38	002091	江苏国泰	4,963,500	35,886,105.00	0.61
39	300035	中科电气	2,438,400	29,870,400.00	0.51
40	300224	正海磁材	2,241,900	28,046,169.00	0.48
41	002518	科士达	1,430,500	16,779,765.00	0.29
42	300745	欣锐科技	550,602	10,984,509.90	0.19

8.3.2 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	300888	稳健医疗	10,265	1,605,343.35	0.03
2	688289	圣湘生物	6,806	775,543.70	0.01
3	300999	金龙鱼	7,177	633,657.33	0.01
4	688526	科前生物	14,620	608,192.00	0.01
5	300896	爱美客	473	285,389.28	0.00
6	688155	先惠技术	2,403	161,625.78	0.00
7	688219	会通股份	7,336	139,970.88	0.00
8	688378	奥来德	2,411	133,014.87	0.00
9	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.00
10	688590	新致软件	4,171	82,168.70	0.00
11	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
12	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00

13	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
14	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
15	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
16	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00
17	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
18	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
19	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
20	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
21	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
22	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
23	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
24	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
25	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
26	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
27	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
28	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
29	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
30	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
31	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
32	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
33	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
34	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
35	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
36	605277	新亚电	507	8,593.65	0.00

		子			
37	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
38	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300750	宁德时代	445,747,276.46	186.24
2	002594	比亚迪	430,658,108.64	179.94
3	300014	亿纬锂能	359,403,860.72	150.16
4	300124	汇川技术	307,603,756.00	128.52
5	002460	赣锋锂业	303,630,448.10	126.86
6	002812	恩捷股份	232,231,560.83	97.03
7	002050	三花智控	222,761,565.59	93.07
8	300450	先导智能	213,784,435.44	89.32
9	603799	华友钴业	203,088,884.00	84.85
10	002074	国轩高科	170,430,870.87	71.21
11	002340	格林美	137,827,955.05	57.59
12	600885	宏发股份	135,719,802.81	56.71
13	600066	宇通客车	122,869,298.82	51.34
14	600699	均胜电子	120,221,353.17	50.23
15	603993	洛阳钼业	118,788,017.96	49.63
16	002709	天赐材料	118,374,841.37	49.46
17	002466	天齐锂业	109,566,220.43	45.78
18	600104	上汽集团	105,055,843.22	43.89
19	300207	欣旺达	103,071,211.92	43.06
20	600884	杉杉股份	101,173,831.71	42.27
21	300037	新宙邦	99,221,419.16	41.46
22	002179	中航光电	95,562,963.05	39.93
23	300073	当升科技	89,582,636.55	37.43
24	603659	璞泰来	89,109,320.76	37.23
25	300001	特锐德	87,440,082.16	36.53
26	600549	厦门钨业	73,697,781.12	30.79
27	300457	赢合科技	71,952,151.19	30.06
28	300618	寒锐钴业	68,158,298.22	28.48
29	600580	卧龙电驱	63,854,068.83	26.68
30	002056	横店东磁	63,191,716.94	26.40

31	600563	法拉电子	62,557,988.01	26.14
32	002407	多氟多	62,365,159.16	26.06
33	002126	银轮股份	58,690,585.81	24.52
34	688005	容百科技	58,624,848.25	24.49
35	000970	中科三环	53,942,000.87	22.54
36	300568	星源材质	51,161,954.61	21.38
37	002850	科达利	50,292,339.02	21.01
38	601689	拓普集团	49,338,270.83	20.61
39	688006	杭可科技	46,296,886.27	19.34
40	603026	石大胜华	45,136,284.77	18.86
41	002091	江苏国泰	41,866,619.12	17.49
42	688388	嘉元科技	40,694,327.63	17.00
43	000625	长安汽车	40,149,118.11	16.77
44	300769	德方纳米	38,270,335.67	15.99
45	688116	天奈科技	33,949,514.55	14.18
46	000887	中鼎股份	30,666,070.26	12.81
47	300035	中科电气	30,138,854.00	12.59
48	300224	正海磁材	28,535,839.11	11.92
49	002276	万马股份	24,142,842.05	10.09
50	002518	科士达	22,381,595.90	9.35
51	600478	科力远	21,826,403.97	9.12
52	601238	广汽集团	20,521,885.50	8.57
53	600114	东睦股份	18,719,650.67	7.82
54	603305	旭升股份	16,887,871.19	7.06
55	002510	天汽模	15,504,118.00	6.48
56	300745	欣锐科技	14,055,700.00	5.87
57	600418	江淮汽车	13,224,307.42	5.53
58	688981	中芯国际	12,268,276.74	5.13
59	600525	长园集团	11,549,712.00	4.83
60	600366	宁波韵升	8,420,931.43	3.52
61	002101	广东鸿图	8,396,011.50	3.51
62	002454	松芝股份	8,078,073.91	3.38
63	000957	中通客车	6,953,730.30	2.91
64	300742	越博动力	5,465,852.00	2.28

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。

8.4.2 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	002594	比亚迪	300,785,352.95	125.67

2	300750	宁德时代	182,153,604.60	76.11
3	002179	中航光电	136,120,442.01	56.87
4	603993	洛阳钼业	134,134,097.25	56.04
5	300207	欣旺达	124,724,165.75	52.11
6	002466	天齐锂业	113,733,054.99	47.52
7	600104	上汽集团	99,063,760.39	41.39
8	300124	汇川技术	72,220,100.16	30.17
9	300014	亿纬锂能	66,618,909.45	27.83
10	601689	拓普集团	66,104,181.45	27.62
11	002460	赣锋锂业	63,254,197.31	26.43
12	002340	格林美	54,256,326.71	22.67
13	002050	三花智控	52,584,133.37	21.97
14	000625	长安汽车	50,694,437.55	21.18
15	002812	恩捷股份	46,888,087.56	19.59
16	688981	中芯国际	42,443,055.00	17.73
17	603799	华友钴业	39,544,154.45	16.52
18	300450	先导智能	38,038,279.76	15.89
19	000887	中鼎股份	37,305,733.83	15.59
20	600884	杉杉股份	33,326,989.30	13.92
21	002074	国轩高科	31,077,601.05	12.98
22	600418	江淮汽车	29,805,026.11	12.45
23	600885	宏发股份	26,590,144.21	11.11
24	600066	宇通客车	25,893,483.51	10.82
25	600699	均胜电子	24,737,757.75	10.34
26	600478	科力远	23,310,006.01	9.74
27	002276	万马股份	23,122,660.95	9.66
28	300037	新宙邦	20,938,903.01	8.75
29	601238	广汽集团	20,707,475.63	8.65
30	603659	璞泰来	19,768,576.20	8.26
31	002709	天赐材料	19,367,770.10	8.09
32	300073	当升科技	18,807,939.60	7.86
33	002510	天汽模	18,134,266.26	7.58
34	300001	特锐德	18,058,424.87	7.55
35	600114	东睦股份	17,653,072.60	7.38
36	600549	厦门钨业	17,178,439.54	7.18
37	603305	旭升股份	15,088,014.02	6.30
38	300618	寒锐钴业	15,085,096.62	6.30
39	002126	银轮股份	14,411,235.61	6.02
40	002056	横店东磁	14,279,508.70	5.97
41	600580	卧龙电驱	13,797,525.22	5.76
42	300457	赢合科技	13,301,723.39	5.56
43	002407	多氟多	13,003,774.46	5.43
44	600563	法拉电子	12,600,383.24	5.26

45	600525	长园集团	11,777,406.30	4.92
46	000970	中科三环	11,644,864.74	4.87
47	002454	松芝股份	10,463,061.50	4.37
48	600366	宁波韵升	9,468,826.87	3.96
49	300568	星源材质	9,444,717.25	3.95
50	002101	广东鸿图	9,230,331.25	3.86
51	002091	江苏国泰	8,502,181.64	3.55
52	002850	科达利	7,801,376.16	3.26
53	000957	中通客车	7,397,892.17	3.09
54	603026	石大胜华	6,751,595.00	2.82
55	300742	越博动力	6,435,188.00	2.69
56	300224	正海磁材	6,055,143.00	2.53
57	002518	科士达	5,159,299.41	2.16

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。

8.4.3 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	5,952,517,224.87
卖出股票收入（成交）总额	2,423,297,319.60

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	577,732.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	45,703.12
5	应收申购款	86,085,162.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,708,598.32

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	603799	华友钴业	13,576,160.00	0.23	转融通出借流通受限
2	300750	宁德时代	10,603,522.00	0.18	转融通出借流通受限
3	002460	赣锋锂业	9,482,440.00	0.16	转融通出借流通受限

4	002594	比亚迪	3,963,720.00	0.07	转融通出借流通受限
5	002074	国轩高科	3,935,472.00	0.07	转融通出借流通受限
6	002812	恩捷股份	2,892,312.00	0.05	转融通出借流通受限
7	002050	三花智控	1,025,440.00	0.02	转融通出借流通受限

8.12.5.2 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	300888	稳健医疗	1,605,343.35	0.03	新股流通受限
2	300999	金龙鱼	633,657.33	0.01	新股流通受限
3	300896	爱美客	285,389.28	0.00	新股流通受限

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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（%）
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	295,371	5,514.00	329,910,017.45	20.26	1,298,765,989.02	79.74
汇添富中证新	324,301	3,491.21	44,574,421.85	3.94	1,087,628,669.76	96.06

能源汽车产业指数（LOF）C						
合计	619,672	4,455.39	374,484,439.30	13.56	2,386,394,658.78	86.44

9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	黄家周	3,987,162.00	3.33
2	钱中明	1,865,323.00	1.56
3	周保清	1,567,852.00	1.31
4	林建秀	1,253,033.00	1.05
5	刘明亮	1,125,200.00	0.94
6	吴新容	995,069.00	0.83
7	张庆旭	986,033.00	0.82
8	张杰	941,184.00	0.79
9	宋玮	857,325.00	0.72
10	王利霞	751,721.00	0.63
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	田文炼	400,000.00	1.96
2	胡晓	369,800.00	1.82
3	胡李莉	327,053.00	1.61
4	李东	314,754.00	1.55
5	毛秀英	300,013.00	1.47
6	张庆旭	294,161.00	1.44
7	姚新民	277,345.00	1.36
8	励佳	268,237.00	1.32
9	韦雅萍	250,045.00	1.23
10	陈郁文	250,000.00	1.23

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	544,443.38	0.03

基金	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C	211,450.51	0.02
	合计	755,893.89	0.03

9.4 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	份额级别	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	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	10~50
	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	0~10
	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C	0
	合计	0~10

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,600.36	0.36	10,003,600.36	0.36	3 年
基金管理人高级管理人员	266,571.89	0.01	-	-	
基金经理等人员	52,582.70	0.00	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	436,739.30	0.02	-	-	
合计	10,759,494.25	0.39	10,003,600.36	0.36	

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C
基金合同生效日（2018年05月23日）	310,738,440.50	431,457,611.74

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	142,253,840.90	90,329,605.55
本报告期基金总申购份额	3,698,773,247.71	3,513,484,361.48
减：本报告期基金总赎回份额	2,212,351,082.14	2,471,610,875.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,628,676,006.47	1,132,203,091.61

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

1、基金管理人于 2020 年 1 月 2 日公告，楚天舒女士不再担任汇添富沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，由董瑾女士单独管理该基金。

2、基金管理人于 2020 年 1 月 2 日公告，增聘董瑾女士为汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理，楚天舒女士不再担任上述基金的基金经理。

3、基金管理人于 2020 年 1 月 2 日公告，楚天舒女士不再担任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，由吴振翔先生单独管理该基金。

4、基金管理人于 2020 年 1 月 2 日公告，增聘董瑾女士为中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，楚天舒女士不再担任上述基金的基金经理。

5、基金管理人于 2020 年 1 月 2 日公告，增聘董瑾女士为汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理，楚天舒女士不再担任上述基金的基金经理。

6、基金管理人于 2020 年 1 月 7 日公告，增聘杨靖先生为汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

7、《汇添富大盘核心资产增长混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 8 日正式生效，王栩先生任该基金的基金经理。

8、基金管理人于 2020 年 1 月 9 日公告，自 2020 年 1 月 7 日起，郑慧莲女士恢复履行

汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金、汇添富多元收益债券型证券投资基金、汇添富双利增强债券型证券投资基金、汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金、汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金、汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金、汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金、汇添富全球消费行业混合型证券投资基金、汇添富消费升级混合型证券投资基金、汇添富内需增长股票型证券投资基金的基金经理职务。

9、《汇添富中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 14 日正式生效，何旻先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，郑慧莲女士不再担任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，由曾刚先生单独管理该基金。

11、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，增聘徐寅喆女士为汇添富全额宝货币市场基金的基金经理，陶然先生不再担任上述基金的基金经理。

12、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，增聘温开强先生为汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理，陶然先生不再担任上述基金的基金经理。

13、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，增聘徐寅喆女士为汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，陶然先生不再担任上述基金的基金经理。

14、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，郑慧莲女士不再担任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理，由曾刚先生单独管理该基金。

15、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，陶然先生不再担任汇添富现金宝货币市场基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理该基金。

16、基金管理人于 2020 年 2 月 27 日公告，增聘温开强先生为汇添富理财 60 天债券型证券投资基金的基金经理，与徐寅喆女士共同管理该基金。

17、基金管理人于 2020 年 2 月 29 日公告，聘任王骏杰为汇添富全额宝货币市场基金、汇添富收益快线货币市场基金和汇添富收益快钱货币市场基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。陶然不再担任汇添富和聚宝货币市场基金、汇添富理财 7 天债券型证券投资基金的基金经理助理。

18、基金管理人于 2020 年 3 月 4 日公告，聘任李云鑫为汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金、汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金

经理开展投资管理工作。

19、《汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于2020年3月5日正式生效，吴振翔先生和董瑾女士任该基金的基金经理。

20、《汇添富中盘积极成长混合型证券投资基金基金合同》于2020年3月13日正式生效，郑磊先生任该基金的基金经理。

21、基金管理人于2020年3月20日公告，聘任李云鑫为汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

22、基金管理人于2020年3月21日公告，增聘谭志强先生为汇添富社会责任混合型证券投资基金的基金经理，雷鸣先生不再担任上述基金的基金经理。

23、基金管理人于2020年3月21日公告，增聘马翔先生为汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生和吴江宏先生共同管理该基金。

24、基金管理人于2020年3月25日公告，徐光先生不再担任汇添富丰润中短债债券型证券投资基金的基金经理，由蒋文玲女士单独管理该基金。

25、基金管理人于2020年3月25日公告，蒋文玲女士不再担任汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由曾刚先生和郑慧莲女士共同管理该基金。

26、基金管理人于2020年3月25日公告，增聘杨靖先生为汇添富鑫利定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，吴江宏先生不再担任上述基金的基金经理。

27、基金管理人于2020年3月25日公告，增聘刘通先生为汇添富鑫瑞债券型证券投资基金的基金经理，胡娜女士和陆文磊先生不再担任上述基金的基金经理。

28、基金管理人于2020年3月25日公告，吴江宏先生不再担任汇添富鑫盛定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，由胡娜女士单独管理该基金。

29、基金管理人于2020年3月25日公告，增聘刘通先生为汇添富鑫泽定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，徐光先生和陆文磊先生不再担任上述基金的基金经理。

30、基金管理人于2020年3月25日公告，吴江宏先生和曾刚先生不再担任汇添富盈安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由马翔先生单独管理该基金。

31、基金管理人于2020年3月25日公告，吴江宏先生不再担任汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由曾刚先生单独管理该基金。

32、《汇添富鑫福债券型证券投资基金基金合同》于2020年3月30日正式生效，徐光先生任该基金的基金经理。

33、《汇添富多策略纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 1 日正式生效，刘通先生任该基金的基金经理。

34、《汇添富中短债债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 9 日正式生效，徐光先生任该基金的基金经理。

35、基金管理人于 2020 年 4 月 16 日公告，聘任李云鑫为汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

36、《汇添富积极投资核心优势三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于 2020 年 4 月 26 日正式生效，袁建军先生任该基金的基金经理。

37、基金管理人于 2020 年 5 月 21 日公告，增聘赵剑先生为汇添富环保行业股票型证券投资基金的基金经理，赵鹏程先生不再担任上述基金的基金经理。

38、基金管理人于 2020 年 5 月 21 日公告，增聘李云鑫先生为汇添富盈泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，曾刚先生不再担任上述基金的基金经理。

39、《汇添富稳健增益一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 22 日正式生效，赵鹏飞先生和叶盛先生任该基金的基金经理。

40、《汇添富优质成长混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 25 日正式生效，杨璿先生任该基金的基金经理。

41、基金管理人于 2020 年 5 月 30 日公告，刘江先生不再担任汇添富创新医药主题混合型证券投资基金的基金经理，由郑磊先生单独管理该基金。

42、基金管理人于 2020 年 6 月 5 日公告，徐光先生不再担任汇添富 AAA 级信用纯债债券型证券投资基金的基金经理，由杨靖先生单独管理该基金。

43、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，曾刚先生不再担任汇添富保鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由吴江宏先生单独管理该基金。

44、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，增聘叶盛先生为汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理，与赵鹏飞先生共同管理该基金，吴江宏先生不再担任上述基金的基金经理。

45、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，增聘徐一恒先生为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与郑慧莲女士共同管理该基金，吴江宏先生不再担任上述基金的基金经理。

46、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，增聘徐一恒先生为汇添富年年泰定期开放混

合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生和郑慧莲女士共同管理该基金。

47、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，增聘徐一恒先生为汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与郑慧莲女士共同管理该基金，曾刚先生不再担任上述基金的基金经理。

48、基金管理人于 2020 年 6 月 6 日公告，增聘徐一恒先生为汇添富实业债债券型证券投资基金的基金经理，曾刚先生和蒋文玲女士不再担任上述基金的基金经理。

49、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，郑慧莲女士不再担任汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，由吴江宏先生单独管理该基金。

50、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘李云鑫先生为汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金，郑慧莲女士不再担任上述基金的基金经理。

51、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘李云鑫先生为汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金，郑慧莲女士不再担任上述基金的基金经理。

52、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘刘通先生为汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

53、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘赵鹏程先生为汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生共同管理该基金。

54、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘杨靖先生为汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与胡昕炜先生和曾刚先生共同管理该基金。

55、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘赵鹏程先生为汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生共同管理该基金。

56、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘李云鑫先生为汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金，郑慧莲女士不再担任上述基金的基金经理。

57、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘赵鹏程先生为汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生共同管理该基金。

58、基金管理人于 2020 年 6 月 11 日公告，增聘赵鹏程先生为汇添富盈鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，郑慧莲女士不再担任上述基金的基金经理。

59、基金管理人于 2020 年 6 月 12 日公告，聘任李云鑫为汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

60、基金管理人于 2020 年 6 月 13 日公告，曾刚先生不再担任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理，由吴江宏先生单独管理该基金。

61、基金管理人于 2020 年 6 月 13 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，由徐光先生单独管理该基金。

62、《汇添富创新增长一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 22 日正式生效，马翔先生任该基金的基金经理。

63、基金管理人于 2020 年 7 月 1 日公告，增聘董超先生为汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生共同管理该基金。

64、基金管理人于 2020 年 7 月 1 日公告，胡昕炜先生不再担任汇添富全球消费行业混合型证券投资基金的基金经理，由郑慧莲女士单独管理该基金。

65、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富安鑫智选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与李云鑫先生共同管理该基金，曾刚先生不再担任上述基金的基金经理。

66、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富达欣灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与李云鑫先生共同管理该基金，曾刚先生不再担任上述基金的基金经理。

67、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生和赵鹏程先生共同管理该基金。

68、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理，与刘伟林先生和曾刚先生共同管理该基金。

69、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生和赵鹏程先生共同管理该基金。

70、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富熙和精选混合型证券投资基金的基金经理，与李云鑫先生共同管理该基金，曾刚先生不再担任上述基金的基金经理。

71、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与刘伟林先生和曾刚先生共同管理该基金。

72、基金管理人于 2020 年 7 月 3 日公告，增聘胡奕女士为汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生和赵鹏程先生共同管理该基金。

73、《汇添富中盘价值精选混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 8 日正式生效，胡昕炜先生任该基金的基金经理。

74、基金管理人于 2020 年 7 月 10 日公告，何旻先生不再担任汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理，由杨靖先生单独管理该基金。

75、基金管理人于 2020 年 7 月 10 日公告，增聘徐光先生为汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

76、《汇添富聚焦价值成长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于 2020 年 7 月 13 日正式生效，袁建军先生任该基金的基金经理。

77、《汇添富开放视野中国优势六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 22 日正式生效，劳杰男先生任该基金的基金经理。

78、《汇添富稳健收益混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 23 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

79、《汇添富策略增长两年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 24 日正式生效，马翔先生任该基金的基金经理。

80、《汇添富科创板 2 年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 28 日正式生效，马翔先生任该基金的基金经理。

81、基金管理人于 2020 年 7 月 30 日公告，增聘李彪先生为汇添富养老目标日期 2040 五年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理，与蔡健林先生共同管理该基金。

82、基金管理人于 2020 年 7 月 30 日公告，增聘李彪先生为汇添富养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理，与蔡健林先生共同管理该基金。

83、基金管理人于 2020 年 8 月 6 日公告，增聘李云鑫先生为汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理，与叶盛先生和赵鹏飞先生共同管理该基金。

84、基金管理人于 2020 年 8 月 6 日公告，增聘徐一恒先生为汇添富稳健收益混合型证券投资基金的基金经理，与赵鹏飞先生共同管理该基金。

85、《汇添富医疗积极成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 8 月 21 日正式生效，郑磊先生任该基金的基金经理。

86、基金管理人于 2020 年 8 月 27 日公告，增聘王骏杰先生为汇添富和聚宝货币市场

基金的基金经理，与徐寅喆女士共同管理该基金。

87、基金管理人于 2020 年 8 月 27 日公告，增聘王骏杰先生为汇添富汇鑫浮动净值型货币市场基金的基金经理，与徐寅喆女士和蒋文玲女士共同管理该基金。

88、基金管理人于 2020 年 9 月 2 日公告，增聘杨靖先生为汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，徐光先生不再担任上述基金的基金经理。

89、基金管理人于 2020 年 9 月 5 日公告，顾耀强先生不再担任汇添富逆向投资混合型证券投资基金的基金经理，由董超先生单独管理该基金。

90、《汇添富稳健添盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 10 日正式生效，刘江先生和徐一恒先生任该基金的基金经理。

91、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，由刘通先生单独管理该基金。

92、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由胡昕炜先生和杨靖先生共同管理该基金。

93、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，由郑慧莲女士和徐一恒先生共同管理该基金。

94、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富睿丰混合型证券投资基金（LOF）的基金经理，由刘伟林先生和胡奕女士共同管理该基金。

95、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理，由徐光先生单独管理该基金。

96、基金管理人于 2020 年 9 月 19 日公告，曾刚先生不再担任汇添富新睿精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，由刘伟林先生和胡奕女士共同管理该基金。

97、《汇添富创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 10 月 13 日正式生效，劳杰男先生任该基金的基金经理。

98、《汇添富品牌驱动六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 10 月 19 日正式生效，郑慧莲女士任该基金的基金经理。

99、基金管理人于 2020 年 10 月 31 日公告，吴江宏先生不再担任汇添富弘安混合型证券投资基金的基金经理，由赵鹏程先生和胡奕女士共同管理该基金。

100、基金管理人于 2020 年 10 月 31 日公告，增聘叶盛先生为汇添富稳健添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，蒋文玲女士不再担任上述基金的基金经理。

101、《汇添富稳健汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 4 日正式生效，杨靖先生和李云鑫先生任该基金的基金经理。

102、《汇添富盛和 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 6 日正式生效，杨靖先生任该基金的基金经理。

103、《汇添富数字生活主题六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 18 日正式生效，杨璿先生任该基金的基金经理。

104、《汇添富高质量成长精选 2 年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 12 月 2 日正式生效，刘江先生任该基金的基金经理。

105、基金管理人于 2020 年 12 月 24 日公告，增聘张朋先生为汇添富移动互联股票型证券投资基金的基金经理，杨璿先生不再担任上述基金的基金经理。

106、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

自 2020 年 11 月 13 日起，本基金增加存托凭证的投资策略，投资策略请详见 2020 年 11 月 13 日刊登在本公司网站的本基金《基金合同》。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2018 年 05 月 23 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币 80,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
中信 证券	2	1,832,716,152.37	22.00	1,670,157.76	21.87	
信达 证券	1	1,328,346,393.07	15.95	1,210,523.93	15.85	
国信 证券	2	754,961,279.63	9.06	690,419.31	9.04	
东方 证券	3	748,012,848.99	8.98	685,900.76	8.98	
国海 证券	2	591,496,812.65	7.10	542,445.25	7.10	
中泰 证券	1	442,461,118.00	5.31	403,216.63	5.28	
国泰 君安	1	401,480,729.70	4.82	365,870.25	4.79	
中金 公司	2	396,218,711.32	4.76	368,997.36	4.83	
长江 证券	1	321,790,292.63	3.86	299,679.59	3.92	
海通 证券	1	318,309,992.21	3.82	296,441.54	3.88	
中信 建投	1	304,452,314.96	3.65	283,542.71	3.71	
东吴 证券	1	264,603,528.78	3.18	246,423.30	3.23	
瑞银 证券	2	195,974,998.75	2.35	179,593.54	2.35	
平安 证券	1	145,108,240.37	1.74	132,237.65	1.73	
申万 宏源 证券	1	112,146,014.55	1.35	104,440.55	1.37	
华泰 证券	2	110,016,914.17	1.32	100,496.13	1.32	
兴业 证券	1	61,679,147.43	0.74	57,442.05	0.75	
长城 证券	2	-	-	-	-	
东北 证券	2	-	-	-	-	
东兴 证券	1	-	-	-	-	
广发	1	-	-	-	-	

证券						
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	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。

11.7.2 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 (%)
中信证券	1,378,889.60	1.32	-	-	-	-	-	-
信达证券	3,756,096.77	3.58	-	-	-	-	-	-
国信证券	1,618,417.60	1.54	-	-	-	-	-	-
东方证券	3,394,034.18	3.24	-	-	-	-	-	-
国海证券	16,304,586.00	15.56	-	-	-	-	-	-
中泰证券	3,630,197.38	3.46	-	-	-	-	-	-
国泰君安	2,290,210.36	2.19	-	-	-	-	-	-
中金公司	14,337,478.10	13.68	-	-	-	-	-	-
长江证券	2,403,600.00	2.29	-	-	-	-	-	-

海通 证券	9,007,534.00	8.59	-	-	-	-	-	-
中信 建投	17,730,003.40	16.92	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	7,790,233.90	7.43	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	12,170,679.40	11.61	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	4,496,735.00	4.29	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	4,496,735.00	4.29	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 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。

11.8 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
5	汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2020 年 3 月 19 日更新）	上交所, 证券时报, 公司网站	2020 年 03 月 19 日
6	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

7	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
8	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
9	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
10	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
11	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	上证报, 公司网站	2020 年 05 月 16 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加招商银行开展的费率优惠活动的公告	证券时报, 公司网站	2020 年 05 月 20 日
13	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
14	汇添富基金旗下 151 只基金 2020 年 2 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 07 月 21 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于调整特定投资群体通过直销中心申购旗下部分基金的费率优惠方案的公告	上证报, 公司网站	2020 年 08 月 06 日
16	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告	上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2020 年 08 月 28 日
17	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金产品资料概要	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 08 月 31 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于设立南京分公司的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 09 月 05 日
19	汇添富基金管理股份有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报, 公司网站	2020 年 10 月 28 日

20	汇添富基金旗下 160 只基金 2020 年 3 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 10 月 28 日
21	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	上交所, 证券时报, 公司网站, 深交所	2020 年 11 月 04 日
22	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所	2020 年 11 月 13 日
23	汇添富基金管理股份有限公司旗下 125 只基金更新招募说明书及产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所	2020 年 11 月 17 日
24	汇添富基金管理股份有限公司关于暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报, 公司网站	2020 年 12 月 09 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关于终止与部分代销机构合作关系的公告	证券时报, 公司网站	2020 年 12 月 19 日
26	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京电盈基金销售有限公司合作关系的公告	中证报, 公司网站	2020 年 12 月 28 日
27	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公告	上交所, 公司网站, 深交所, 证券日报	2020 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 21 日至 2020 年 1 月 22	-	232,507,972.00	72,000,000.00	160,507,972.00	5.81

		日, 2020 年 1 月 8 日至 2020 年 1 月 13 日				
产品特有风险						
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险 基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于 2 亿元人民币的，本基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。《基金合同》生效三年后继续存续的，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>						

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；
- 2、《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）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。

13.2 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

13.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2021 年 03 月 30 日